

# 恒越品质生活混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：恒越基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	67
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>68</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	68
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>72</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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>73</b>
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	恒越品质生活混合型发起式证券投资基金
基金简称	恒越品质生活混合发起式
场内简称	-
基金主代码	013028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 31 日
基金管理人	恒越基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	292, 221, 158. 52 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于品质生活主题相关的上市公司，挖掘中国居民消费升级和生活服务业升级中带来的投资机会，通过深度基本面研究和个股精选策略，在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济环境、国家经济周期、财政货币政策、证券市场流动性等因素综合分析的基础上，结合市场上各大类资产的估值水平及市场情绪的比较分析，评估各类别资产的风险收益特征，适度调整基金资产在股票、债券及现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）品质生活主题上市公司范畴的界定</p> <p>随着中国经济结构转型、产业结构升级及科技进步，居民生活水平显著提高，生活品质和服务品质不断提升，消费理念越来越侧重品质化、智能化、绿色环保、多层次和个性化等，对于健康生活及文化娱乐的要求会逐步提高。</p> <p>“品质生活”主题涵盖能够为居民提供优质的产品、服务或解决方案，在经济生活、文化生活、社会生活、环境生活等各方面直接或间接提升人民生活品质的相关上市公司，具体到行业分类上，包括但不限于：纺织服装、食品饮料、房地产及服务、汽车及服务、家用电器、建筑装饰、公用事业、医药生物、电商物流、教育教培、金融服务、休闲娱乐、传媒、计算机、消</p>

费电子、通信服务、交通运输、轻工制造等相关行业。对于当前未被归入前述行业，但后续通过引入技术创新、变革运营模式、实施资产重组等途径实现业务转型，转型后提供的产品或服务隶属于上述行业，且未来有望成为主要收入或利润来源的公司，本基金也可将其纳入品质生活主题的范畴。

若未来由于技术进步或政策变化，导致本基金所界定的品质生活主题相关的行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后可以适时对品质生活主题的界定进行调整和完善。

## （2）个股投资策略

本基金将主要精选品质生活主题中的优质个股进行投资，以企业基本面研究为核心，结合实地调研，对上市公司进行全面深入的评估，重点从核心竞争力、成长性、持续盈利能力、公司治理结构和估值水平等方面进行分析，甄选具备核心竞争力且具有估值提升空间的优质上市公司进行投资，构建投资组合。

### 1) 核心竞争力分析

企业的核心竞争力是企业获得长期盈利增长的根本动力。本基金将主要考察企业提供的产品、服务或解决方案是否符合居民消费需求变化趋势，是否能够切实提升民众生活品质，是否在细分行业中具有领先地位和突出的品牌影响力，是否拥有难以被竞争对手模仿的竞争优势，如公司是否具有突出的研发创新能力，是否具有核心技术和创新能力（如专利、商标等知识产权），提供的产品（或服务）具有较高的技术壁垒，是否具有较强的议价能力、规模效益等优势，是否具有良好的销售网络、市场品牌或垄断资源等。

### 2) 成长性分析

本基金结合公司所处行业的发展前景及在行业中的相对竞争地位，分析公司的成长性，主要考察公司历史和未来预期的主营业务收入和利润的增长率及其稳定性等指标，挖掘具备持续成长能力的上市公司。

### 3) 持续盈利能力分析

本基金在考察公司盈利能力的同时，还要考察支撑公司保持盈利增长的因素是否具备可持续性。除了从财务角度分析公司的利润率、利润构成、资产收益率及其变化、现金流情况等，还要对公司未来盈利状况进行预测，综合考察其所处细分行业的发展前景、下游需求、市场地位和财务结构等方面。

### 4) 公司治理结构

主要考察公司治理结构是否完善，是否拥有良好的管理团队，是否具备清晰的公司发展战略，是否已建立起市场化的经营机制、企业的信息披露是否公开透明

	<p>等。</p> <p>5) 估值水平分析</p> <p>本基金将根据上市公司所处行业、业务模式以及公司发展所处的不同阶段等特征，综合利用市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、折现现金流法（DCF）等估值方法对公司的估值水平进行比较分析，筛选出估值与公司中长期业绩增速相匹配的股票。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将充分挖掘资本市场互联互通资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会，通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。</p> <p>本基金将遵循上述生活品质主题相关股票的投资策略，精选基本面良好、业绩向上弹性较大，且具有一定投资安全边际的港股通标的股票纳入投资组合。</p> <p>（4）本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在保证资产流动性的基础上，通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等投资策略，在控制各类风险的基础上，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对市场利率、资产支持证券发行条款、支持资产的构成和质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素的综合分析，在严格控制风险的基础上进行投资，以获得稳定收益。</p> <p>5、可转换债券、可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金主要通过结合其债性和股性兼具的特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的标的，以获取稳健的投资回报。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。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</p>
--	---



	理的估值水平，采用流动性好、交易活跃的合约品种，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，以达到降低投资组合整体风险的目的。 本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率*55%+中证香港100指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及香港市场的风险。

### 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	恒越基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙霞
	联系电话	021-80363958
	电子邮箱	susan.sun@hengyuefund.com
客户服务电话	400-921-7000	021-60637111
传真	021-80363989	021-60635778
注册地址	上海市浦东新区龙阳路 2277 号 2102 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区龙阳路 2277 号 21 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	201204	100033
法定代表人	黄小坚	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hengyuefund.com">http://www.hengyuefund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	恒越基金管理有限公司	上海市浦东新区龙阳路 2277 号永达国际大厦 21 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-97,311,081.27
本期利润	-83,753,071.25
加权平均基金份额本期利润	-0.2572
本期加权平均净值利润率	-41.75%
本期基金份额净值增长率	-28.66%
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	-129,682,714.53
期末可供分配基金份额利润	-0.4438
期末基金资产净值	173,597,884.98
期末基金份额净值	0.5941
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	-40.59%

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润，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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

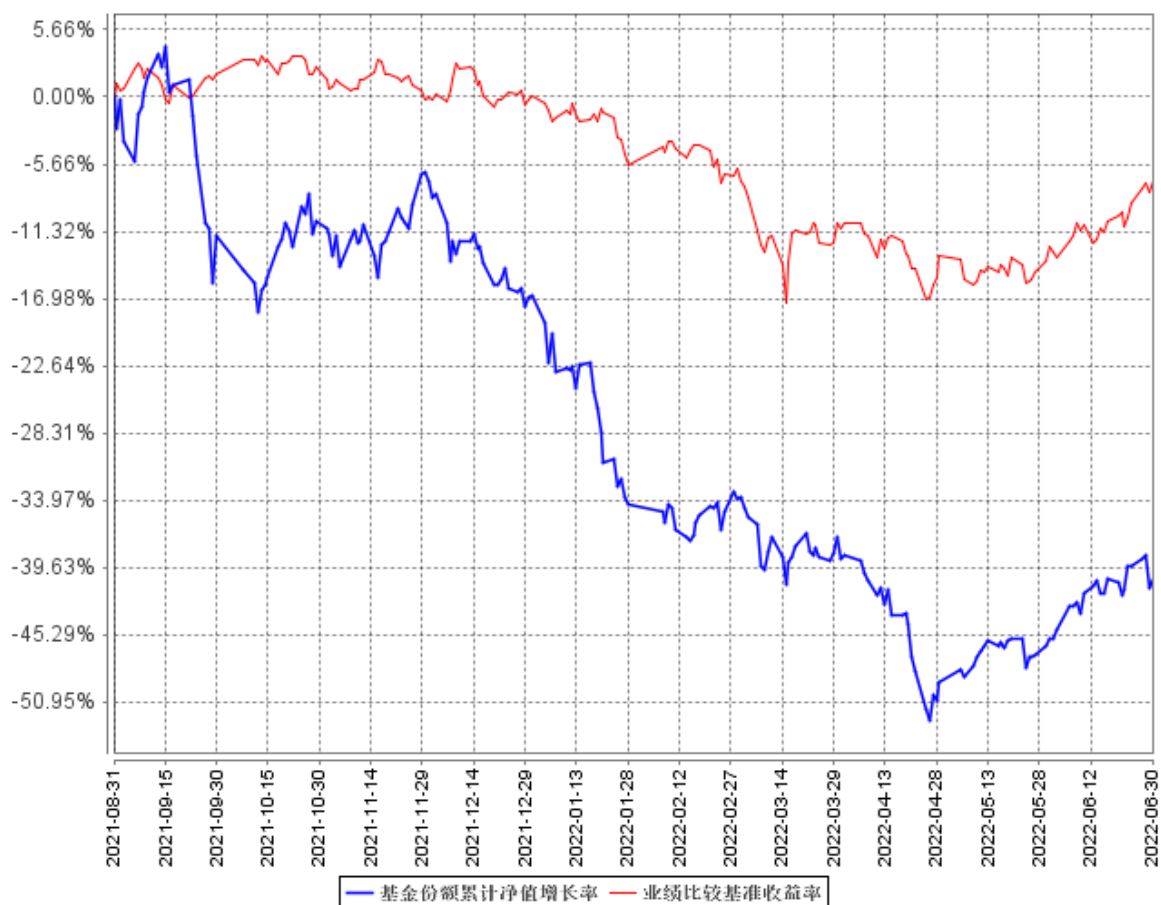
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.27%	1.88%	6.46%	0.95%	2.81%	0.93%
过去三个月	-2.78%	2.10%	4.58%	1.09%	-7.36%	1.01%
过去六个月	-28.66%	2.10%	-7.11%	1.19%	-21.55%	0.91%
自基金合同生效起至今	-40.59%	2.11%	-7.04%	1.01%	-33.55%	1.10%

注：本基金基金合同于 2021 年 8 月 31 日生效。

### 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：本基金基金合同于 2021 年 8 月 31 日生效，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年。根据本基金基金合同的规定，本基金建仓期为本基金合同生效之日（2021 年 8 月 31 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

恒越基金管理有限公司（以下简称“恒越基金”或“公司”）经中国证监会证监许可〔2017〕1627 号文批准，于 2017 年 9 月 14 日取得营业执照正式成立，并于 2017 年 10 月 9 日取得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。公司注册地址在上海市浦东新区龙阳路 2277 号 2102 室，注册资本 2 亿元人民币。

公司奉行正直、专注、合作、稳健的企业价值观，以帮助客户实现财务目标为使命，致力于成为客户值得信赖的长期合作伙伴、中国市场具影响力的投资管理专家。

恒越基金建立了完善有效的公司治理结构和激励约束机制。在治理层面，公司设股东会、董事会、2 名监事，其中设有代表公司员工行使股东权力及行使监督职责的职工董事和职工监事。结合公司推行的股权长效激励约束机制，可以更好地将公司、员工与基金持有人利益进行长期绑定。同时，基于监管法律法规及公司章程，借鉴国内外先进经验，公司制定有完善详尽的股东会、董事会及风险控制委员会议事规则。

通过提供多维度、人性化的客户服务，恒越基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共发行并管理 12 只公募基金。

#### 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		
叶佳	投资总监助理、固定收益部总监、本基金基金经理	2021 年 8 月 31 日	-	12	曾任银华基金管理有限公司固定收益部研究员、基金经理助理；申万宏源证券有限公司资产管理事业部，担任债券产品投资主办；东亚前海证券有限公司资产管理部副总经理，债券产品投资主办。

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从《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。

#### 4.1.3 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》和公司制定的公平交易相关制度，从授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人严格执行了异常交易监控与报告相关制度。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，在疫情扰动下，国内经济面临下行压力，整体呈现 V 型走势，流动性环境整体宽松，降准降息先后落地，银行间市场 DR007 二季度持续在政策利率下方运行，专项债前置发行、银行积极投放推升社融增速至 10.8%。

海外主要经济体进入货币紧缩周期，在地缘政治冲突长期化推升通胀压力的背景下，紧缩节奏和幅度也超出预期，推升各国国债收益率，引发全球风险资产动荡，其中标普跌幅超过 20%、纳指下跌 30%。随着高通胀和激进加息带来融资成本抬升，美欧经济已在明显放缓，美国 GDP 环比折年率连续两个季度负增长、6 月制造业 PMI 新订单跌至 50% 以下，欧元区制造业 PMI 一路下跌至 52.1%。

股票市场，1-4 月需求预期走弱、海外原料价格暴涨导致盈利预期恶化，叠加疫情前景不确

定性冲击风险偏好，市场出现非理性大幅下跌，截止到 4 月底估值已下跌至历史偏低水平，全 A 股风险溢价（ERP）上升至历史一倍标准差以上、与 2020 年 3 月相当。4 月底起，随着稳增长政策陆续落地、疫情冲击逐步消退，叠加流动性环境较一季度更为宽松，风险偏好和盈利预期逐步好转带动 A 股反弹，其中超跌的高景气成长赛道和政策受益的汽车行业涨幅最大。

操作上，本基金以优质的成长股积极参与 4 月底以来的市场上涨，行业上主要集中受益政策支持 and 需求释放的行业，主要以新能源汽车上下游产业链为主，以及部分供需矛盾紧张支撑价格的上游行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.5941 元；本报告期基金份额净值增长率为-28.66%，业绩比较基准收益率为-7.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济环比修复这一方向相对确定，但修复斜率在地产和出口的压制下可能较弱。流动性环境，预计是“货币边际收敛+信用维持宽松”的组合。货币端，伴随疫情冲击减弱，资金面维持超常规宽松的必要性下降，叠加 9 月起通胀阶段性压力开始显现，资金面可能回归常态化，资金利率重回围绕政策利率上下波动。但经济基本面未见明显企稳之前，货币政策预计维持银行间流动性合理充裕。信用端预计延续宽信用环境，社融增速可能在当前 10.8%的基础上会进一步上行，驱动力来自于前期专项债落地使用撬动配套银行贷款、地方专项债务限额空间的使用、企业融资需求的边际改善等。

海外预计仍将是通胀与经济衰退交织运行，美联储货币立场的边际变化取决于控通胀效果和经济衰退程度的权衡。基准情景下，若油价不进一步冲击年内新高、房租和薪资等黏性通胀的先行指标不进一步加剧，预计美国通胀读数将在三季度见顶、四季度开始趋势性回落。叠加四季度美国经济进入实质性衰退的预期较强，四季度或年底美联储货币政策态度存在边际好转的可能性，利好全球成长股风险偏好。但若通胀回落幅度不及预期，不排除美联储货币转向再度落后于市场曲线的可能性。此外，对中国而言，还要警惕美国实质性衰退对出口的影响，以及美国中期选举前的地缘政治风险。

展望下半年，A 股预计是震荡上行、结构性机会为主，板块驱动从二季度的估值及盈利双驱动转为盈利驱动为主，若四季度海外流动性预期回暖预计有阶段性的估值驱动行情。中报预计是表观盈利底，实际盈利底从历史规律来看可能要等到年底，但若下半年经济修复幅度超预期实际盈利底可能提前出现。行业上看好汽车、新能源、军工等有望维持高业绩增速的景气赛道，以及

下半年可能困境反转的疫后消费，关注若基建地产链超预期可能带来的顺周期制造业行情。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人按照相关法律规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由总经理负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面的业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

#### **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，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：恒越品质生活混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,741,125.89	17,778,092.90
结算备付金		3,996,867.42	0.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	157,874,253.88	275,086,509.70
其中：股票投资		157,874,253.88	274,608,109.70
基金投资		-	-
债券投资		-	478,400.00
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		96,053.25	-
应收股利		52,768.18	-
应收申购款		269,076.67	328,904.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,041.79
资产总计		174,030,145.29	293,195,549.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		-	-

应付赎回款		51,844.45	260,099.05
应付管理人报酬		210,021.24	401,350.24
应付托管费		28,002.85	53,513.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.10	2.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	142,388.67	110,601.62
负债合计		432,260.31	825,567.03
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	292,221,158.52	351,058,644.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-118,623,273.54	-58,688,662.43
净资产合计		173,597,884.98	292,369,982.31
负债和净资产总计		174,030,145.29	293,195,549.34

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日。

2、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5941 元，基金份额总额 292,221,158.52 份。

3、银行存款 11,741,125.89 元，包括了本基金存放于托管账户内的存款 2,517,098.79 元和基金结算机构的证券账户内的存款 9,224,027.10 元。

## 6.2 利润表

会计主体：恒越品质生活混合型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-81,962,132.66
1.利息收入		39,259.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	39,259.23
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-95,684,891.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-96,254,141.97
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.11	170,682.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-6,286.08
股利收益	6.4.7.15	404,853.62
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）	6.4.7.16	13,558,010.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	125,489.54
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,790,938.59</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,500,040.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	200,005.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		0.91
8. 其他费用	6.4.7.19	90,892.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-83,753,071.25</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-83,753,071.25</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-83,753,071.25</b>

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：恒越品质生活混合型发起式证券投资基金

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	351,058,644.74	-	-58,688,662.43	292,369,982.31

金净值)				
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)	351,058,644.74	-	-58,688,662.43	292,369,982.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-58,837,486.22	-	-59,934,611.11	-118,772,097.33
(一)、综合收益总额	-	-	-83,753,071.25	-83,753,071.25
(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)	-58,837,486.22	-	23,818,460.14	-35,019,026.08
其中：1.基金申购款	33,642,561.16	-	-11,961,698.85	21,680,862.31
2.基金赎回款	-92,480,047.38	-	35,780,158.99	-56,699,888.39
(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)	292,221,158.52	-	-118,623,273.54	173,597,884.98
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-	-

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

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：

                    黄小坚                    

基金管理人负责人

                    黄鹏                    

主管会计工作负责人

                    孙尧                    

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

恒越品质生活混合型发起式证券投资基金(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[2021]2122 号文《关于准予恒越品质生活混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由恒越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《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 167,520,327.38 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(2021)第 0838 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 31 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 167,543,483.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,155.87 份基金份额。本基金的基金管理人为恒越基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元,且持有认购份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年,期间份额不能赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板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允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票(含存托凭证)的比例为基金资产的 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%),投资于本基金界定的品质生活主题股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证消费服务领先指数收益率\*55%+中证香港 100 指数收益率\*20%+中债总指数(全价)收益率\*25%。

## 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》、《恒越品质生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注列示的中国证监会、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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策发生变更。

## 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。

(一) 新金融工具准则与原金融工具准则对比

#### 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业务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。

## 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，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。

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。

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。

### 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。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,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。

## (二) 金融工具分类和计量结果

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 年度中期财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

### 1. 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、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 17,778,092.90 元、0.00 元、2,041.79 元和 328,904.95 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、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 17,778,371.56 元、1,739.95 元、0.00 元和 328,906.41 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 275,086,509.70 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 275,086,531.42 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 260,099.05 元、401,350.24 元、53,513.38 元和 110,601.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 260,099.05 元、401,350.24 元、53,513.38 元和 110,601.62 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。

#### 2. 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/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,517,098.79
等于：本金	2,516,963.30
加：应计利息	135.49
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	9,224,027.10
等于：本金	9,223,200.69
加：应计利息	826.41
减：坏账准备	-
合计：	11,741,125.89

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

##### 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	150,310,042.19	-	157,874,253.88	7,564,211.69
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	150,310,042.19	-	157,874,253.88	7,564,211.69

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金不投资黄金衍生品。

### 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	2,955.97
应付赎回费	172.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	139,260.15
合计	142,388.67

#### 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	351,058,644.74	351,058,644.74
本期申购	33,642,561.16	33,642,561.16
本期赎回(以“-”号填列)	-92,480,047.38	-92,480,047.38
- 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	292,221,158.52	292,221,158.52

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 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	-56,233,787.91	-2,454,874.52	-58,688,662.43
本期利润	-97,311,081.27	13,558,010.02	-83,753,071.25
本期基金份额交易产生的变动数	23,862,154.65	-43,694.51	23,818,460.14
其中：基金申购款	-11,709,363.28	-252,335.57	-11,961,698.85
基金赎回款	35,571,517.93	208,641.06	35,780,158.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-129,682,714.53	11,059,440.99	-118,623,273.54

#### 6.4.7.9 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
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	29,803.39
结算备付金利息收入	5,602.04
其他	212.49
合计	39,259.23

注：1、其他存款利息收入为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款的利息收入。

2、其他项为基金申购款利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 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	2,534,940,151.47
减：卖出股票成本总额	2,624,400,430.61
减：交易费用	6,793,862.83
买卖股票差价收入	-96,254,141.97

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	170,682.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	170,682.98

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,283,271.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,102,770.09
减：应计利息总额	9,262.87
减：交易费用	555.65
买卖债券差价收入	170,682.98

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。



**6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无资产支持证券差价收入。

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.13 贵金属投资收益****6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金不投资贵金属。

**6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金不投资贵金属。

**6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金不投资贵金属。

**6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金不投资贵金属。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金不投资权证。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---

国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-6,286.08

#### 6.4.7.15 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	404,853.62
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	404,853.62

#### 6.4.7.16 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	13,558,010.02
——股票投资	13,558,010.02
——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	13,558,010.02

#### 6.4.7.17 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	97,150.88
转换费收入	28,338.66
合计	125,489.54

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

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 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	-
银行汇划费用	1,632.09
合计	90,892.24

#### 6.4.7.20 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不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。

##### 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
恒越基金管理有限公司（“恒越基金”）	基金管理人、注册登记机构销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金不投资权证。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

## 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	1,500,040.09	-
其中：支付销售机构的客户维护费	380,846.48	-

注：1、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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2、本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 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	200,005.35	-

注：1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

2、本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

### 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

#### 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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。

### 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

份额单位：份

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 8 月 31 日）持有的基金份额	10,002,500.25
报告期初持有的基金份额	43,310,133.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	27,650,000.00
报告期末持有的基金份额	15,660,133.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.3600%

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度同期可比数据。基金管理人投资本基金相关费用符合基金招募说明书和相关公告中规定的费率。

**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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	2,517,098.79	3,641.31	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

2、本基金基金合同生效日为2021年8月31日，无上年度同期可比数据。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内，本基金在承销期内未参与关联方承销证券。本基金基金合同生效日为2021年8月31日，无上年度同期对比数据。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。本基金基金合同生效日为2021年8月31日，无上年度同期对比数据。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

**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
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内	新股未上市	38.46	38.46	1,525	58,651.50	58,651.50	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内	新股未上市	33.65	33.65	1,723	57,978.95	57,978.95	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内	新股未上市	41.52	41.52	1,063	44,135.76	44,135.76	-

301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	170	6,538.20	6,538.20	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	192	6,460.80	6,460.80	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	119	4,940.88	4,940.88	-
688238	和元生物	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	13.23	25.32	5,502	72,791.46	139,310.64	-
688349	三一重能	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	29.80	36.94	1,959	58,378.20	72,365.46	-
688175	高凌信息	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	51.68	32.23	1,666	86,098.88	53,695.18	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	2,108	8,010.40	13,470.12	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	177	12,866.13	12,662.58	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	322	12,654.60	12,213.46	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	206	9,640.80	11,214.64	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	743	12,831.61	11,018.69	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	292	5,819.56	9,162.96	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-

301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	814	6,552.70	8,205.12	-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	72.88	31.38	259	12,608.24	8,127.42	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	229	6,526.50	7,985.23	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	472	7,254.64	7,547.28	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	130	7,394.40	7,334.60	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	150	7,855.50	7,174.50	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	127	6,607.81	7,165.34	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	266	9,903.18	6,753.74	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	414	9,607.56	6,681.96	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	202	6,587.50	6,468.04	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	191	10,613.87	5,735.73	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	184	7,337.92	5,720.56	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	195	6,626.10	5,647.20	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	187	6,672.16	5,580.08	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	211	6,747.78	5,540.86	-
301258	富士	2022年	6个	新股流	48.30	41.68	125	6,037.50	5,210.00	-



	莱	3月21日	月	通受限						
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	165	6,641.25	5,047.35	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	50	4,871.44	4,391.00	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	188	5,794.16	4,034.48	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	103	6,600.24	3,864.56	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	92	5,805.20	3,666.20	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市后的约定期限内不得转让；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。

#### 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因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金是一只进行主动投资的主题混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人建设银行开立的托管户内，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构东方财富证券的证券账户内，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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	478,400.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	478,400.00

注：1、上年度末按长期信用评级为“AAA 以下”的债券投资明细为：交易所 AA 级可转债 86,000.00 元，交易所 A+级可转债 392,400.00 元；

2、本表信用评级指第三方评级机构对其出具的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 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。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风控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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，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、债券投资和买入返售金融资产等。

#### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,740,163.99	-	-	-	-	961.90	11,741,125.89
结算备付金	3,995,881.69	-	-	-	-	985.73	3,996,867.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-157,874,253.88	157,874,253.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,053.25	96,053.25
应收股利	-	-	-	-	-	52,768.18	52,768.18
应收申购款	2,995.51	-	-	-	-	266,081.16	269,076.67
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,739,041.19	-	-	-	-	-158,291,104.10	174,030,145.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,844.45	51,844.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,021.24	210,021.24
应付托管费	-	-	-	-	-	28,002.85	28,002.85
应交税费	-	-	-	-	-	3.10	3.10
其他负债	-	-	-	-	-	142,388.67	142,388.67
负债总计	-	-	-	-	-	432,260.31	432,260.31
利率敏感度缺口	15,739,041.19	-	-	-	-	-157,858,843.79	173,597,884.98
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,778,092.90	-	-	-	-	-	17,778,092.90
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	478,400.00	274,608,109.70	275,086,509.70
应收利息	-	-	-	-	-	2,041.79	2,041.79
应收申购款	10,184.72	-	-	-	-	318,720.23	328,904.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,788,277.62	-	-	-	478,400.00	274,928,871.72	293,195,549.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	260,099.05	260,099.05

应付管理人报酬	-	-	-	-	401,350.24	401,350.24
应付托管费	-	-	-	-	53,513.38	53,513.38
应交税费	-	-	-	-	2.74	2.74
其他负债	-	-	-	-	110,601.62	110,601.62
负债总计	-	-	-	-	825,567.03	825,567.03
利率敏感度缺口	17,788,277.62	-	-	-	478,400.00	274,103,304.69
						292,369,982.31

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

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券（不含可转债）资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金管理人为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产（如有）的利息收益和卖出回购金融资产（如有）的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
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）
	利率下降 25 个基点	0.00	0.00
	利率上升 25 个基点	0.00	0.00

注：本报告期末，本基金未持有债券资产；上年度末，除可转债之外，本基金未持有其他债券资产。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
股票投资	-	14,420,295.02	-	14,420,295.02
资产合计	-	14,420,295.02	-	14,420,295.02
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	14,420,295.02	-	14,420,295.02
项目	上年度末			
	2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	0.00	-	0.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	0.00	-	0.00

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	港币升值 5%	721,014.75	0.00
	港币贬值 5%	-721,014.75	0.00

#### 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。基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%），投资于本基金界定的品质生活主题股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金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 5% 的现金或者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。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	157,874,253.88	90.94	274,608,109.70	93.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	478,400.00	0.16
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	157,874,253.88	90.94	275,086,509.70	94.08

注：本表债券投资仅包含可转债。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为基准指数变动时，股票资产（含可转债，如有）相应的理论变动值。
	假定基准指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。
	Beta 系数是根据报告日及之前 100 个交易日组合收益率与其对应指数收益率回归

	加权得出。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
	组合运作不满 100 个交易日不予计算。		
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）
	业绩比较基准上升 5%	7,908,845.19	-
	业绩比较基准下降 5%	-7,908,845.19	-

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，至上年度末，基金运作不满 100 个交易日。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法分析、管理市场风险。

#### 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	157,371,636.81	273,485,305.80
第二层次	0.00	902,293.49
第三层次	502,617.07	698,910.41
合计	157,874,253.88	275,086,509.70

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

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

#### **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**

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	157,874,253.88	90.72
	其中：股票	157,874,253.88	90.72
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	15,737,993.31	9.04
8	其他各项资产	417,898.10	0.24
9	合计	174,030,145.29	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 14,420,295.02 元，占资产净值比例为 8.31%。

2、本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

### 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	12,237,289.82	7.05
C	制造业	121,712,479.99	70.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,321,600.00	0.76
E	建筑业	166,286.00	0.10
F	批发和零售业	6,121,234.26	3.53
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	149,974.76	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	5,720.56	0.00
M	科学研究和技术服务业	177,415.72	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	6,681.96	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	70,907.79	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,484,368.00	0.86
	合计	143,453,958.86	82.64

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	4,863,978.64	2.80
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	2,919,084.17	1.68
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	6,637,232.21	3.82
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	14,420,295.02	8.31

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	002192	融捷股份	56,300	8,653,310.00	4.98
2	600519	贵州茅台	3,300	6,748,500.00	3.89
3	01024	快手-W	88,800	6,637,232.21	3.82
4	600196	复星医药	80,294	3,540,162.46	2.04
4	02196	复星医药	117,500	2,919,084.17	1.68
5	300930	屹通新材	179,200	6,436,864.00	3.71
6	002466	天齐锂业	50,400	6,289,920.00	3.62
7	301263	泰恩康	170,292	5,918,362.96	3.41
8	002312	川发龙蟒	308,500	5,324,710.00	3.07
9	603917	合力科技	211,200	5,026,560.00	2.90

10	002753	永东股份	482,500	4,993,875.00	2.88
11	300595	欧普康视	84,700	4,843,993.00	2.79
12	600884	杉杉股份	144,500	4,294,540.00	2.47
13	002655	共达电声	247,100	3,652,138.00	2.10
14	002182	云海金属	139,100	3,488,628.00	2.01
15	300681	英搏尔	57,350	3,313,109.50	1.91
16	300428	立中集团	85,900	2,838,995.00	1.64
17	300969	恒帅股份	33,200	2,810,712.00	1.62
18	09869	海伦司	176,000	2,724,293.26	1.57
19	002824	和胜股份	47,682	2,622,033.18	1.51
20	002011	盾安环境	207,400	2,548,946.00	1.47
21	300745	欣锐科技	50,500	2,518,940.00	1.45
22	600876	洛阳玻璃	92,300	2,309,346.00	1.33
23	000762	西藏矿业	39,100	2,186,863.00	1.26
24	09922	九毛九	120,000	2,139,685.38	1.23
25	000970	中科三环	113,000	2,122,140.00	1.22
26	600745	闻泰科技	24,700	2,102,217.00	1.21
27	688345	博力威	30,657	1,884,485.79	1.09
28	002036	联创电子	112,800	1,732,608.00	1.00
29	002460	赣锋锂业	11,600	1,724,920.00	0.99
30	002056	横店东磁	64,400	1,714,328.00	0.99
31	002284	亚太股份	175,900	1,616,521.00	0.93
32	300351	永贵电器	91,500	1,528,050.00	0.88
33	002108	沧州明珠	243,600	1,515,192.00	0.87
34	000833	粤桂股份	164,200	1,484,368.00	0.86
35	300332	天壕环境	118,000	1,321,600.00	0.76
36	688071	华依科技	28,556	1,320,429.44	0.76
37	000887	中鼎股份	70,992	1,294,894.08	0.75
38	600210	紫江企业	201,250	1,285,987.50	0.74
39	600577	精达股份	228,300	1,267,065.00	0.73
40	002782	可立克	73,600	1,254,144.00	0.72
41	603799	华友钴业	13,100	1,252,622.00	0.72
42	300707	威唐工业	73,900	1,249,649.00	0.72
43	002487	大金重工	28,500	1,189,305.00	0.69
44	000625	长安汽车	62,000	1,073,840.00	0.62
45	002922	伊戈尔	57,600	1,037,376.00	0.60
46	603612	索通发展	27,900	1,028,115.00	0.59
47	603985	恒润股份	35,800	1,007,412.00	0.58
48	002562	兄弟科技	141,800	918,864.00	0.53

49	002129	TCL 中环	15,400	906,906.00	0.52
50	603997	继峰股份	79,400	863,872.00	0.50
51	600499	科达制造	40,800	842,112.00	0.49
52	603688	石英股份	6,300	835,443.00	0.48
53	603920	世运电路	47,800	826,940.00	0.48
54	002885	京泉华	25,800	781,224.00	0.45
55	600481	双良节能	43,500	732,975.00	0.42
56	300458	全志科技	23,100	695,079.00	0.40
57	000049	德赛电池	13,800	622,380.00	0.36
58	600777	新潮能源	230,500	615,435.00	0.35
59	002384	东山精密	26,100	598,473.00	0.34
60	300320	海达股份	36,100	541,861.00	0.31
61	600873	梅花生物	47,909	540,413.52	0.31
62	688017	绿的谐波	4,529	538,951.00	0.31
63	001208	华菱线缆	41,500	515,430.00	0.30
64	688077	大地熊	6,047	509,822.57	0.29
65	605128	上海沿浦	13,100	488,237.00	0.28
66	300953	震裕科技	3,500	479,465.00	0.28
67	688150	莱特光电	18,214	405,079.36	0.23
68	600219	南山铝业	95,400	352,026.00	0.20
69	000983	山西焦煤	25,400	340,106.00	0.20
70	300828	锐新科技	20,200	339,360.00	0.20
71	300093	金刚玻璃	6,200	339,202.00	0.20
72	002101	广东鸿图	14,500	330,600.00	0.19
73	600508	上海能源	18,200	329,238.00	0.19
74	002623	亚玛顿	5,500	220,330.00	0.13
75	600096	云天化	6,800	214,064.00	0.12
76	601012	隆基绿能	2,897	193,027.11	0.11
77	688326	经纬恒润	1,295	190,442.70	0.11
78	601127	小康股份	2,300	186,507.00	0.11
79	688167	炬光科技	1,196	177,905.00	0.10
80	600552	凯盛科技	15,500	175,615.00	0.10
81	600546	山煤国际	9,000	175,140.00	0.10
82	688533	上声电子	2,437	174,099.28	0.10
83	300432	富临精工	7,800	171,600.00	0.10
84	601717	郑煤机	11,700	168,597.00	0.10
85	002709	天赐材料	2,700	167,562.00	0.10
86	300712	永福股份	2,900	166,286.00	0.10
87	603088	宁波精达	22,400	163,744.00	0.09

88	688082	盛美上海	1,669	158,171.13	0.09
89	300360	炬华科技	11,500	153,410.00	0.09
90	603308	应流股份	9,300	151,404.00	0.09
91	688123	聚辰股份	1,350	143,802.00	0.08
92	688238	和元生物	5,502	139,310.64	0.08
93	600395	盘江股份	12,800	112,256.00	0.06
94	688005	容百科技	799	103,422.56	0.06
95	002270	华明装备	11,950	99,782.50	0.06
96	300035	中科电气	3,400	95,030.00	0.05
97	688049	炬芯科技	2,173	82,704.38	0.05
98	688072	拓荆科技	516	80,031.60	0.05
99	688349	三一重能	1,959	72,365.46	0.04
100	301139	元道通信	1,695	65,189.70	0.04
101	301239	普瑞眼科	1,915	64,439.75	0.04
102	688236	春立医疗	2,843	56,291.40	0.03
103	688175	高凌信息	1,666	53,695.18	0.03
104	301233	盛帮股份	1,182	49,076.64	0.03
105	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
106	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.02
107	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.01
108	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
109	688173	希荻微	468	15,701.40	0.01
110	000990	诚志股份	1,400	15,330.00	0.01
111	301215	中汽股份	2,108	13,470.12	0.01
112	301201	诚达药业	177	12,662.58	0.01
113	301091	深城交	455	12,421.50	0.01
114	301235	华康医疗	322	12,213.46	0.01
115	000792	盐湖股份	397	11,894.12	0.01
116	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
117	301211	亨迪药业	532	11,533.76	0.01
118	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.01
119	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
120	301177	迪阿股份	152	11,278.40	0.01
121	301117	佳缘科技	206	11,214.64	0.01
122	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.01
123	688225	亚信安全	497	11,142.74	0.01
124	301217	铜冠铜箔	743	11,018.69	0.01
125	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.01
126	301221	光庭信息	164	10,632.12	0.01



127	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.01
128	301199	迈赫股份	292	9,355.68	0.01
129	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.01
130	301130	西点药业	237	8,934.90	0.01
131	301138	华研精机	285	8,763.75	0.01
132	301256	华融化学	814	8,205.12	0.00
133	688115	思林杰	203	8,168.72	0.00
134	301236	软通动力	259	8,127.42	0.00
135	301100	风光股份	374	8,070.92	0.00
136	301190	善水科技	338	8,020.74	0.00
137	301268	铭利达	229	7,985.23	0.00
138	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
139	301193	家联科技	281	7,629.15	0.00
140	000422	湖北宜化	373	7,575.63	0.00
141	301137	哈焊华通	472	7,547.28	0.00
142	301207	华兰疫苗	130	7,334.60	0.00
143	301097	天益医疗	150	7,174.50	0.00
144	301302	华如科技	127	7,165.34	0.00
145	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
146	301123	奕东电子	266	6,753.74	0.00
147	301109	军信股份	414	6,681.96	0.00
148	301103	何氏眼科	202	6,468.04	0.00
149	301179	泽宇智能	158	6,447.98	0.00
150	300834	星辉环材	191	5,735.73	0.00
151	301102	兆讯传媒	184	5,720.56	0.00
152	301222	浙江恒威	195	5,647.20	0.00
153	301216	万凯新材	187	5,580.08	0.00
154	301135	瑞德智能	211	5,540.86	0.00
155	301189	奥尼电子	165	5,496.15	0.00
156	301258	富士莱	125	5,210.00	0.00
157	301088	戎美股份	274	5,112.84	0.00
158	301108	洁雅股份	129	5,104.53	0.00
159	301181	标榜股份	165	5,047.35	0.00
160	301219	腾远钴业	50	4,391.00	0.00
161	300813	泰林生物	100	4,069.00	0.00
162	301151	冠龙节能	188	4,034.48	0.00
163	301196	唯科科技	103	3,864.56	0.00
164	301110	青木股份	92	3,666.20	0.00
165	603505	金石资源	2	81.82	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	002466	天齐锂业	40,081,071.95	13.71
2	000792	盐湖股份	39,094,879.00	13.37
3	002603	以岭药业	37,495,107.60	12.82
4	600499	科达制造	32,950,631.78	11.27
5	002176	江特电机	32,442,749.12	11.10
6	002192	融捷股份	31,570,250.70	10.80
7	002460	赣锋锂业	30,584,967.00	10.46
8	01024	快手-W	27,430,624.45	9.38
9	002432	九安医疗	26,345,546.94	9.01
10	002562	兄弟科技	26,146,640.37	8.94
11	601456	国联证券	22,521,436.00	7.70
12	000762	西藏矿业	22,413,613.00	7.67
13	600129	太极集团	22,401,175.00	7.66
14	600188	兖矿能源	20,982,289.13	7.18
15	688606	奥泰生物	20,092,895.09	6.87
16	688298	东方生物	19,967,435.05	6.83
17	688180	君实生物	19,776,902.27	6.76
18	002738	中矿资源	19,446,111.20	6.65
19	600566	济川药业	19,116,435.80	6.54
20	600519	贵州茅台	18,981,916.10	6.49
21	300035	中科电气	18,388,993.59	6.29
22	601168	西部矿业	18,183,134.48	6.22
23	600141	兴发集团	18,124,102.00	6.20
24	002707	众信旅游	17,991,002.00	6.15
25	000983	山西焦煤	17,853,626.54	6.11
26	600706	曲江文旅	17,743,690.80	6.07
27	601666	平煤股份	17,477,963.98	5.98
28	300428	立中集团	17,080,676.13	5.84
29	002497	雅化集团	16,806,881.00	5.75
30	600096	云天化	16,275,638.11	5.57

31	002245	蔚蓝锂芯	16,143,171.89	5.52
32	000681	视觉中国	15,728,512.00	5.38
33	600976	健民集团	15,580,859.25	5.33
34	600285	羚锐制药	15,364,871.96	5.26
35	600546	山煤国际	15,196,016.00	5.20
36	09922	九毛九	14,889,881.34	5.09
37	600123	兰花科创	14,596,195.50	4.99
38	605168	三人行	14,098,103.00	4.82
39	002605	姚记科技	13,989,871.00	4.78
40	600986	浙文互联	13,970,924.98	4.78
41	002945	华林证券	13,444,859.00	4.60
42	688075	安旭生物	13,017,561.65	4.45
43	600395	盘江股份	12,959,909.00	4.43
44	688068	热景生物	12,943,263.35	4.43
45	002895	川恒股份	12,870,451.63	4.40
46	688658	悦康药业	12,708,973.56	4.35
47	06618	京东健康	12,679,054.99	4.34
48	688127	蓝特光学	12,641,453.78	4.32
49	603108	润达医疗	12,480,001.00	4.27
50	600596	新安股份	12,479,495.60	4.27
51	601088	中国神华	12,446,690.00	4.26
52	002873	新天药业	12,316,948.40	4.21
53	688223	晶科能源	12,200,389.69	4.17
54	605117	德业股份	12,126,230.63	4.15
55	600358	国旅联合	12,036,174.00	4.12
56	601686	友发集团	11,983,461.00	4.10
57	688599	天合光能	11,819,068.22	4.04
58	603520	司太立	11,690,701.00	4.00
59	300750	宁德时代	11,442,455.00	3.91
60	002314	南山控股	11,260,109.42	3.85
61	600196	复星医药	11,185,468.00	3.83
62	600711	盛屯矿业	11,172,649.00	3.82
63	300636	同和药业	11,012,365.26	3.77
64	300497	富祥药业	10,986,819.00	3.76
65	002756	永兴材料	10,949,694.50	3.75
66	300969	恒帅股份	10,850,865.00	3.71

67	002545	东方铁塔	10,767,867.00	3.68
68	600422	昆药集团	10,632,273.00	3.64
69	000422	湖北宜化	10,574,588.60	3.62
70	002056	横店东磁	10,533,022.00	3.60
71	301235	华康医疗	10,400,302.43	3.56
72	002326	永太科技	10,389,403.00	3.55
73	688005	容百科技	9,799,092.19	3.35
74	002459	晶澳科技	9,732,306.00	3.33
75	002594	比亚迪	9,712,924.80	3.32
76	002885	京泉华	9,710,159.00	3.32
77	603297	永新光学	9,615,121.00	3.29
78	300595	欧普康视	9,415,339.60	3.22
79	600062	华润双鹤	9,252,643.91	3.16
80	002824	和胜股份	9,157,938.30	3.13
81	002487	大金重工	9,149,670.00	3.13
82	002865	钧达股份	9,060,614.00	3.10
83	000796	ST 凯撒	9,030,125.00	3.09
84	300393	中来股份	8,989,658.00	3.07
85	002644	佛慈制药	8,982,407.10	3.07
86	688733	壹石通	8,946,279.03	3.06
87	000893	亚钾国际	8,799,536.00	3.01
88	300745	欣锐科技	8,742,517.00	2.99
89	601001	晋控煤业	8,605,870.00	2.94
90	603985	恒润股份	8,579,807.90	2.93
91	002463	沪电股份	8,358,914.50	2.86
92	002753	永东股份	8,345,381.99	2.85
93	002942	新农股份	8,343,189.00	2.85
94	000002	万 科 A	8,340,207.00	2.85
95	000408	藏格矿业	8,331,592.00	2.85
96	603906	龙蟠科技	8,227,932.79	2.81
97	300320	海达股份	8,110,757.00	2.77
98	02607	上海医药	8,071,864.13	2.76
99	002475	立讯精密	7,702,322.00	2.63
100	600256	广汇能源	7,693,278.00	2.63
101	601888	中国中免	7,644,378.40	2.61
102	000739	普洛药业	7,608,512.00	2.60

103	300438	鹏辉能源	7,565,756.00	2.59
104	600809	山西汾酒	7,518,008.00	2.57
105	603538	美诺华	7,220,137.00	2.47
106	688077	大地熊	7,194,028.80	2.46
107	002059	云南旅游	7,179,047.00	2.46
108	000933	神火股份	7,096,421.00	2.43
109	600873	梅花生物	7,065,450.02	2.42
110	000776	广发证券	7,032,938.00	2.41
111	002850	科达利	6,973,867.00	2.39
112	300026	红日药业	6,966,725.00	2.38
113	301073	君亭酒店	6,896,747.76	2.36
114	002312	川发龙蟒	6,863,123.00	2.35
115	600367	红星发展	6,860,293.00	2.35
116	600587	新华医疗	6,786,007.00	2.32
117	300059	东方财富	6,762,512.00	2.31
118	603938	三孚股份	6,701,448.54	2.29
119	002182	云海金属	6,676,420.80	2.28
120	603589	口子窖	6,665,359.67	2.28
121	300501	海顺新材	6,648,386.19	2.27
122	603799	华友钴业	6,638,676.32	2.27
123	000830	鲁西化工	6,446,761.00	2.21
124	000402	金融街	6,405,075.00	2.19
125	600733	北汽蓝谷	6,403,696.00	2.19
126	300930	屹通新材	6,286,963.00	2.15
127	603825	华扬联众	6,222,667.00	2.13
128	002655	共达电声	6,215,790.00	2.13
129	000049	德赛电池	6,100,733.00	2.09
130	603035	常熟汽饰	6,094,036.44	2.08
131	300505	川金诺	6,083,885.55	2.08
132	601607	上海医药	6,071,933.00	2.08
133	603919	金徽酒	5,931,991.70	2.03
134	000568	泸州老窖	5,903,250.00	2.02
135	300073	当升科技	5,899,919.00	2.02

## 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	000792	盐湖股份	54,879,819.70	18.77
2	002603	以岭药业	40,301,756.06	13.78
3	002466	天齐锂业	38,979,999.04	13.33
4	600499	科达制造	34,094,479.00	11.66
5	002176	江特电机	33,916,354.70	11.60
6	002460	赣锋锂业	28,962,031.61	9.91
7	002432	九安医疗	26,756,387.00	9.15
8	002562	兄弟科技	25,240,127.90	8.63
9	600519	贵州茅台	24,482,076.02	8.37
10	002192	融捷股份	23,631,019.40	8.08
11	01024	快手-W	23,115,067.09	7.91
12	601456	国联证券	22,177,578.00	7.59
13	002945	华林证券	21,610,326.00	7.39
14	600188	兖矿能源	21,464,744.84	7.34
15	000762	西藏矿业	19,658,570.00	6.72
16	002738	中矿资源	19,584,409.20	6.70
17	300428	立中集团	19,224,679.00	6.58
18	600129	太极集团	19,059,450.00	6.52
19	601666	平煤股份	18,743,513.23	6.41
20	002497	雅化集团	18,500,456.00	6.33
21	002245	蔚蓝锂芯	18,473,414.40	6.32
22	600706	曲江文旅	18,449,884.60	6.31
23	688180	君实生物	18,382,997.10	6.29
24	688298	东方生物	18,196,122.75	6.22
25	688606	奥泰生物	17,669,373.36	6.04
26	000568	泸州老窖	17,616,991.00	6.03
27	000983	山西焦煤	17,329,450.62	5.93
28	600141	兴发集团	17,146,392.14	5.86
29	600566	济川药业	17,017,053.70	5.82
30	300035	中科电气	16,767,994.00	5.74
31	601168	西部矿业	16,755,898.20	5.73
32	600096	云天化	16,283,605.00	5.57
33	600546	山煤国际	15,363,578.00	5.25

34	002707	众信旅游	15,147,503.00	5.18
35	600123	兰花科创	15,006,844.02	5.13
36	002605	姚记科技	14,773,933.00	5.05
37	600285	羚锐制药	14,705,055.00	5.03
38	688075	安旭生物	14,576,524.36	4.99
39	300636	同和药业	13,492,027.00	4.61
40	002885	京泉华	13,296,984.50	4.55
41	605168	三人行	13,279,040.50	4.54
42	688068	热景生物	13,159,152.28	4.50
43	600976	健民集团	13,137,683.00	4.49
44	000681	视觉中国	13,132,244.00	4.49
45	600395	盘江股份	13,020,799.00	4.45
46	06618	京东健康	12,982,463.78	4.44
47	600986	浙文互联	12,966,079.40	4.43
48	002895	川恒股份	12,964,820.00	4.43
49	002475	立讯精密	12,719,004.44	4.35
50	600596	新安股份	12,659,400.36	4.33
51	601088	中国神华	12,576,403.24	4.30
52	688223	晶科能源	12,288,892.51	4.20
53	09922	九毛九	12,193,453.76	4.17
54	688658	悦康药业	12,161,254.73	4.16
55	605117	德业股份	12,068,830.65	4.13
56	600358	国旅联合	11,604,266.00	3.97
57	600559	老白干酒	11,457,845.70	3.92
58	688599	天合光能	11,378,567.26	3.89
59	600062	华润双鹤	11,350,123.80	3.88
60	300750	宁德时代	11,311,589.00	3.87
61	000776	广发证券	11,288,932.10	3.86
62	601686	友发集团	11,222,313.65	3.84
63	688127	蓝特光学	11,185,851.93	3.83
64	002545	东方铁塔	11,012,630.94	3.77
65	002756	永兴材料	10,891,200.00	3.73
66	603108	润达医疗	10,864,361.71	3.72
67	002873	新天药业	10,835,166.42	3.71
68	002326	永太科技	10,807,532.80	3.70
69	600711	盛屯矿业	10,759,456.21	3.68
70	002594	比亚迪	10,324,847.75	3.53
71	603297	永新光学	10,122,289.20	3.46

72	000422	湖北宜化	10,002,260.00	3.42
73	600422	昆药集团	9,970,754.00	3.41
74	688005	容百科技	9,860,525.40	3.37
75	002314	南山控股	9,856,666.00	3.37
76	603198	迎驾贡酒	9,724,193.32	3.33
77	300497	富祥药业	9,692,501.00	3.32
78	002459	晶澳科技	9,658,063.00	3.30
79	002463	沪电股份	9,500,186.64	3.25
80	688733	壹石通	9,422,009.45	3.22
81	300059	东方财富	9,214,495.00	3.15
82	601001	晋控煤业	9,152,244.00	3.13
83	603520	司太立	9,066,029.04	3.10
84	002056	横店东磁	8,834,130.00	3.02
85	002865	钧达股份	8,824,742.00	3.02
86	000893	亚钾国际	8,726,253.00	2.98
87	603589	口子窖	8,697,227.26	2.97
88	600367	红星发展	8,695,731.53	2.97
89	301235	华康医疗	8,664,022.76	2.96
90	300393	中来股份	8,506,347.00	2.91
91	600809	山西汾酒	8,415,808.00	2.88
92	000795	英洛华	8,385,353.00	2.87
93	000408	藏格矿业	8,362,123.94	2.86
94	002487	大金重工	8,356,765.00	2.86
95	002850	科达利	8,296,629.00	2.84
96	603906	龙蟠科技	8,280,595.22	2.83
97	300969	恒帅股份	8,271,046.00	2.83
98	603985	恒润股份	8,149,735.10	2.79
99	300320	海达股份	8,079,710.98	2.76
100	002824	和胜股份	8,069,390.10	2.76
101	300813	泰林生物	8,034,507.20	2.75
102	002942	新农股份	7,936,698.00	2.71
103	002920	德赛西威	7,898,842.00	2.70
104	301073	君亭酒店	7,887,700.72	2.70
105	000002	万科A	7,845,274.00	2.68
106	688367	工大高科	7,684,110.28	2.63
107	002644	佛慈制药	7,668,747.13	2.62
108	600196	复星医药	7,599,999.80	2.60
109	300786	国林科技	7,563,034.80	2.59



110	600256	广汇能源	7,544,224.00	2.58
111	02607	上海医药	7,406,209.02	2.53
112	601888	中国中免	7,360,588.00	2.52
113	300026	红日药业	7,268,214.00	2.49
114	000933	神火股份	7,230,065.00	2.47
115	603938	三孚股份	7,167,496.72	2.45
116	300438	鹏辉能源	7,125,110.00	2.44
117	002017	东信和平	6,977,717.00	2.39
118	603538	美诺华	6,905,506.00	2.36
119	603920	世运电路	6,884,891.00	2.35
120	688077	大地熊	6,843,473.27	2.34
121	000739	普洛药业	6,779,477.00	2.32
122	603035	常熟汽饰	6,768,214.00	2.31
123	600995	文山电力	6,762,881.40	2.31
124	300745	欣锐科技	6,734,918.00	2.30
125	300088	长信科技	6,717,106.00	2.30
126	600733	北汽蓝谷	6,521,266.00	2.23
127	002059	云南旅游	6,496,413.00	2.22
128	600873	梅花生物	6,412,068.00	2.19
129	000830	鲁西化工	6,323,643.00	2.16
130	603825	华扬联众	6,260,874.00	2.14
131	300316	晶盛机电	6,185,566.00	2.12
132	601607	上海医药	6,149,121.90	2.10
133	000402	金融街	6,148,896.00	2.10
134	300505	川金诺	6,093,535.95	2.08
135	603897	长城科技	5,940,021.10	2.03
136	603919	金徽酒	5,926,295.00	2.03
137	300073	当升科技	5,911,917.00	2.02
138	301030	仕净科技	5,908,181.32	2.02
139	600587	新华医疗	5,870,002.00	2.01

### 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	2,494,108,564.77
卖出股票收入（成交）总额	2,534,940,151.47

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

## 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。

## 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

本基金不投资贵金属。

## 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

本基金不投资权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。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，采用流动性好、交易活跃的合约品种，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，以达到降低投资组合整体风险的目的。

本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。

## 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

本基金不投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金不投资国债期货。

## 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

根据公开市场信息，本基金投资前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	96,053.25
3	应收股利	52,768.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	269,076.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,898.10

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301263	泰恩康	9,162.96	0.01	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,442	53,697.38	64,992,496.68	22.24%	227,228,661.84	77.76%

### 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	3,620,823.09	1.2391%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	15,660,133.00	5.36	10,002,500.25	3.42	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,660,133.00	5.36	10,002,500.25	3.42	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年8月31日）基金份额总额	167,543,483.25
本报告期期初基金份额总额	351,058,644.74
本报告期基金总申购份额	33,642,561.16
减：本报告期基金总赎回份额	92,480,047.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	292,221,158.52

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来基金管理人聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为其审计的会计师事务所。

### 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、托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	5,024,245,953.51	100.00%	3,661,615.27	100.00%	-

注：公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

#### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额 的比例		比例
东方财富证 券	13,896,763.91	100.00%	-	-	-	-

注：公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

### 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	恒越基金管理有限公司关于旗下基金产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定的报刊及网站	2022年1月1日
2	恒越基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份信息资料的公告	中国证监会规定的报刊及网站	2022年6月30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

本基金本报告期内无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、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内恒越品质生活混合型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区龙阳路 2277 号 21 楼，基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

恒越基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日