

# 恒越品质生活混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 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       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 49        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 49        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 49        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 49        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 49        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 51        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>52</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 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        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>55</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 .....    | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 55        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 56        |

§ 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        |
| 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 | 197,813,397.75 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   | 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。 |
| 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。<br>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<br>负责人 | 姓名   | 孙霞                        | 王小飞                    |
|             | 联系电话 | 021-80363958              | 021-60637103           |
|             | 电子邮箱 | susan.sun@hengyuefund.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 400-921-7000              | 021-60637228           |
| 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                       | 张金良                    |

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<br>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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -8,592,833.01                       |
| 本期利润          | -6,120,473.00                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0268                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -8.55%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.72%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | -138,003,971.37                     |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.6976                             |
| 期末基金资产净值      | 60,704,851.00                       |
| 期末基金份额净值      | 0.3069                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | -69.31%                             |

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      | 0.76%    | 1.01%       | -3.63%     | 0.41%         | 4.39%   | 0.60% |
| 过去三个月      | -5.07%   | 1.09%       | -2.83%     | 0.61%         | -2.24%  | 0.48% |
| 过去六个月      | -8.72%   | 1.52%       | -4.37%     | 0.78%         | -4.35%  | 0.74% |
| 过去一年       | -31.05%  | 1.48%       | -11.41%    | 0.74%         | -19.64% | 0.74% |
| 自基金合同生效起至今 | -69.31%  | 1.84%       | -25.25%    | 0.87%         | -44.06% | 0.97% |

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

恒越品质生活混合发起式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。

### 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，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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 16 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 |        |   |
| 吴海宁 | 研究部总监助理、本基金基金经理     | 2023 年 4 月 7 日   | -    | 5 年    | 曾任江苏瑞华投资控股集团有限公司研究员、西南证券股份有限公司研究员、上海混沌投资（集团）有限公司研究员、上海钦沐资产管理合伙企业（有限合伙）投资经理。2023 年 2 月加入恒越基金。  |
| 杨藻  | 权益投资部总监（联席）、本基金基金经理 | 2023 年 11 月 17 日 | -    | 8 年    | 曾就职于富士迈半导体精密工业有限公司，任产品工程师；深圳市发展改革委员会，任专业技术雇员；凯基证券亚洲有限公司上海代表处，任港股大制造行业分析师；浙商证券股份有限公司，任新能源汽车行业分析师；天风证券股份有限公司，任电力设备新能源首席分析师；中信建投证券股份有限公司，任电力设备新能源首席分析师；上海胤胜资产管理有限公司， |

|  |  |  |  |  |                         |
|--|--|--|--|--|-------------------------|
|  |  |  |  |  | 任研究总监。2022 年 9 月加入恒越基金。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------|

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》等相关规定。

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遵规守信情况的说明

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，内需修复较为缓慢，国内政策定调积极但存在滞后效应，地产投资继续深度拖累经济、财政发力存在滞后效应。出口受益于海外补库需求叠加低基数效应，制造业投资受益于设备更新政策等，表现相对较好。GDP 增速高开低走，上半年录得 5%，随着下半年低基数效应减弱，全年 GDP 实现 5%目标的压力上升。海外环境相对友好，全球经济韧性仍在，全球发达经济体陆续开启降息周期，美联储降息预期逐步上升，但大选不确定性影响加剧。

权益市场以结构性行情为主，内需疲弱环境下高股息方向表现较好，银行、煤炭、公用事业行业领涨，外需相关的出海板块阶段性也有不错表现，成长及消费方向领跌。

报告期内，基于国内宏观环境和外需产生的不确定性，本基金采取谨慎的策略，增加了防御

型资产的配置，包括高股息的公用事业，估值处于低位的港股资产。同时增加了有色，资源类资产的配置。在成长方向上，我们看好未来将产生积极变化的端侧 AI 和自主可控板块，增加了电子板块的配置，精选细分行业龙头，希望创造超额收益。

#### 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 0.3069 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.72%；同期业绩比较基准收益率为-4.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后展望，国内财政发力预计带动三季度经济动能环比回升、稳增长政策加码概率上升，内需相关板块预计迎来修复机会，外需相关板块要警惕美国经济减速和大选不确定性带来的风险。

当前位置上，基金保持低股票仓位，均衡分散，以低估值，盈利能力稳定，大市值股票为主，以降低组合的波动性。

#### 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 6,148,162.12                   | 8,826,969.77                     |
| 结算备付金         |            | 15,964.14                      | 1,513,936.82                     |
| 存出保证金         |            | —                              | —                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 53,192,263.13                  | 76,555,747.38                    |
| 其中：股票投资       |            | 53,192,263.13                  | 76,555,747.38                    |
| 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    | 2,426,002.43                   | —                                |
| 应收清算款         |            | —                              | —                                |
| 应收股利          |            | 93,280.00                      | —                                |
| 应收申购款         |            | 42,427.29                      | 16,920.09                        |
| 递延所得税资产       |            | —                              | —                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | —                              | —                                |
| 资产总计          |            | 61,918,099.11                  | 86,913,574.06                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | —                              | —                                |
| 交易性金融负债       |            | —                              | —                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | —                              | —                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | —                              | —                                |
| 应付清算款         |            | 1,055,451.25                   | —                                |
| 应付赎回款         |            | 5,988.97                       | 34,972.72                        |
| 应付管理人报酬       |            | 59,782.97                      | 89,104.98                        |
| 应付托管费         |            | 9,963.84                       | 14,850.79                        |
| 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 | 82,061.08       | 165,050.80      |
| 负债合计     |         | 1,213,248.11    | 303,979.29      |
| 净资产：     |         |                 |                 |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 197,813,397.75  | 257,607,830.68  |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | -137,108,546.75 | -170,998,235.91 |
| 净资产合计    |         | 60,704,851.00   | 86,609,594.77   |
| 负债和净资产总计 |         | 61,918,099.11   | 86,913,574.06   |

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.3069 元，基金份额总额为 197,813,397.75 份。

2、货币资金 6,148,162.12 元，包括了本基金存放于托管账户内的存款 73,856.97 元和基金结算机构的证券账户内的存款 6,074,305.15 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入               |          | -5,538,222.16                            | 432,984.16                                    |
| 1. 利息收入               |          | 33,545.50                                | 26,389.00                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 20,702.66                                | 26,389.00                                     |
| 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            |          | 12,842.84                                | -   |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | -8,094,453.13                            | -4,283,784.87                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -8,598,990.74                            | -4,717,264.56                                 |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | -  | 86,763.73                                     |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.12 | -  | -   |
| 收益                    |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.13 | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | 504,537.61                               | 346,715.96                                    |
| 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    | 2, 472, 360. 01  | 4, 591, 739. 03 |
| 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    | 50, 325. 46      | 98, 641. 00     |
| 减：二、营业总支出              |                | 582, 250. 84     | 1, 115, 051. 04 |
| 1. 管理人报酬               | 6. 4. 10. 2. 1 | 427, 539. 32     | 907, 521. 48    |
| 其中：暂估管理人报酬             |                | -                | -               |
| 2. 托管费                 | 6. 4. 10. 2. 2 | 71, 256. 59      | 121, 002. 87    |
| 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. 13           |
| 8. 其他费用                | 6. 4. 7. 19    | 83, 454. 93      | 86, 526. 56     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |                | -6, 120, 473. 00 | -682, 066. 88   |
| 减：所得税费用                |                | -                | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |                | -6, 120, 473. 00 | -682, 066. 88   |
| 五、其他综合收益的税后净额          |                | -                | -               |
| 六、综合收益总额               |                | -6, 120, 473. 00 | -682, 066. 88   |

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 257, 607, 830. 68                     | -      | -170, 998, 235. 91 | 86, 609, 594. 77 |
| 加：会计政策变更  | -                                     | -      | -                  | -                |
| 前期差错更正    | -                                     | -      | -                  | -                |
| 其他        | -                                     | -      | -                  | -                |

|  |  |        |                 |                |
|--|--|--------|-----------------|----------------|
| 二、本期期初净资产                                | 257,607,830.68                             | -      | -170,998,235.91 | 86,609,594.77  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -59,794,432.93                             | -      | 33,889,689.16   | -25,904,743.77 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -6,120,473.00   | -6,120,473.00  |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -59,794,432.93                             | -      | 40,010,162.16   | -19,784,270.77 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 30,248,883.90                              | -      | -20,702,716.29  | 9,546,167.61   |
| 2. 基金赎回款                                 | -90,043,316.83                             | -      | 60,712,878.45   | -29,330,438.38 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -  | -      | -               | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -  | -      | -               | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 197,813,397.75                             | -      | -137,108,546.75 | 60,704,851.00  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                 |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 277,962,816.33                             | -      | -153,149,470.68 | 124,813,345.65 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -               | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -               | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -               | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 277,962,816.33                             | -      | -153,149,470.68 | 124,813,345.65 |



|  |                |   |                 |                |
|--|----------------|---|-----------------|----------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -22,852,192.73 | - | 11,598,342.48   | -11,253,850.25 |
| (一)、综合收益总额                               | -              | - | -682,066.88     | -682,066.88    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -22,852,192.73 | - | 12,280,409.36   | -10,571,783.37 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 52,303,153.17  | - | -29,490,465.53  | 22,812,687.64  |
| 2. 基金赎回款                                 | -75,155,345.90 | - | 41,770,874.89   | -33,384,471.01 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -              | - | -               | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -               | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 255,110,623.60 | - | -141,551,128.20 | 113,559,495.40 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小坚

基金管理人负责人

侯晓阳

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《恒越品质生活混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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(如有)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)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 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 73,856.97              |
| 等于：本金  | 73,844.47              |
| 加：应计利息 | 12.50                  |
| 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           | 6,074,305.15 |
| 等于：本金          | 6,073,620.76 |
| 加：应计利息         | 684.39       |
| 减：坏账准备         | -            |
| 合计             | 6,148,162.12 |

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<br>2024 年 6 月 30 日 |      |               |            |
|---------------|-------|------------------------|------|---------------|------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            |       | 52,594,832.47          | -    | 53,192,263.13 | 597,430.66 |
| 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            |       | 52,594,832.47          | -    | 53,192,263.13 | 597,430.66 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 2,426,002.43           | -         |

|       |              |   |
|-------|--------------|---|
| 银行间市场 | -            | - |
| 合计    | 2,426,002.43 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 11.84                  |
| 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        | 82,049.24              |
| 合计          | 82,061.08              |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 257,607,830.68                        | 257,607,830.68 |
| 本期申购          | 30,248,883.90                         | 30,248,883.90  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -90,043,316.83                        | -90,043,316.83 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 197,813,397.75                        | 197,813,397.75 |

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

| 目    | 已实现部分           | 未实现部分      | 未分配利润合计         |
|------|-----------------|------------|-----------------|
| 上年度末 | -170,963,296.44 | -34,939.47 | -170,998,235.91 |
| 加：   | -               | -          | -               |

|                |                 |               |                 |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 会计政策变更         |                 |               |                 |
| 前期差错更正         | -               | -             | -               |
| 其他             | -               | -             | -               |
| 本期期初           | -170,963,296.44 | -34,939.47    | -170,998,235.91 |
| 本期利润           | -8,592,833.01   | 2,472,360.01  | -6,120,473.00   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 41,552,158.08   | -1,541,995.92 | 40,010,162.16   |
| 其中：基金申购款       | -21,138,665.56  | 435,949.27    | -20,702,716.29  |
| 金赎回款           | 62,690,823.64   | -1,977,945.19 | 60,712,878.45   |
| 本期已分配利润        | -               | -             | -               |
| 本期末            | -138,003,971.37 | 895,424.62    | -137,108,546.75 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 697.66                                |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 17,974.18                             |
| 结算备付金利息收入 | 2,027.32                              |
| 其他        | 3.50                                  |
| 合计        | 20,702.66                             |

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资金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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -8,598,990.74              |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                          |
| 合计               | -8,598,990.74              |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 775,981,074.42             |
| 减：卖出股票成本总额 | 782,914,244.75             |
| 减：交易费用     | 1,665,820.41               |
| 买卖股票差价收入   | -8,598,990.74              |

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。



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

无。

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

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 504,537.61                      |
| 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            | 504,537.61                      |

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 2,472,360.01                          |
| 股票投资                   | 2,472,360.01                          |
| 债券投资                   | —                                     |
| 资产支持证券投资               | —                                     |
| 基金投资                   | —                                     |
| 贵金属投资                  | —                                     |
| 其他                     | —                                     |
| 2. 衍生工具                | —                                     |
| 权证投资                   | —                                     |
| 3. 其他                  | —                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | —                                     |
| 合计                     | 2,472,360.01                          |

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 50,279.83                             |
| 基金转换费收入 | 45.63                                 |
| 合计      | 50,325.46                             |

## 6.4.7.18 信用减值损失

无。

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 22,376.90                             |
| 信息披露费    | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金  | —                                     |
| 深港通证券组合费 | 151.87                                |
| 银行费用     | 1,253.82                              |
| 合计       | 83,454.93                             |

## 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、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 基金托管人               |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 427,539.32                            | 907,521.48                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 133,141.86                            | 249,186.48                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 294,397.46                            | 658,335.00                                 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月

月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 71,256.59                                | 121,002.87                                    |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>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                            | 10,002,500.25                                 |
| 报告期初持有的基金份额                     | 15,660,133.00                            | 15,660,133.00                                 |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 0.00                                     | 0.00  |
| 报告期间因拆分变动份额                     | 0.00                                     | 0.00  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 0.00                                     | 0.00  |
| 报告期末持有的基金份额                     | 15,660,133.00                            | 15,660,133.00                                 |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例         | 7.9200%                                  | 6.1400%                                       |

注：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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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  | 73,856.97                             | 697.66 | 1,683,866.60                               | 3,694.36 |

注：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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是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。公司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。经营管理层下设风控稽核部门，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监督，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同责任，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

本报告期末及上年度末，本基金未持有债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有同业存单。

### 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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公司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<br>2024 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                     | 6,148,162.12  | -      | -        | -     | -     | -             | 6,148,162.12  |
| 结算备付金                    | 15,964.14     | -      | -        | -     | -     | -             | 15,964.14     |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | 53,192,263.13 | 53,192,263.13 |
| 买入返售金融资产                 | 2,426,002.43  | -      | -        | -     | -     | -             | 2,426,002.43  |
| 应收股利                     | -             | -      | -        | -     | -     | 93,280.00     | 93,280.00     |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 42,427.29     | 42,427.29     |
| 资产总计                     | 8,590,128.69  | -      | -        | -     | -     | 53,327,970.42 | 61,918,099.11 |
| 负债                       |               |        |          |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 5,988.97      | 5,988.97      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 59,782.97     | 59,782.97     |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 9,963.84      | 9,963.84      |
| 应付清算款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 1,055,451.25  | 1,055,451.25  |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 82,061.08     | 82,061.08     |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 1,213,248.11  | 1,213,248.11  |
| 利率敏感度缺口                  | 8,590,128.69  | -      | -        | -     | -     | 52,114,722.31 | 60,704,851.00 |
| 上年度末<br>2023 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                       |               |        |          |       |       |               |               |
| 货币资金                     | 8,826,969.77  | -      | -        | -     | -     | -             | 8,826,969.77  |
| 结算备付金                    | 1,513,936.82  | -      | -        | -     | -     | -             | 1,513,936.82  |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | 76,555,747.38 | 76,555,747.38 |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 16,920.09     | 16,920.09     |
| 资产总计                     | 10,340,906.59 | -      | -        | -     | -     | 76,572,667.47 | 86,913,574.06 |
| 负债                       |               |        |          |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 34,972.72     | 34,972.72     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 89,104.98     | 89,104.98     |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 14,850.79     | 14,850.79     |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 165,050.80    | 165,050.80    |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 303,979.29    | 303,979.29    |
| 利率敏感度缺口                  | 10,340,906.59 | -      | -        | -     | -     | 76,268,688.18 | 86,609,594.77 |

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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 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：本报告期末及上年度末，本基金未持有债券资产。

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<br>2024 年 6 月 30 日 |               |            |               |
|----------|------------------------|---------------|------------|---------------|
|          | 美元折合人民币元               | 港币折合人民币元      | 其他币种折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的资产 |                        |               |            |               |
| 交易性金融资产  | -                      | 17,745,830.49 | -          | 17,745,830.49 |

|                       |                          |               |                |               |
|-----------------------|--------------------------|---------------|----------------|---------------|
| 应收股利                  | -                        | 93,280.00     | -              | 93,280.00     |
| 资产合计                  | -                        | 17,839,110.49 | -              | 17,839,110.49 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |               |                |               |
| 负债合计                  | -                        | -             | -              | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 17,839,110.49 | -              | 17,839,110.49 |
| 项目                    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |               |                |               |
|                       | 美元<br>折合人民<br>币元         | 港币<br>折合人民币元  | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |               |                |               |
| 资产合计                  | -                        | -             | -              | -             |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |               |                |               |
| 负债合计                  | -                        | -             | -              | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | -             | -              | -             |

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<br><br>动  | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                           |
|    |                    | 本期末（2024 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2023 年 12 月<br>31 日） |
|    | 港币升值 5%            | 891,955.52                      | -                         |
|    | 港币贬值 5%            | -891,955.52                     | -                         |

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<br>2024 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 53,192,263.13          | 87.62            | 76,555,747.38       | 88.39            |
| 交易性金融资产—基金投资  | 0.00                   | 0.00             | 0.00                | 0.00             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 0.00                   | 0.00             | 0.00                | 0.00             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | 0.00                   | 0.00             | 0.00                | 0.00             |
| 衍生金融资产—权证投资   | 0.00                   | 0.00             | 0.00                | 0.00             |
| 其他            | 0.00                   | 0.00             | 0.00                | 0.00             |
| 合计            | 53,192,263.13          | 87.62            | 76,555,747.38       | 88.39            |

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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%                                    | 2,368,917.52                | 4,457,126.21           |
|    | 业绩比较基准下降 5%                                    | -2,368,917.52               | -4,457,126.21          |

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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 53,192,263.13          | 76,555,747.38            |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 53,192,263.13          | 76,555,747.38            |

#### 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 2024 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              | 53,192,263.13 | 85.91        |
|    | 其中：股票             | 53,192,263.13 | 85.91        |
| 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          | 2,426,002.43  | 3.92         |
|    | 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      | 6,164,126.26  | 9.96         |
| 8  | 其他各项资产            | 135,707.29    | 0.22         |
| 9  | 合计                | 61,918,099.11 | 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 17,745,830.49 元，占资产净值比例为 29.23%。

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         | 100,642.50    | 0.17         |
| B  | 采矿业              | 9,012,591.00  | 14.85        |
| C  | 制造业              | 17,345,751.14 | 28.57        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,568,539.00  | 7.53         |
| E  | 建筑业              | 5,523.00      | 0.01         |
| F  | 批发和零售业           | 2,418,750.00  | 3.98         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,967,845.00  | 3.24         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 10,788.00     | 0.02         |
| J  | 金融业              | 16,003.00     | 0.03         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 35,446,432.64 | 58.39 |

### 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（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 原材料      | 3,256,989.85  | 5.37         |
| 非日常生活消费品 | 1,047,300.30  | 1.73         |
| 日常消费品    | -             | -            |
| 能源       | 1,779,726.00  | 2.93         |
| 金融       | -             | -            |
| 医疗保健     | -             | -            |
| 工业       | 2,729,278.27  | 4.50         |
| 信息技术     | 4,685,653.49  | 7.72         |
| 通信服务     | -             | -            |
| 公用事业     | 4,246,882.58  | 7.00         |
| 房地产      | -             | -            |
| 合计       | 17,745,830.49 | 29.23        |

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（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 603993 | 洛阳钼业     | 396,700 | 3,371,950.00 | 5.55         |
| 2  | 002475 | 立讯精密     | 73,600  | 2,893,216.00 | 4.77         |
| 3  | 01415  | 高伟电子     | 129,000 | 2,890,411.93 | 4.76         |
| 4  | 300433 | 蓝思科技     | 152,400 | 2,781,300.00 | 4.58         |
| 5  | 600023 | 浙能电力     | 387,900 | 2,757,969.00 | 4.54         |
| 6  | 00152  | 深圳国际     | 480,000 | 2,729,278.27 | 4.50         |
| 7  | 01071  | 华电国际电力股份 | 320,000 | 1,381,432.45 | 2.28         |
| 7  | 600027 | 华电国际     | 167,600 | 1,163,144.00 | 1.92         |
| 8  | 688120 | 华海清科     | 12,878  | 2,441,411.24 | 4.02         |
| 9  | 601028 | 玉龙股份     | 193,500 | 2,418,750.00 | 3.98         |
| 10 | 601138 | 工业富联     | 74,300  | 2,035,820.00 | 3.35         |
| 11 | 603283 | 赛腾股份     | 26,500  | 2,024,600.00 | 3.34         |
| 12 | 601156 | 东航物流     | 96,700  | 1,967,845.00 | 3.24         |
| 13 | 01378  | 中国宏桥     | 180,000 | 1,941,817.97 | 3.20         |



|    |        |              |         |              |      |
|----|--------|--------------|---------|--------------|------|
| 14 | 00836  | 华润电力         | 88,000  | 1,923,564.37 | 3.17 |
| 15 | 02883  | 中海油田服务       | 260,000 | 1,779,726.00 | 2.93 |
| 16 | 000975 | 山金国际         | 105,000 | 1,710,450.00 | 2.82 |
| 17 | 601899 | 紫金矿业         | 77,800  | 1,366,946.00 | 2.25 |
| 18 | 600938 | 中国海油         | 41,300  | 1,362,900.00 | 2.25 |
| 19 | 01818  | 招金矿业         | 110,000 | 1,315,171.88 | 2.17 |
| 20 | 06088  | FIT HON TENG | 400,000 | 1,266,799.84 | 2.09 |
| 21 | 601168 | 西部矿业         | 65,600  | 1,177,520.00 | 1.94 |
| 22 | 002594 | 比亚迪          | 4,600   | 1,151,150.00 | 1.90 |
| 23 | 09992  | 泡泡玛特         | 30,000  | 1,047,300.30 | 1.73 |
| 24 | 01816  | 中广核电力        | 300,000 | 941,885.76   | 1.55 |
| 25 | 600011 | 华能国际         | 67,300  | 647,426.00   | 1.07 |
| 26 | 002273 | 水晶光电         | 37,500  | 636,750.00   | 1.05 |
| 27 | 002384 | 东山精密         | 30,300  | 627,210.00   | 1.03 |
| 28 | 688082 | 盛美上海         | 7,108   | 600,697.08   | 0.99 |
| 29 | 002532 | 天山铝业         | 71,700  | 581,487.00   | 0.96 |
| 30 | 601600 | 中国铝业         | 71,200  | 543,256.00   | 0.89 |
| 31 | 02382  | 舜宇光学科技       | 12,000  | 528,441.72   | 0.87 |
| 32 | 000933 | 神火股份         | 24,900  | 503,727.00   | 0.83 |
| 33 | 002938 | 鹏鼎控股         | 3,100   | 123,256.00   | 0.20 |
| 34 | 688123 | 聚辰股份         | 1,764   | 107,304.12   | 0.18 |
| 35 | 600426 | 华鲁恒升         | 4,000   | 106,560.00   | 0.18 |
| 36 | 605296 | 神农集团         | 2,670   | 93,850.50    | 0.15 |
| 37 | 688169 | 石头科技         | 111     | 43,578.60    | 0.07 |
| 38 | 601058 | 赛轮轮胎         | 700     | 9,800.00     | 0.02 |
| 39 | 688115 | 思林杰          | 322     | 7,592.76     | 0.01 |
| 40 | 601898 | 中煤能源         | 600     | 7,488.00     | 0.01 |
| 41 | 600420 | 国药现代         | 700     | 7,476.00     | 0.01 |
| 42 | 603596 | 伯特利          | 180     | 7,002.00     | 0.01 |
| 43 | 300761 | 立华股份         | 300     | 6,792.00     | 0.01 |
| 44 | 600761 | 安徽合力         | 300     | 6,492.00     | 0.01 |
| 45 | 603061 | 金海通          | 100     | 6,428.00     | 0.01 |
| 46 | 300474 | 景嘉微          | 100     | 6,323.00     | 0.01 |
| 47 | 301378 | 通达海          | 280     | 6,076.00     | 0.01 |
| 48 | 601918 | 新集能源         | 620     | 6,045.00     | 0.01 |
| 49 | 600141 | 兴发集团         | 300     | 5,724.00     | 0.01 |
| 50 | 601059 | 信达证券         | 400     | 5,684.00     | 0.01 |
| 51 | 600690 | 海尔智家         | 200     | 5,676.00     | 0.01 |
| 52 | 600039 | 四川路桥         | 700     | 5,523.00     | 0.01 |
| 53 | 688017 | 绿的谐波         | 64      | 5,254.40     | 0.01 |
| 54 | 600988 | 赤峰黄金         | 300     | 4,902.00     | 0.01 |
| 55 | 603496 | 恒为科技         | 200     | 4,890.00     | 0.01 |
| 56 | 688652 | 京仪装备         | 119     | 4,651.71     | 0.01 |

|    |        |      |       |          |      |
|----|--------|------|-------|----------|------|
| 57 | 603369 | 今世缘  | 100   | 4,620.00 | 0.01 |
| 58 | 688127 | 蓝特光学 | 247   | 4,542.33 | 0.01 |
| 59 | 601288 | 农业银行 | 1,000 | 4,360.00 | 0.01 |
| 60 | 603888 | 新华网  | 200   | 4,302.00 | 0.01 |
| 61 | 301061 | 匠心家居 | 90    | 4,226.40 | 0.01 |
| 62 | 603019 | 中科曙光 | 100   | 4,150.00 | 0.01 |
| 63 | 601318 | 中国平安 | 100   | 4,136.00 | 0.01 |
| 64 | 603728 | 鸣志电器 | 100   | 4,023.00 | 0.01 |
| 65 | 300820 | 英杰电气 | 100   | 3,934.00 | 0.01 |
| 66 | 603179 | 新泉股份 | 100   | 3,924.00 | 0.01 |
| 67 | 000977 | 浪潮信息 | 100   | 3,637.00 | 0.01 |
| 68 | 688223 | 晶科能源 | 499   | 3,542.90 | 0.01 |
| 69 | 603197 | 保隆科技 | 100   | 3,150.00 | 0.01 |
| 70 | 002415 | 海康威视 | 100   | 3,091.00 | 0.01 |
| 71 | 002837 | 英维克  | 130   | 2,780.70 | 0.00 |
| 72 | 688599 | 天合光能 | 158   | 2,673.36 | 0.00 |
| 73 | 601225 | 陕西煤业 | 100   | 2,577.00 | 0.00 |
| 74 | 600160 | 巨化股份 | 100   | 2,413.00 | 0.00 |
| 75 | 603203 | 快克智能 | 100   | 2,358.00 | 0.00 |
| 76 | 605555 | 德昌股份 | 124   | 2,307.64 | 0.00 |
| 77 | 000737 | 北方铜业 | 200   | 1,856.00 | 0.00 |
| 78 | 600030 | 中信证券 | 100   | 1,823.00 | 0.00 |
| 79 | 601699 | 潞安环能 | 100   | 1,813.00 | 0.00 |
| 80 | 603009 | 北特科技 | 100   | 1,793.00 | 0.00 |
| 81 | 603667 | 五洲新春 | 100   | 1,640.00 | 0.00 |
| 82 | 002182 | 宝武镁业 | 140   | 1,579.20 | 0.00 |
| 83 | 600686 | 金龙汽车 | 200   | 1,472.00 | 0.00 |
| 84 | 603027 | 千禾味业 | 100   | 1,330.00 | 0.00 |
| 85 | 002154 | 报喜鸟  | 200   | 1,088.00 | 0.00 |
| 86 | 688733 | 壹石通  | 66    | 986.70   | 0.00 |
| 87 | 300044 | 赛为智能 | 100   | 410.00   | 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  | 300308 | 中际旭创 | 24,451,551.84 | 28.23          |
| 2  | 601088 | 中国神华 | 17,849,781.00 | 20.61          |
| 3  | 688017 | 绿的谐波 | 17,357,986.02 | 20.04          |
| 4  | 600188 | 兖矿能源 | 16,661,282.00 | 19.24          |
| 5  | 603728 | 鸣志电器 | 15,437,561.00 | 17.82          |
| 6  | 601138 | 工业富联 | 15,437,557.00 | 17.82          |
| 7  | 000983 | 山西焦煤 | 14,436,508.10 | 16.67          |

|    |        |          |               |       |
|----|--------|----------|---------------|-------|
| 8  | 603667 | 五洲新春     | 14,022,268.84 | 16.19 |
| 9  | 002050 | 三花智控     | 13,116,895.01 | 15.14 |
| 10 | 300502 | 新易盛      | 12,113,049.00 | 13.99 |
| 11 | 300394 | 天孚通信     | 11,835,012.54 | 13.66 |
| 12 | 600546 | 山煤国际     | 10,856,438.52 | 12.53 |
| 13 | 300857 | 协创数据     | 10,421,605.00 | 12.03 |
| 14 | 603009 | 北特科技     | 9,341,519.00  | 10.79 |
| 15 | 000977 | 浪潮信息     | 9,240,337.97  | 10.67 |
| 16 | 603993 | 洛阳钼业     | 9,022,207.00  | 10.42 |
| 17 | 600030 | 中信证券     | 8,468,829.00  | 9.78  |
| 18 | 300809 | 华辰装备     | 7,958,698.00  | 9.19  |
| 19 | 601225 | 陕西煤业     | 7,944,933.00  | 9.17  |
| 20 | 300354 | 东华测试     | 7,848,579.13  | 9.06  |
| 21 | 600027 | 华电国际     | 6,071,929.00  | 7.01  |
| 21 | 01071  | 华电国际电力股份 | 1,379,208.18  | 1.59  |
| 22 | 300750 | 宁德时代     | 7,371,193.60  | 8.51  |
| 23 | 603662 | 柯力传感     | 7,340,476.00  | 8.48  |
| 24 | 601666 | 平煤股份     | 7,049,588.81  | 8.14  |
| 25 | 688698 | 伟创电气     | 6,759,622.39  | 7.80  |
| 26 | 002966 | 苏州银行     | 6,373,382.90  | 7.36  |
| 27 | 601898 | 中煤能源     | 6,253,689.00  | 7.22  |
| 28 | 002896 | 中大力德     | 6,185,189.58  | 7.14  |
| 29 | 002850 | 科达利      | 6,138,883.00  | 7.09  |
| 30 | 601288 | 农业银行     | 5,913,003.00  | 6.83  |
| 31 | 300580 | 贝斯特      | 5,811,593.00  | 6.71  |
| 32 | 601398 | 工商银行     | 5,713,473.00  | 6.60  |
| 33 | 01415  | 高伟电子     | 5,523,440.74  | 6.38  |
| 34 | 688772 | 珠海冠宇     | 5,476,911.11  | 6.32  |
| 35 | 603920 | 世运电路     | 5,421,079.00  | 6.26  |
| 36 | 601100 | 恒立液压     | 5,352,883.00  | 6.18  |
| 37 | 000543 | 皖能电力     | 5,320,066.00  | 6.14  |
| 38 | 601156 | 东航物流     | 4,950,480.00  | 5.72  |
| 39 | 600988 | 赤峰黄金     | 4,896,968.00  | 5.65  |
| 40 | 688160 | 步科股份     | 4,882,091.90  | 5.64  |
| 41 | 002472 | 双环传动     | 4,831,868.00  | 5.58  |
| 42 | 000630 | 铜陵有色     | 4,789,840.00  | 5.53  |
| 43 | 000933 | 神火股份     | 4,753,097.00  | 5.49  |
| 44 | 300442 | 润泽科技     | 4,608,922.00  | 5.32  |
| 45 | 002929 | 润建股份     | 4,596,824.00  | 5.31  |
| 46 | 600256 | 广汇能源     | 4,533,398.47  | 5.23  |
| 47 | 600426 | 华鲁恒升     | 4,450,218.80  | 5.14  |
| 48 | 301589 | 诺瓦星云     | 4,344,140.00  | 5.02  |
| 49 | 601918 | 新集能源     | 4,337,845.60  | 5.01  |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 50 | 000034 | 神州数码  | 4,198,890.00 | 4.85 |
| 51 | 601028 | 玉龙股份  | 3,856,368.00 | 4.45 |
| 52 | 605296 | 神农集团  | 3,849,396.50 | 4.44 |
| 53 | 600186 | 莲花控股  | 3,815,471.00 | 4.41 |
| 54 | 600585 | 海螺水泥  | 3,740,628.00 | 4.32 |
| 55 | 600519 | 贵州茅台  | 3,738,515.00 | 4.32 |
| 56 | 000001 | 平安银行  | 3,695,974.00 | 4.27 |
| 57 | 601318 | 中国平安  | 3,628,231.99 | 4.19 |
| 58 | 600919 | 江苏银行  | 3,606,192.00 | 4.16 |
| 59 | 300033 | 同花顺   | 3,562,115.00 | 4.11 |
| 60 | 600961 | 株冶集团  | 3,492,329.00 | 4.03 |
| 61 | 300570 | 太辰光   | 3,481,737.00 | 4.02 |
| 62 | 600160 | 巨化股份  | 3,455,264.00 | 3.99 |
| 63 | 601688 | 华泰证券  | 3,443,243.00 | 3.98 |
| 64 | 600660 | 福耀玻璃  | 3,425,583.00 | 3.96 |
| 65 | 301061 | 匠心家居  | 3,415,674.20 | 3.94 |
| 66 | 002459 | 晶澳科技  | 3,400,502.00 | 3.93 |
| 67 | 600023 | 浙能电力  | 3,346,815.00 | 3.86 |
| 68 | 000528 | 柳工    | 3,254,750.00 | 3.76 |
| 69 | 600970 | 中材国际  | 3,150,514.00 | 3.64 |
| 70 | 300408 | 三环集团  | 3,126,785.00 | 3.61 |
| 71 | 00152  | 深圳国际  | 3,120,191.93 | 3.60 |
| 72 | 301095 | 广立微   | 3,104,666.00 | 3.58 |
| 73 | 000063 | 中兴通讯  | 3,101,183.00 | 3.58 |
| 74 | 002415 | 海康威视  | 3,075,993.00 | 3.55 |
| 75 | 603303 | 得邦照明  | 3,023,397.00 | 3.49 |
| 76 | 002475 | 立讯精密  | 3,019,120.00 | 3.49 |
| 77 | 688019 | 安集科技  | 2,974,457.34 | 3.43 |
| 78 | 000612 | 焦作万方  | 2,972,911.80 | 3.43 |
| 79 | 601689 | 拓普集团  | 2,967,917.00 | 3.43 |
| 80 | 688120 | 华海清科  | 2,962,953.43 | 3.42 |
| 81 | 000975 | 山金国际  | 2,923,086.00 | 3.38 |
| 82 | 603283 | 赛腾股份  | 2,847,433.00 | 3.29 |
| 83 | 688071 | 华依科技  | 2,831,986.81 | 3.27 |
| 84 | 002714 | 牧原股份  | 2,785,825.00 | 3.22 |
| 85 | 003006 | 百亚股份  | 2,784,573.00 | 3.22 |
| 86 | 301358 | 湖南裕能  | 2,771,036.00 | 3.20 |
| 87 | 002463 | 沪电股份  | 2,721,864.00 | 3.14 |
| 88 | 01816  | 中广核电力 | 2,705,830.50 | 3.12 |
| 89 | 601600 | 中国铝业  | 2,675,890.00 | 3.09 |
| 90 | 001965 | 招商公路  | 2,575,377.00 | 2.97 |
| 91 | 601168 | 西部矿业  | 2,543,269.00 | 2.94 |
| 92 | 688606 | 奥泰生物  | 2,533,603.27 | 2.93 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 93  | 300748 | 金力永磁   | 2,525,692.00 | 2.92 |
| 94  | 688111 | 金山办公   | 2,511,165.98 | 2.90 |
| 95  | 300433 | 蓝思科技   | 2,425,284.00 | 2.80 |
| 96  | 300873 | 海晨股份   | 2,412,971.60 | 2.79 |
| 97  | 600502 | 安徽建工   | 2,350,931.00 | 2.71 |
| 98  | 600782 | 新钢股份   | 2,326,457.00 | 2.69 |
| 99  | 603220 | 中贝通信   | 2,285,638.48 | 2.64 |
| 100 | 600039 | 四川路桥   | 2,283,092.20 | 2.64 |
| 101 | 603496 | 恒为科技   | 2,254,552.00 | 2.60 |
| 102 | 09992  | 泡泡玛特   | 2,222,496.83 | 2.57 |
| 103 | 603061 | 金海通    | 2,180,128.00 | 2.52 |
| 104 | 01378  | 中国宏桥   | 2,130,423.59 | 2.46 |
| 105 | 000333 | 美的集团   | 2,129,652.00 | 2.46 |
| 106 | 603027 | 千禾味业   | 2,129,463.00 | 2.46 |
| 107 | 000807 | 云铝股份   | 2,118,729.00 | 2.45 |
| 108 | 600809 | 山西汾酒   | 2,109,416.00 | 2.44 |
| 109 | 002155 | 湖南黄金   | 2,104,521.00 | 2.43 |
| 110 | 600309 | 万华化学   | 2,101,189.00 | 2.43 |
| 111 | 688668 | 鼎通科技   | 2,096,265.55 | 2.42 |
| 112 | 002156 | 通富微电   | 2,089,718.00 | 2.41 |
| 113 | 002407 | 多氟多    | 2,078,496.00 | 2.40 |
| 114 | 002709 | 天赐材料   | 2,070,686.00 | 2.39 |
| 115 | 603408 | 建霖家居   | 2,048,377.00 | 2.37 |
| 116 | 000949 | 新乡化纤   | 1,993,856.00 | 2.30 |
| 117 | 600141 | 兴发集团   | 1,981,054.00 | 2.29 |
| 118 | 002245 | 蔚蓝锂芯   | 1,977,629.00 | 2.28 |
| 119 | 600820 | 隧道股份   | 1,973,245.00 | 2.28 |
| 120 | 600733 | 北汽蓝谷   | 1,971,858.00 | 2.28 |
| 121 | 00836  | 华润电力   | 1,966,595.87 | 2.27 |
| 122 | 002056 | 横店东磁   | 1,945,626.00 | 2.25 |
| 123 | 688472 | 阿特斯    | 1,889,990.35 | 2.18 |
| 124 | 300274 | 阳光电源   | 1,870,526.00 | 2.16 |
| 125 | 01070  | TCL 电子 | 1,853,267.20 | 2.14 |
| 126 | 301004 | 嘉益股份   | 1,842,082.00 | 2.13 |
| 127 | 002712 | 思美传媒   | 1,821,323.00 | 2.10 |
| 128 | 02883  | 中海油田服务 | 1,810,894.92 | 2.09 |
| 129 | 000893 | 亚钾国际   | 1,737,543.00 | 2.01 |

#### 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  | 300308 | 中际旭创 | 29,040,411.20 | 33.53          |
| 2  | 688017 | 绿的谐波 | 20,279,553.22 | 23.41          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 3  | 603728 | 鸣志电器 | 20,179,149.22 | 23.30 |
| 4  | 601088 | 中国神华 | 18,065,439.00 | 20.86 |
| 5  | 300502 | 新易盛  | 16,847,348.00 | 19.45 |
| 6  | 600188 | 兖矿能源 | 16,456,824.00 | 19.00 |
| 7  | 300394 | 天孚通信 | 16,199,577.00 | 18.70 |
| 8  | 603667 | 五洲新春 | 15,117,225.48 | 17.45 |
| 9  | 601138 | 工业富联 | 14,836,324.00 | 17.13 |
| 10 | 000983 | 山西焦煤 | 14,690,453.00 | 16.96 |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 12,596,432.50 | 14.54 |
| 12 | 300809 | 华辰装备 | 11,432,140.80 | 13.20 |
| 13 | 300857 | 协创数据 | 10,830,266.00 | 12.50 |
| 14 | 600546 | 山煤国际 | 10,471,904.30 | 12.09 |
| 15 | 603662 | 柯力传感 | 9,657,080.00  | 11.15 |
| 16 | 603009 | 北特科技 | 9,495,479.00  | 10.96 |
| 17 | 000977 | 浪潮信息 | 8,681,275.85  | 10.02 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 8,417,790.00  | 9.72  |
| 19 | 601225 | 陕西煤业 | 7,919,487.00  | 9.14  |
| 20 | 300354 | 东华测试 | 7,573,658.15  | 8.74  |
| 21 | 300750 | 宁德时代 | 7,563,224.20  | 8.73  |
| 22 | 601666 | 平煤股份 | 7,417,454.00  | 8.56  |
| 23 | 002966 | 苏州银行 | 6,480,295.20  | 7.48  |
| 24 | 688698 | 伟创电气 | 6,472,791.36  | 7.47  |
| 25 | 002850 | 科达利  | 6,238,938.00  | 7.20  |
| 26 | 002896 | 中大力德 | 6,200,678.00  | 7.16  |
| 27 | 601898 | 中煤能源 | 6,180,926.00  | 7.14  |
| 28 | 603993 | 洛阳钼业 | 6,178,619.00  | 7.13  |
| 29 | 601398 | 工商银行 | 6,033,159.00  | 6.97  |
| 30 | 601288 | 农业银行 | 5,987,401.00  | 6.91  |
| 31 | 000543 | 皖能电力 | 5,683,688.00  | 6.56  |
| 32 | 603920 | 世运电路 | 5,682,740.18  | 6.56  |
| 33 | 300580 | 贝斯特  | 5,567,246.00  | 6.43  |
| 34 | 688160 | 步科股份 | 5,542,813.90  | 6.40  |
| 35 | 300570 | 太辰光  | 5,506,878.00  | 6.36  |
| 36 | 600988 | 赤峰黄金 | 5,312,412.00  | 6.13  |
| 37 | 601100 | 恒立液压 | 5,257,109.00  | 6.07  |
| 38 | 688772 | 珠海冠宇 | 5,041,846.43  | 5.82  |
| 39 | 600027 | 华电国际 | 4,906,895.00  | 5.67  |
| 40 | 000630 | 铜陵有色 | 4,724,157.00  | 5.45  |
| 41 | 002472 | 双环传动 | 4,673,806.00  | 5.40  |
| 42 | 300442 | 润泽科技 | 4,609,811.00  | 5.32  |
| 43 | 002929 | 润建股份 | 4,543,921.00  | 5.25  |
| 44 | 301589 | 诺瓦星云 | 4,412,879.00  | 5.10  |
| 45 | 600256 | 广汇能源 | 4,365,275.00  | 5.04  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 46 | 600426 | 华鲁恒升 | 4,337,392.61 | 5.01 |
| 47 | 300873 | 海晨股份 | 4,263,432.00 | 4.92 |
| 48 | 000034 | 神州数码 | 4,163,717.00 | 4.81 |
| 49 | 601918 | 新集能源 | 4,140,018.20 | 4.78 |
| 50 | 600585 | 海螺水泥 | 3,992,613.00 | 4.61 |
| 51 | 000933 | 神火股份 | 3,901,476.72 | 4.50 |
| 52 | 000625 | 长安汽车 | 3,900,332.00 | 4.50 |
| 53 | 600519 | 贵州茅台 | 3,889,954.00 | 4.49 |
| 54 | 000001 | 平安银行 | 3,783,406.00 | 4.37 |
| 55 | 600919 | 江苏银行 | 3,771,140.00 | 4.35 |
| 56 | 600186 | 莲花控股 | 3,686,129.00 | 4.26 |
| 57 | 600660 | 福耀玻璃 | 3,618,523.00 | 4.18 |
| 58 | 601318 | 中国平安 | 3,583,317.00 | 4.14 |
| 59 | 605296 | 神农集团 | 3,548,710.80 | 4.10 |
| 60 | 000528 | 柳工   | 3,540,235.60 | 4.09 |
| 61 | 002520 | 日发精机 | 3,483,860.00 | 4.02 |
| 62 | 300033 | 同花顺  | 3,467,975.00 | 4.00 |
| 63 | 601688 | 华泰证券 | 3,432,220.00 | 3.96 |
| 64 | 600160 | 巨化股份 | 3,404,636.00 | 3.93 |
| 65 | 600970 | 中材国际 | 3,319,551.00 | 3.83 |
| 66 | 002459 | 晶澳科技 | 3,312,924.00 | 3.83 |
| 67 | 01415  | 高伟电子 | 3,296,357.09 | 3.81 |
| 68 | 601156 | 东航物流 | 3,176,910.00 | 3.67 |
| 69 | 000063 | 中兴通讯 | 3,136,419.00 | 3.62 |
| 70 | 600961 | 株冶集团 | 3,123,731.00 | 3.61 |
| 71 | 300408 | 三环集团 | 3,086,825.00 | 3.56 |
| 72 | 000612 | 焦作万方 | 3,082,963.00 | 3.56 |
| 73 | 301095 | 广立微  | 3,072,079.00 | 3.55 |
| 74 | 002241 | 歌尔股份 | 3,068,701.00 | 3.54 |
| 75 | 601689 | 拓普集团 | 3,043,445.00 | 3.51 |
| 76 | 002415 | 海康威视 | 3,035,114.00 | 3.50 |
| 77 | 301061 | 匠心家居 | 3,028,846.20 | 3.50 |
| 78 | 688071 | 华依科技 | 3,011,036.89 | 3.48 |
| 79 | 688019 | 安集科技 | 3,005,518.41 | 3.47 |
| 80 | 603303 | 得邦照明 | 2,963,704.00 | 3.42 |
| 81 | 003006 | 百亚股份 | 2,872,205.00 | 3.32 |
| 82 | 002463 | 沪电股份 | 2,760,077.00 | 3.19 |
| 83 | 002714 | 牧原股份 | 2,753,677.00 | 3.18 |
| 84 | 301358 | 湖南裕能 | 2,714,561.00 | 3.13 |
| 85 | 300761 | 立华股份 | 2,667,162.20 | 3.08 |
| 86 | 001965 | 招商公路 | 2,617,424.00 | 3.02 |
| 87 | 000938 | 紫光股份 | 2,485,313.00 | 2.87 |
| 88 | 600782 | 新钢股份 | 2,442,165.00 | 2.82 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 89  | 300748 | 金力永磁   | 2,440,227.00 | 2.82 |
| 90  | 688606 | 奥泰生物   | 2,379,592.08 | 2.75 |
| 91  | 600039 | 四川路桥   | 2,378,448.00 | 2.75 |
| 92  | 600502 | 安徽建工   | 2,363,265.00 | 2.73 |
| 93  | 688111 | 金山办公   | 2,350,605.96 | 2.71 |
| 94  | 603220 | 中贝通信   | 2,267,475.40 | 2.62 |
| 95  | 002156 | 通富微电   | 2,255,034.00 | 2.60 |
| 96  | 600309 | 万华化学   | 2,231,136.00 | 2.58 |
| 97  | 000807 | 云铝股份   | 2,225,546.00 | 2.57 |
| 98  | 000333 | 美的集团   | 2,216,316.00 | 2.56 |
| 99  | 603496 | 恒为科技   | 2,166,402.00 | 2.50 |
| 100 | 603027 | 千禾味业   | 2,112,660.00 | 2.44 |
| 101 | 002709 | 天赐材料   | 2,104,422.00 | 2.43 |
| 102 | 600809 | 山西汾酒   | 2,092,619.00 | 2.42 |
| 103 | 603278 | 大业股份   | 2,091,034.00 | 2.41 |
| 104 | 002155 | 湖南黄金   | 2,082,724.00 | 2.40 |
| 105 | 300445 | 康斯特    | 2,074,668.00 | 2.40 |
| 106 | 603061 | 金海通    | 2,074,540.00 | 2.40 |
| 107 | 01816  | 中广核电力  | 2,068,226.80 | 2.39 |
| 108 | 300260 | 新莱应材   | 2,034,823.00 | 2.35 |
| 109 | 002245 | 蔚蓝锂芯   | 2,033,967.00 | 2.35 |
| 110 | 603408 | 建霖家居   | 1,995,688.00 | 2.30 |
| 111 | 600820 | 隧道股份   | 1,973,864.00 | 2.28 |
| 112 | 600733 | 北汽蓝谷   | 1,957,340.00 | 2.26 |
| 113 | 002407 | 多氟多    | 1,953,746.00 | 2.26 |
| 114 | 601600 | 中国铝业   | 1,944,314.00 | 2.24 |
| 115 | 01070  | TCL 电子 | 1,940,507.40 | 2.24 |
| 116 | 600141 | 兴发集团   | 1,926,735.02 | 2.22 |
| 117 | 301004 | 嘉益股份   | 1,910,055.00 | 2.21 |
| 118 | 688548 | 广钢气体   | 1,879,020.28 | 2.17 |
| 119 | 300007 | 汉威科技   | 1,878,270.00 | 2.17 |
| 120 | 688668 | 鼎通科技   | 1,869,472.79 | 2.16 |
| 121 | 002056 | 横店东磁   | 1,857,241.00 | 2.14 |
| 122 | 000949 | 新乡化纤   | 1,836,857.00 | 2.12 |
| 123 | 300274 | 阳光电源   | 1,818,670.06 | 2.10 |
| 124 | 688472 | 阿特斯    | 1,814,830.69 | 2.10 |

#### 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 | 757,078,400.49 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 775,981,074.42 |

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

无。

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

无。

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

无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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 | -          |
| 3  | 应收股利  | 93,280.00  |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 42,427.29  |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 135,707.29 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |                |                |               |
|--------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
|              |               | 机构投资者         |                | 个人投资者          |               |
|              |               | 持有份额          | 占总份额比<br>例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例<br>(%) |
| 5,264        | 37,578.53     | 43,660,366.47 | 22.07          | 154,153,031.28 | 77.93         |

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 | 3,067,168.85 | 1.5505       |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 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<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 15,660,133.00 | 7.92                        | 10,002,500.25 | 5.06                    | 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 | 7.92                        | 10,002,500.25 | 5.06                    | -              |

§ 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）<br>基金份额总额 | 167,543,483.25 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 257,607,830.68 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 30,248,883.90  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 90,043,316.83  |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 197,813,397.75 |

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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(%) |    |
| 东北证券 | 3      | 949,509,500.10 | 61.94           | 714,662.25 | 62.63         | —  |
| 东方财富 | 3      | 583,549,974.81 | 38.06           | 426,355.87 | 37.37         | —  |

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总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 东北证券 | -    | -               | 57,226,000.00 | 54.79             | -    | -               |
| 东方财富 | -    | -               | 47,216,000.00 | 45.21             | -    | -               |

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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024 年 6 月 28 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、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 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

2024 年 8 月 31 日