

华商龙头优势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：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
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.....	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商龙头优势混合型证券投资基金
基金简称	华商龙头优势混合
基金主代码	008555
交易代码	008555
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	147,529,487.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过筛选各行业中的龙头上市公司进行投资，把握其显著竞争优势下所蕴含的长期投资价值。在风险可控的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过自下而上地筛选各行业中的龙头上市公司（包含“港股通标的股票”）进行投资，把握其显著竞争优势下所蕴含的长期投资价值。具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	中证龙头企业指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏	许俊
	联系电话	010-58573600	95566
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4007008880	95566
传真		010-58573520	010-66594942
注册地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100035	100818
法定代表人	陈牧原	刘连舸

2.4 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	http://www.hsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 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	-9,123,903.51
本期利润	-15,592,925.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1024
本期加权平均净值利润率	-10.20%
本期基金份额净值增长率	-8.12%
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	11,263,650.14
期末可供分配基金份额利润	0.0763
期末基金资产净值	158,793,137.29
期末基金份额净值	1.0763
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	7.63%

注：1. 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。

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

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

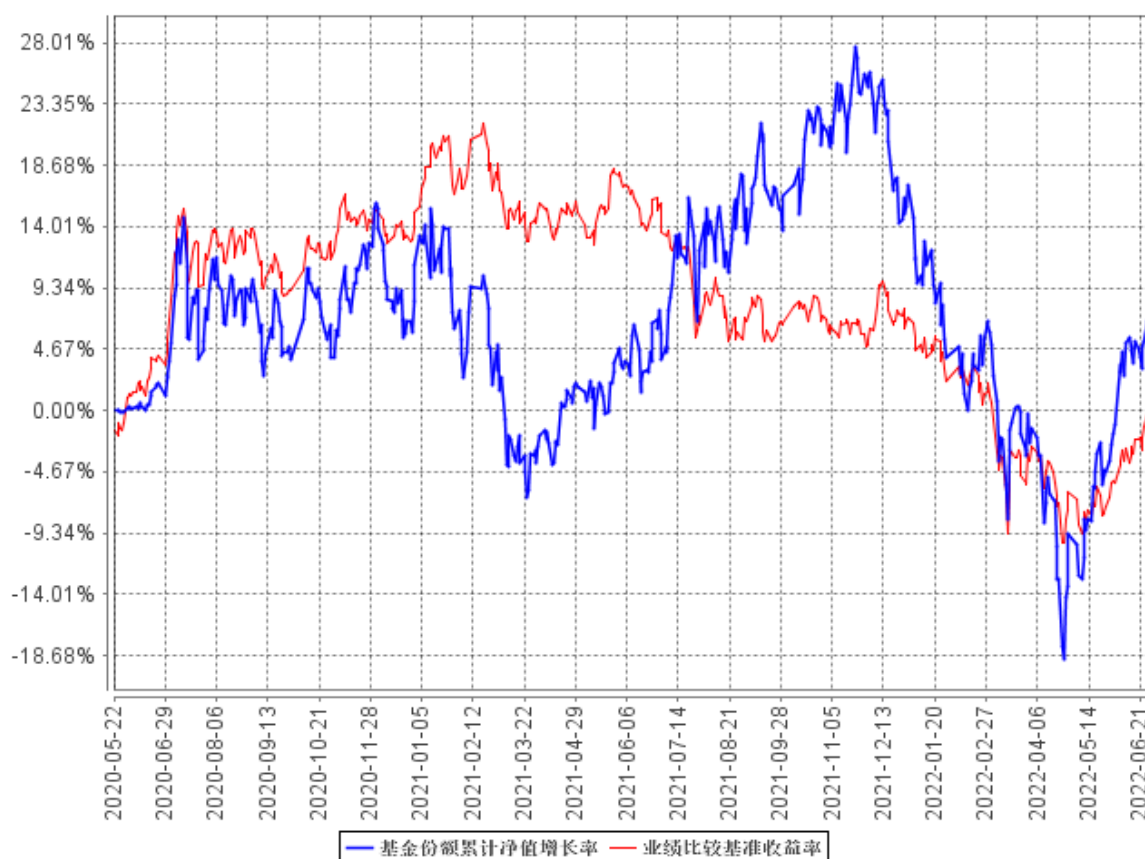
3.2 基金净值表现

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	10.48%	1.51%	6.66%	0.80%	3.82%	0.71%
过去三个月	10.38%	2.07%	4.83%	1.05%	5.55%	1.02%
过去六个月	-8.12%	1.95%	-5.90%	1.13%	-2.22%	0.82%
过去一年	0.00%	1.80%	-12.81%	0.96%	12.81%	0.84%
自基金合同生效起至今	7.63%	1.63%	0.80%	0.89%	6.83%	0.74%

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

基金份额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：①本基金合同生效日为 2020 年 5 月 22 日。

②根据《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经

中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于本基金所界定的龙头上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，成立于 2005 年 12 月 20 日，注册资本为 10000 万元人民币，注册地为北京市，是一家为客户提供专业理财服务的资产管理机构。

本基金管理人拥有公募基金管理业务、私募资产管理业务、受托管理保险资金业务等业务资格，在主动权益、固定收益、量化投资、FOF 投资等领域全面布局，为客户提供专业理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李双全	基金经理，权益投资部副总经理，公司公募业务权益投资决	2020 年 5 月 22 日	-	12.2	男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。2007 年 8 月至 2010 年 4 月就职于 SK 能源公司从事财务工作；2010 年 4 月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2014 年 8 月 1 日至 2015 年 4 月 7

	策委员会委员			<p>日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金的基金经理助理；2015 年 4 月 8 日至 2021 年 1 月 19 日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金的基金经理；2015 年 7 月 8 日起至今担任华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 2 日起至今担任华商改革创新股票型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 23 日起至今担任华商未来主题混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 5 月 22 日起至今担任华商龙头优势混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 16 日起至今担任华商景气优选混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 19 日起至今担任华商远见价值混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--------	--	--	--

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。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《证券投资基金法》及其他有关法律法规、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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

2022 年上半年市场波动较为明显。年初以来，国内房地产市场持续疲软，叠加疫情对社会生产生活的冲击，我国的经济增长遇到了较大的困难。海外受到俄乌战争的冲击，部分资源和能源品供给受到影响，价格出现明显上涨，给全球经济带来了更大的通胀压力，在此背景下，以美联储为代表的主要央行先后收紧货币政策，开始持续加息。三四月份以上负面预期持续发酵，市场出现了急剧调整。五月份以来，随着国内防疫形势逐步好转，企业生产经营活动回归正常，政策层面稳增长不断发力，市场在五六月份持续反弹，以新半军为代表的景气度改善明显的行业表现优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0763 元，份额累计净值为 1.0763 元。本报告

期内本基金份额净值增长率为-8.12%，同期基金业绩比较基准的收益率为-5.90%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准的收益率 2.22 个百分点。

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，我们认为市场将回归较为平稳走势。一方面随着稳增长政策的落地，我们预期三季度经济将延续五六月份以来的企稳复苏态势，经济和企业盈利改善为市场稳定提供了基础条件。另一方面，国内流动性环境仍较为宽松，房地产市场弱复苏背景下，股票市场仍是居民资产配置的重点，使得市场结构性机会较多。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通

受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次。本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华商龙头优势混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商龙头优势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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	30,263,462.43	14,911,636.12
结算备付金		-	475,303.14
存出保证金		23,069.06	143,767.99
交易性金融资产	6.4.7.2	110,651,538.82	170,759,908.88
其中：股票投资		110,651,538.82	170,759,908.88
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		23,461,214.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		19,467.60	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,985.73
资产总计		164,418,752.07	186,292,601.86
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,912,092.83	-
应付赎回款		164,749.27	-
应付管理人报酬		190,464.82	248,415.64
应付托管费		31,744.13	41,402.62
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	326,563.73	356,541.33
负债合计		5,625,614.78	646,359.59
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	147,529,487.15	158,479,956.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	11,263,650.14	27,166,285.28
净资产合计		158,793,137.29	185,646,242.27
负债和净资产总计		164,418,752.07	186,292,601.86

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0763 元，基金份额总额 147,529,487.15 份。

6.2 利润表

会计主体：华商龙头优势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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-14,163,196.07	-11,610,230.10
1.利息收入		29,493.55	100,694.73
其中：存款利息收入	6.4.7.10	29,493.55	100,146.60
债券利息收入		-	548.13
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）		-7,735,314.24	-1,471,374.73
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-8,351,666.40	-3,575,139.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	745,766.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	616,352.16	1,357,997.91
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,469,022.42	-10,885,803.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,647.04	646,253.19
减：二、营业总支出		1,429,729.86	6,250,072.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,139,131.61	3,358,142.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	189,855.31	559,690.39
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		-	1.97
8. 其他费用	6.4.7.20	100,742.94	2,332,238.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,592,925.93	-17,860,303.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,592,925.93	-17,860,303.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,592,925.93	-17,860,303.06

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华商龙头优势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 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）	158,479,956.99	-	27,166,285.28	185,646,242.27
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）	158,479,956.99	-	27,166,285.28	185,646,242.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,950,469.84	-	-15,902,635.14	-26,853,104.98
（一）、综合收益总额	-	-	-15,592,925.93	-15,592,925.93
（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）	-10,950,469.84	-	-309,709.21	-11,260,179.05
其中：1.基金申购款	3,678,196.94	-	90,828.20	3,769,025.14
2.基金赎回款	-14,628,666.78	-	-400,537.41	-15,029,204.19
（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)	147,529,487.15	-	11,263,650.14	158,793,137.29
项目	上年度可比期间 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)	704,013,930.75	-	78,229,291.10	782,243,221.85
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)	704,013,930.75	-	78,229,291.10	782,243,221.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-375,108,093.04	-	-53,127,420.78	-428,235,513.82
(一)、综合收益总额	-	-	-17,860,303.06	-17,860,303.06
(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)	-375,108,093.04	-	-35,267,117.72	-410,375,210.76
其中: 1.基金申购款	32,341,198.47	-	2,561,629.64	34,902,828.11
2.基金赎回款	-407,449,291.51	-	-37,828,747.36	-445,278,038.87
(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)	328,905,837.71	-	25,101,870.32	354,007,708.03

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:

_____ 王小刚 _____
_____ 程蕾 _____
_____ 程蕾 _____
 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

华商龙头优势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下

简称“中国证监会”)证监许可[2019]2526号《关于准予华商龙头优势混合型证券投资基金注册的批复》注册,由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,624,728,650.30 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(2020)第 0408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,625,571,541.49 份基金份额,其中认购资金利息折合 842,891.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票投资比例占基金资产的 60%-95%,其中投资于本基金所界定的龙头上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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:中证龙头企业指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下文列示的会计政策外，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

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其

中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 14,911,636.12 元、475,303.14 元、143,767.99 元和 1,985.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 14,913,315.39 元、475,538.43 元、143,839.16 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 170,759,908.88 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 170,759,908.88 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 248,415.64 元、41,402.62 元和 162,041.33 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 248,415.64 元、41,402.62 元和 162,041.33 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基

金通过沪港通或深港通买卖、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 2022年6月30日
活期存款	30,263,462.43
等于：本金	30,260,617.94
加：应计利息	2,844.49
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：	30,263,462.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	105,009,601.71	-	110,651,538.82	5,641,937.11
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	105,009,601.71	-	110,651,538.82	5,641,937.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	91.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	162,712.35
其中：交易所市场	162,712.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	163,760.15
合计	326,563.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

本期期初	158,479,956.99	158,479,956.99
本期申购	3,678,196.94	3,678,196.94
本期赎回(以“-”号填列)	-14,628,666.78	-14,628,666.78
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	147,529,487.15	147,529,487.15

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期内未发生其他综合收益。

6.4.7.9 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	53,324,320.74	-26,158,035.46	27,166,285.28
本期利润	-9,123,903.51	-6,469,022.42	-15,592,925.93
本期基金份额交易产生的变动数	-3,304,994.87	2,995,285.66	-309,709.21
其中：基金申购款	1,118,179.29	-1,027,351.09	90,828.20
基金赎回款	-4,423,174.16	4,022,636.75	-400,537.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,895,422.36	-29,631,772.22	11,263,650.14

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	28,438.97
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	481.41
其他	573.17
合计	29,493.55

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	124,705,739.76
减：卖出股票成本总额	132,727,482.70
减：交易费用	329,923.46
买卖股票差价收入	-8,351,666.40

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未发生权证投资收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未发生衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 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	616,352.16
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	616,352.16

6.4.7.17 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	-6,469,022.42
——股票投资	-6,469,022.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-6,469,022.42

6.4.7.18 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	11,647.04
合计	11,647.04

注：1. 基金赎回费收入含转换费收入。

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

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

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

债券账户维护费	9,000.00
银行费用	2,482.79
其他	-
合计	100,742.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有应支付关联方的佣金。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,139,131.61	3,358,142.26
其中：支付销售机构的客户维护费	322,266.06	984,467.59

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	189,855.31	559,690.39

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		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
中国银行	30,263,462.43	28,438.97	42,287,796.81	85,701.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁定	55.57	30.03	94	5,223.58	2,822.82	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定	39.88	31.09	124	4,945.12	3,855.16	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	63.10	39.85	66	4,164.60	2,630.10	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股锁定	11.40	20.46	361	4,115.40	7,386.06	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	13.73	15.49	461	6,329.53	7,140.89	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股锁定	22.55	37.70	163	3,675.65	6,145.10	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	30.82	21.46	141	4,345.62	3,025.86	-

301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	15.64	20.38	265	4,144.60	5,400.70	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	52	3,332.16	1,951.04	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股锁定	76.56	51.92	80	6,124.80	4,153.60	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定	72.69	71.54	76	5,524.44	5,437.04	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定	56.88	56.42	55	3,128.40	3,103.10	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	122	4,352.96	3,640.48	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	17.27	14.83	440	7,598.80	6,525.20	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	20.08	20.34	248	4,979.84	5,044.32	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	39.30	37.93	124	4,873.20	4,703.32	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股锁定	48.59	31.38	156	7,579.52	4,895.28	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.87	148	5,782.36	4,420.76	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	8.05	10.08	554	4,459.70	5,584.32	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股锁定	19.93	31.38	195	3,886.35	6,119.10	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	19.09	19.98	317	6,051.53	6,333.66	-

注：1. 受限期从成功认购日开始计算。

2. 本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。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通过筛选各行业中的龙头上市公司进行投资，把握其显著竞争优势下所蕴含的长期投资价值。在风险可控的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括四个层次：(1) 公司一级风险防范由董事会构成。董事会根据公司章程和《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定履行风险管理职责。董事会下设专业委员会，各专业委员会根据董事会授权和相关议事规则履行相应风险管理和监督职责。(2) 公司二级风险防范由公司管理层构成。公司管理层负责在决策和执行过程中全面把控各类风险，并根据董事会的决议和《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定履行风险管理职责。各高级管理人员负责监督分管业务条线的风险控制质量和执行情况，评价分管业务条线的风险管理水平和效果。(3) 公司的三级风险防范由风险管理小组等职能机构构成。风险管理小组对公司经营过程和基金运作过程中的重大风险进行分析、评估，防范和化解公司在经营过程和基金运作过程中面临的各种风险；其他职能机构(如各级投资决策委员会等)在职能范围内依据各职能机构的议事规则对相关业务进行集体决策和风险控制。(4) 公司四级风险防范由公司各部门及公司员工构成。公司各部门及公司员工对自身业务工作中的风险进行自我检查和控制，并根据公司经营计划、部门或岗位职责以及《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定承担相应风险管理责任。各部门、岗位之间相互监督、制衡。

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.07%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	30,263,462.43	-	-	-	30,263,462.43
存出保证金	23,069.06	-	-	-	23,069.06
交易性金融资产	-	-	-	110,651,538.82	110,651,538.82
应收清算款	-	-	-	23,461,214.16	23,461,214.16
应收申购款	-	-	-	19,467.60	19,467.60
资产总计	30,286,531.49	-	-	134,132,220.58	164,418,752.07
负债					
应付清算款	-	-	-	4,912,092.83	4,912,092.83
应付赎回款	-	-	-	164,749.27	164,749.27
应付管理人报酬	-	-	-	190,464.82	190,464.82
应付托管费	-	-	-	31,744.13	31,744.13
其他负债	-	-	-	326,563.73	326,563.73
负债总计	-	-	-	5,625,614.78	5,625,614.78
利率敏感度缺口	30,286,531.49	-	-	128,506,605.80	158,793,137.29
上年度末 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	14,911,636.12	-	-	-	14,911,636.12
结算备付金	475,303.14	-	-	-	475,303.14
存出保证金	143,767.99	-	-	-	143,767.99
交易性金融资产	-	-	-	170,759,908.88	170,759,908.88
其他资产	-	-	-	1,985.73	1,985.73
资产总计	15,530,707.25	-	-	170,761,894.61	186,292,601.86
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	248,415.64	248,415.64
应付托管费	-	-	-	41,402.62	41,402.62
其他负债	-	-	-	356,541.33	356,541.33
负债总计	-	-	-	646,359.59	646,359.59
利率敏感度缺口	15,530,707.25	-	-	170,115,535.02	185,646,242.27

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过自下而上地筛选各行业中的龙头上市公司(包含“港股通标的股票”)进行投资，把握其显著竞争优势下所蕴含的长期投资价值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者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。本基金投资于本基金所界定的龙头上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 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	110,651,538.82	69.68	170,759,908.88	91.98
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	110,651,538.82	69.68	170,759,908.88	91.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	9,215,399.13	8,811,073.70
2. 沪深 300 指数下降 5%	-9,215,399.13	-8,811,073.70	

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	110,551,220.91	170,015,432.86
第二层次	-	744,476.02
第三层次	100,317.91	-
合计	110,651,538.82	170,759,908.88

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及

限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 06 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(2021 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	110,651,538.82	67.30
	其中：股票	110,651,538.82	67.30
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	30,263,462.43	18.41
8	其他各项资产	23,503,750.82	14.30
9	合计	164,418,752.07	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	4,262.17	0.00
B	采矿业	19,761,963.42	12.45
C	制造业	63,757,835.34	40.15

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,242.37	0.00
E	建筑业	16,744.08	0.01
F	批发和零售业	69,990.16	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	12,107.89	0.01
H	住宿和餐饮业	12,481.20	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,032,431.21	0.65
J	金融业	5,046,456.74	3.18
K	房地产业	20,732,625.44	13.06
L	租赁和商务服务业	25,631.95	0.02
M	科学研究和技术服务业	160,128.09	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	6,896.12	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,470.00	0.00
Q	卫生和社会工作	2,416.38	0.00
R	文化、体育和娱乐业	856.26	0.00
S	综合	-	-
	合计	110,651,538.82	69.68

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600048	保利发展	600,000	10,476,000.00	6.60
2	000002	万科 A	500,000	10,250,000.00	6.45
3	002466	天齐锂业	80,000	9,984,000.00	6.29
4	600438	通威股份	166,000	9,936,760.00	6.26
5	601012	隆基绿能	141,120	9,402,825.60	5.92
6	601899	紫金矿业	1,000,000	9,330,000.00	5.88
7	600519	贵州茅台	4,000	8,180,000.00	5.15
8	000568	泸州老窖	30,000	7,396,200.00	4.66
9	002475	立讯精密	200,000	6,758,000.00	4.26
10	002460	赣锋锂业	45,000	6,691,500.00	4.21
11	601225	陕西煤业	300,000	6,354,000.00	4.00
12	600999	招商证券	350,000	5,043,500.00	3.18

13	601666	平煤股份	300,000	4,077,000.00	2.57
14	000807	云铝股份	300,000	2,964,000.00	1.87
15	002415	海康威视	45,000	1,629,000.00	1.03
16	002777	久远银海	65,000	934,700.00	0.59
17	688105	诺唯赞	1,408	119,539.20	0.08
18	688212	澳华内镜	2,203	103,100.40	0.06
19	301120	新特电气	4,605	81,484.25	0.05
20	301288	清研环境	3,161	75,499.74	0.05
21	688049	炬芯科技	1,304	49,630.24	0.03
22	301248	杰创智能	1,473	47,801.26	0.03
23	688192	迪哲医药	1,338	35,778.12	0.02
24	301099	雅创电子	400	33,392.00	0.02
25	301151	冠龙节能	1,405	32,375.94	0.02
26	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.02
27	301089	拓新药业	203	25,500.86	0.02
28	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
29	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
30	301073	君亭酒店	180	12,481.20	0.01
31	301101	明月镜片	236	12,113.88	0.01
32	301201	诚达药业	155	11,219.84	0.01
33	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.01
34	301111	粤万年青	395	10,830.90	0.01
35	605117	德业股份	38	10,635.82	0.01
36	301180	万祥科技	500	10,475.00	0.01
37	301078	孩子王	663	9,719.58	0.01
38	300957	贝泰妮	44	9,571.32	0.01
39	301098	金埔园林	369	8,948.25	0.01
40	301091	深城交	320	8,736.00	0.01
41	301130	西点药业	225	8,625.10	0.01
42	301096	百诚医药	108	8,532.00	0.01
43	301198	喜悦智行	377	8,501.35	0.01
44	301207	华兰疫苗	143	8,331.18	0.01
45	301116	益客食品	403	8,259.66	0.01
46	301263	泰恩康	246	7,891.86	0.00
47	301126	达嘉维康	435	7,451.55	0.00
48	301217	铜冠铜箔	497	7,392.17	0.00
49	301138	华研精机	236	7,257.00	0.00
50	301158	德石股份	348	7,131.25	0.00
51	301090	华润材料	640	6,982.40	0.00

52	301168	通灵股份	150	6,762.00	0.00
53	300917	特发服务	214	6,625.44	0.00
54	301110	青木股份	158	6,613.70	0.00
55	301236	软通动力	205	6,509.83	0.00
56	301216	万凯新材	212	6,479.98	0.00
57	301256	华融化学	633	6,437.52	0.00
58	301081	严牌股份	419	6,318.52	0.00
59	301199	迈赫股份	196	6,279.84	0.00
60	300887	谱尼测试	140	5,979.40	0.00
61	301228	实朴检测	280	5,706.08	0.00
62	300953	震裕科技	40	5,479.60	0.00
63	301092	争光股份	174	5,474.04	0.00
64	605499	东鹏饮料	32	5,467.52	0.00
65	001215	千味央厨	95	5,347.55	0.00
66	301179	泽宇智能	131	5,346.11	0.00
67	301200	大族数控	99	5,179.60	0.00
68	001317	三羊马	100	5,074.00	0.00
69	301221	光庭信息	77	4,991.91	0.00
70	301235	华康医疗	131	4,976.18	0.00
71	301079	邵阳液压	196	4,860.80	0.00
72	300890	翔丰华	86	4,757.52	0.00
73	301100	风光股份	220	4,747.60	0.00
74	605080	浙江自然	74	4,727.86	0.00
75	605089	味知香	70	4,725.70	0.00
76	301108	洁雅股份	116	4,590.12	0.00
77	605305	中际联合	94	4,551.48	0.00
78	301190	善水科技	190	4,508.70	0.00
79	301102	兆讯传媒	137	4,287.28	0.00
80	301196	唯科科技	113	4,260.50	0.00
81	301088	戎美股份	224	4,179.84	0.00
82	301193	家联科技	153	4,153.95	0.00
83	301189	奥尼电子	120	3,997.20	0.00
84	300834	星辉环材	131	3,942.44	0.00
85	300981	中红医疗	156	3,934.32	0.00
86	605286	同力日升	97	3,923.65	0.00
87	301012	扬电科技	91	3,731.91	0.00
88	605098	行动教育	125	3,470.00	0.00
89	301093	华兰股份	99	3,355.11	0.00
90	300909	汇创达	129	3,316.59	0.00

91	300982	苏文电能	70	3,287.20	0.00
92	301033	迈普医学	76	3,200.36	0.00
93	001201	东瑞股份	82	3,163.56	0.00
94	300941	创识科技	148	3,115.40	0.00
95	301046	能辉科技	90	3,114.90	0.00
96	301021	英诺激光	99	2,989.80	0.00
97	605259	绿田机械	95	2,713.20	0.00
98	600955	维远股份	94	2,710.96	0.00
99	605090	九丰能源	126	2,554.02	0.00
100	301050	雷电微力	25	2,539.00	0.00
101	301060	兰卫医学	69	2,416.38	0.00
102	300932	三友联众	129	2,372.31	0.00
103	001266	宏英智能	47	2,340.13	0.00
104	603209	兴通股份	95	2,158.40	0.00
105	300892	品渥食品	72	2,156.40	0.00
106	001205	盛航股份	108	2,138.40	0.00
107	001219	青岛食品	93	2,125.05	0.00
108	300950	德固特	129	2,102.70	0.00
109	605389	长龄液压	78	2,089.62	0.00
110	300992	泰福泵业	98	2,088.38	0.00
111	300881	盛德鑫泰	91	2,080.26	0.00
112	300867	圣元环保	98	2,050.16	0.00
113	605555	德昌股份	77	1,961.19	0.00
114	605289	罗曼股份	99	1,958.22	0.00
115	605180	华生科技	109	1,895.51	0.00
116	605016	百龙创园	45	1,890.90	0.00
117	300958	建工修复	93	1,839.54	0.00
118	301010	晶雪节能	72	1,825.20	0.00
119	300902	国安达	51	1,805.91	0.00
120	601156	东航物流	90	1,782.00	0.00
121	301057	汇隆新材	73	1,777.55	0.00
122	300952	恒辉安防	98	1,705.20	0.00
123	001218	丽臣实业	70	1,671.60	0.00
124	300986	志特新材	45	1,656.00	0.00
125	301011	华立科技	50	1,644.50	0.00
126	301038	深水规院	78	1,621.62	0.00
127	605339	南侨食品	63	1,598.31	0.00
128	605378	野马电池	73	1,591.40	0.00
129	603215	比依股份	75	1,580.25	0.00

130	301035	润丰股份	19	1,566.55	0.00
131	300979	华利集团	21	1,534.68	0.00
132	300907	康平科技	73	1,508.91	0.00
133	605060	联德股份	83	1,506.45	0.00
134	002993	奥海科技	36	1,496.16	0.00
135	603150	万朗磁塑	50	1,488.50	0.00
136	603213	镇洋发展	99	1,482.03	0.00
137	300814	中富电路	80	1,464.00	0.00
138	603529	爱玛科技	27	1,414.26	0.00
139	300937	药易购	44	1,408.88	0.00
140	001207	联科科技	82	1,394.82	0.00
141	301029	怡合达	17	1,385.50	0.00
142	300926	博俊科技	59	1,377.65	0.00
143	301059	金三江	81	1,360.80	0.00
144	301027	华蓝集团	56	1,359.68	0.00
145	603324	盛剑环境	32	1,308.16	0.00
146	300985	致远新能	45	1,291.50	0.00
147	301049	超越科技	54	1,280.34	0.00
148	603048	浙江黎明	64	1,272.32	0.00
149	605300	佳禾食品	76	1,263.88	0.00
150	605287	德才股份	49	1,235.29	0.00
151	605589	圣泉集团	50	1,233.50	0.00
152	605020	永和股份	50	1,231.00	0.00
153	600927	永安期货	59	1,190.03	0.00
154	300945	曼卡龙	74	1,189.92	0.00
155	301053	远信工业	50	1,168.00	0.00
156	603216	梦天家居	72	1,165.68	0.00
157	300877	金春股份	69	1,142.64	0.00
158	300889	爱克股份	79	1,128.12	0.00
159	300971	博亚精工	45	1,109.25	0.00
160	300967	晓鸣股份	61	1,098.61	0.00
161	301036	双乐股份	47	1,056.56	0.00
162	300882	万胜智能	72	1,025.28	0.00
163	301026	浩通科技	27	995.76	0.00
164	301041	金百泽	50	985.50	0.00
165	605598	上海港湾	53	957.18	0.00
166	301017	漱玉平民	50	927.00	0.00
167	603511	爱慕股份	53	925.91	0.00
168	003041	真爱美家	59	919.81	0.00

169	001234	泰慕士	33	893.64	0.00
170	301016	雷尔伟	47	876.55	0.00
171	600906	财达证券	97	872.03	0.00
172	605599	菜百股份	80	870.40	0.00
173	001202	炬申股份	59	866.71	0.00
174	605086	龙高股份	43	861.72	0.00
175	300962	中金辐照	57	860.70	0.00
176	605566	福莱茵特	35	798.70	0.00
177	605365	立达信	45	745.65	0.00
178	301055	张小泉	41	728.98	0.00
179	605580	恒盛能源	54	727.92	0.00
180	300913	兆龙互连	45	714.15	0.00
181	300774	倍杰特	35	705.60	0.00
182	605162	新中港	77	696.85	0.00
183	001206	依依股份	21	696.15	0.00
184	300884	狄耐克	67	692.78	0.00
185	300911	亿田智能	9	691.65	0.00
186	001208	华菱线缆	54	670.68	0.00
187	301063	海锅股份	24	668.64	0.00
188	300994	久祺股份	20	656.20	0.00
189	603836	海程邦达	33	605.22	0.00
190	300963	中洲特材	30	581.40	0.00
191	001288	运机集团	37	577.57	0.00
192	605196	华通线缆	72	567.36	0.00
193	605167	利柏特	71	563.03	0.00
194	603219	富佳股份	28	557.76	0.00
195	300918	南山智尚	63	538.65	0.00
196	605033	美邦股份	23	533.37	0.00
197	300891	惠云钛业	43	519.01	0.00
198	300927	江天化学	30	519.00	0.00
199	300854	中兰环保	26	516.88	0.00
200	301037	保立佳	23	502.32	0.00
201	601825	沪农商行	80	501.60	0.00
202	605056	咸亨国际	33	500.61	0.00
203	603230	内蒙新华	40	500.40	0.00
204	001308	康冠科技	17	495.89	0.00
205	688107	安路科技	7	480.90	0.00
206	003042	中农联合	26	466.18	0.00
207	605268	王力安防	42	460.74	0.00

208	001209	洪兴股份	30	456.60	0.00
209	605567	春雪食品	29	454.14	0.00
210	688707	振华新材	6	454.02	0.00
211	605189	富春染织	22	441.76	0.00
212	300893	松原股份	21	424.20	0.00
213	001212	中旗新材	10	421.30	0.00
214	605133	嵘泰股份	18	411.84	0.00
215	605011	杭州热电	25	406.00	0.00
216	301030	仕净科技	17	396.44	0.00
217	001313	粤海饲料	32	392.32	0.00
218	300978	东箭科技	30	391.50	0.00
219	300948	冠中生态	24	380.88	0.00
220	002998	优彩资源	53	376.83	0.00
221	605488	福莱新材	23	362.02	0.00
222	301025	读客文化	27	355.86	0.00
223	301007	德迈仕	22	331.54	0.00
224	001296	长江材料	13	319.54	0.00
225	301028	东亚机械	29	313.78	0.00
226	301015	百洋医药	14	302.12	0.00
227	605028	世茂能源	15	298.95	0.00
228	001217	华尔泰	22	297.88	0.00
229	301062	上海艾录	25	291.75	0.00
230	301018	申菱环境	11	283.91	0.00
231	603759	海天股份	28	283.08	0.00
232	001210	金房节能	11	275.55	0.00
233	301048	金鹰重工	24	264.24	0.00
234	300940	南极光	11	258.83	0.00
235	688112	鼎阳科技	4	244.56	0.00
236	601528	瑞丰银行	30	241.80	0.00
237	603176	汇通集团	24	229.44	0.00
238	301032	新柴股份	24	223.20	0.00
239	301039	中集车辆	18	194.94	0.00
240	300995	奇德新材	9	192.60	0.00
241	300968	格林精密	20	181.20	0.00
242	688190	云路股份	2	155.50	0.00
243	688110	东芯股份	4	151.68	0.00
244	601665	齐鲁银行	31	151.28	0.00
245	605303	园林股份	10	128.50	0.00
246	300956	英力股份	7	126.98	0.00

247	605069	正和生态	8	122.72	0.00
248	001203	大中矿业	9	101.70	0.00
249	300933	中辰股份	12	97.80	0.00
250	688082	盛美上海	1	94.77	0.00
251	300998	宁波方正	3	90.75	0.00
252	001213	中铁特货	18	88.38	0.00
253	301013	利和兴	6	71.94	0.00
254	300920	润阳科技	3	64.08	0.00
255	301072	中捷精工	2	64.06	0.00
256	600935	华塑股份	11	57.64	0.00
257	605507	国邦医药	2	48.30	0.00
258	300878	维康药业	2	46.82	0.00
259	301040	中环海陆	1	30.53	0.00
260	601279	英利汽车	4	27.32	0.00
261	301002	崧盛股份	1	24.87	0.00
262	003040	楚天龙	1	20.56	0.00
263	605208	永茂泰	1	15.83	0.00
264	301009	可靠股份	1	12.48	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	10,592,043.00	5.71
2	600519	贵州茅台	7,458,058.00	4.02
3	000568	泸州老窖	6,399,834.00	3.45
4	002475	立讯精密	6,135,987.00	3.31
5	002176	江特电机	6,090,751.00	3.28
6	601688	华泰证券	6,079,997.17	3.28
7	601225	陕西煤业	6,030,982.00	3.25
8	002192	融捷股份	5,769,076.00	3.11
9	600999	招商证券	5,584,688.00	3.01
10	603619	中曼石油	5,008,760.00	2.70
11	601666	平煤股份	4,667,813.00	2.51
12	601012	隆基绿能	2,294,600.00	1.24

13	600438	通威股份	1,998,107.00	1.08
14	002415	海康威视	1,904,400.00	1.03
15	002460	赣锋锂业	1,890,105.00	1.02
16	301217	铜冠铜箔	75,936.19	0.04
17	301236	软通动力	75,576.56	0.04
18	301120	新特电气	63,226.65	0.03
19	301200	大族数控	61,171.44	0.03
20	301288	清研环境	60,343.49	0.03

注：买入股票成本、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。

7.4.2 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	300059	东方财富	13,356,480.60	7.19
2	300750	宁德时代	11,956,113.18	6.44
3	603799	华友钴业	10,828,068.00	5.83
4	002594	比亚迪	10,102,764.65	5.44
5	601899	紫金矿业	8,366,424.00	4.51
6	002434	万里扬	7,663,069.00	4.13
7	300207	欣旺达	6,775,224.00	3.65
8	000625	长安汽车	6,498,000.00	3.50
9	002176	江特电机	6,325,169.00	3.41
10	002192	融捷股份	6,220,173.00	3.35
11	688778	厦钨新能	5,768,389.23	3.11
12	300014	亿纬锂能	5,742,785.00	3.09
13	601688	华泰证券	5,686,919.00	3.06
14	603619	中曼石油	4,815,112.00	2.59
15	002466	天齐锂业	4,247,799.00	2.29
16	000631	顺发恒业	3,258,372.00	1.76
17	000661	长春高新	1,669,000.00	0.90
18	600995	文山电力	1,600,957.00	0.86
19	688075	安旭生物	477,435.42	0.26
20	688700	东威科技	220,944.11	0.12

注：买入股票成本、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。

7.4.3 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	79,088,135.06
卖出股票收入（成交）总额	124,705,739.76

注：买入股票成本、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 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末投资贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

立讯精密

2021 年 12 月 28 日，立讯精密收到深交所发出的《关于对立讯精密工业股份有限公司的监管函》（公司部监管函〔2021〕第 220 号），主要内容：2021 年 12 月 3 日，你公司披露《关于调整 2018 年股票期权激励计划行权数量及注销部分股票期权的公告》，其中应注销的股票期权总数量、激励对象可行权的股票期权数量等数据不准确，导致你公司在办理相关期权注销及登记业务时出现错误。你公司分别于 12 月 13 日、12 月 24 日进行了补充更正。你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则》第 1.4 条、第 2.1 条的规定。请你公司充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝上述问题的再次发生。

赣锋锂业

2022 年 6 月 8 日收到深圳证券交易所上市公司管理一部监管函（公司部监管函〔2022〕第 117 号），指出公司于 2022 年 2 月与上海聚锦归企业管理合伙企业（有限合伙）共同投资设立新余赣锋矿业有限公司（以下简称“赣锋矿业”），出资 10.85 亿元，持有赣锋矿业 62% 的股权，占 2020 年经审计净资产的 10.13% 事项未及时履行信息披露义务。拟以 14.70 亿元收购伊犁鸿大基业股权投资合伙企业（有限合伙）100% 财产份额未及时披露有关交付或者过户事宜。上述行为违反了《股票上市规则（2022 年修订）》第 6.1.2 条，以及《股票上市规则（2020 年修订）》第 7.6 条的规定。

赣锋锂业 2022 年 7 月 4 日公告于 2022 年 7 月 1 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《立案告知书》（编号：证监立案字 0252022001 号），因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会于 2022 年 1 月 24 日决定对公司立案。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未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	23,069.06

2	应收清算款	23,461,214.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,467.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,503,750.82

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
4,373	33,736.45	98,890.06	0.07%	147,430,597.09	99.93%

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	311.77	0.0002%

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（2020年5月22日）基金份额总额	2,625,571,541.49
本报告期期初基金份额总额	158,479,956.99
本报告期基金总申购份额	3,678,196.94
减：本报告期基金总赎回份额	14,628,666.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	147,529,487.15

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自2020年5月22日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比例		总量的比例	
华安证券	2	202,610,940.93	100.00%	188,689.65	100.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存监察稽核部备案。

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

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 1 月 4 日
2	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 1 月 13 日
3	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券股份有限公司	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证	2022 年 1 月 24 日

	公司费率优惠活动的公告	券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	
4	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、 上海证券报、中国证券 报、证券日报	2022 年 1 月 24 日
5	华商龙头优势混合型证券投资基 金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022 年 1 月 24 日
6	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加第一创业证券股份 有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 2 月 10 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加财通证券股份有限 公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 2 月 28 日
8	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加国联证券股份有限 公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 1 日
9	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加中银国际证券股份 有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 7 日
10	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加申万宏源证券有限 公司、申万宏源西部证券有限公 司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 8 日
11	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加国金证券股份有限 公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 21 日
12	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加北京创金启富基金 销售有限公司费率优惠活动的公 告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 22 日
13	华商基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加中信建投证券股份 有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站、证 券时报、上海证券报、 中国证券报、证券日报	2022 年 3 月 25 日
14	华商龙头优势混合型证券投资基 金 2021 年年度报告	公司网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022 年 3 月 31 日
15	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2022 年 3 月 31 日

16	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 14 日
17	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京雪球基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 14 日
18	华商基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司销售合作关系的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 21 日
19	华商龙头优势混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 22 日
20	华商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 22 日
21	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 25 日
22	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 4 月 28 日
23	华商基金管理有限公司关于深圳前海凯恩斯基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 5 月 5 日
24	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 5 月 6 日
25	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 5 月 6 日
26	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 5 月 6 日
27	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、	2022 年 5 月 9 日

	司、中信证券（山东）有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报	
28	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泰信财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2022 年 6 月 17 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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. 中国证监会批准华商龙头优势混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商龙头优势混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商龙头优势混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商龙头优势混合型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商龙头优势混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人住所。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日