

# 中海消费主题精选混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 27 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。本半年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 24 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>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 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>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	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
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
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	中海消费主题精选混合型证券投资基金
基金简称	中海消费混合
基金主代码	398061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 9 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	84,195,651.88 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于消费主题行业及其中的优势上市公司，分享其发展和成长的机会，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。
投资策略	<p>本基金是一只采用主题投资方法的股票型基金产品，主要投资于消费主题行业及其中的优势上市公司。</p> <p>1、消费主题行业范畴的界定</p> <p>本基金采用的行业分类基准是万得资讯发布的行业分类标准。本基金拟投资的消费主题行业主要包括工业、可选消费、日常消费和医疗保健等 8 个一级行业和 19 个二级行业。</p> <p>如果万得资讯调整或停止行业分类，或者基金管理人认为有更适当的消费主题行业划分标准，基金管理人可对消费主题行业的界定方法进行调整。</p> <p>2、大类资产配置</p> <p>大类资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，本基金主要考虑如下因素：</p> <p>宏观经济，政策层面，市场估值，市场情绪。</p> <p>本基金将深入分析上述四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。</p> <p>本基金对消费主题行业内的个股将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>(1) 定量分析</p> <p>本基金通过综合考察上市公司的成长优势、财务优势和估值优势来进行个股的筛选。</p> <p>本基金综合考察上市公司的成长指标、财务指标和估值指标，通过归一化等量化处理，对入选的上市公司按照其在每项指标的高低顺序进行打分，得到一个标准化的指标分数。再将指标分数进行等权</p>

	<p>相加，得到一个总分。按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的管理水平，并坚决规避那些管理水平差的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。</p> <p>本基金通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择遵循相对价值原则和流动性原则。</p>
业绩比较基准	中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 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		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄乐军	秦一楠
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95599
传真		021-68419525	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		曾杰	谷澍

## 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	www.zhfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号

	2905-2908 室及 30 层
--	-------------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-115,430,472.97
本期利润	-95,043,663.15
加权平均基金份额本期利润	-1.0571
本期加权平均净值利润率	-22.53%
本期基金份额净值增长率	-17.42%
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	187,912,518.26
期末可供分配基金份额利润	2.2319
期末基金资产净值	394,372,169.55
期末基金份额净值	4.684
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	459.40%

注：注 1：以上所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 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。

#### 3.2 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	7.04%	1.33%	10.38%	1.07%	-3.34%	0.26%
过去三个月	-0.32%	1.48%	15.78%	1.28%	-16.10%	0.20%
过去六个月	-17.42%	1.66%	-2.25%	1.38%	-15.17%	0.28%
过去一年	-21.86%	1.82%	-8.26%	1.32%	-13.60%	0.50%

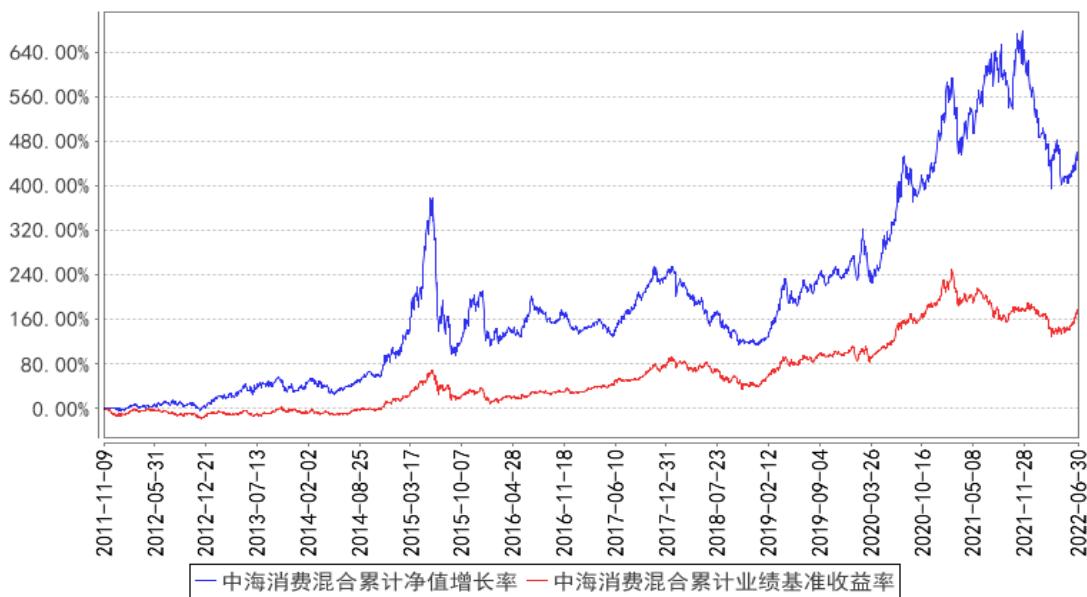
过去三年	75.69%	1.80%	45.92%	1.27%	29.77%	0.53%
自基金合同生效起至今	459.40%	1.81%	175.44%	1.25%	283.96%	0.56%

注：1：“自基金合同生效起至今”指 2011 年 11 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

2：本基金的业绩比较基准为中证内地消费指数涨跌幅  $\times$  80% + 中国债券总指数涨跌幅  $\times$  20%，由于本基金为消费主题基金，我们选取市场认同度很高的中证内地消费指数、中国债券总指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 60%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 80% 左右，债券投资比例控制在 20% 左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 80%、20% 的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

### 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

中海消费混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格

履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2022 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 31 只。

#### 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		
姚晨曦	权益投资部权益投资副总监、本基金基金经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理、中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理	2015 年 4 月 17 日	-	14 年	姚晨曦先生，复旦大学金融学专业硕士。曾任上海申银万国证券研究所二级分析师。2009 年 5 月进入本公司工作，历任分析师、分析师兼基金经理助理，现任权益投资部权益投资副总监、基金经理。2016 年 4 月至 2021 年 7 月任中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至今任中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至今任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至今任中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理。
何文逸	本基金基金经理	2022 年 2 月 15 日	-	7 年	何文逸女士，西南财经大学金融学专业硕士。曾任东海基金管理有限责任公司研究开发部研究员、高级研究员。2017 年 3 月进入本公司工作，历任分析师、高级分析师、基金经理助理兼高级分析师，现任基金经理。2022 年 2 月至今任中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理。

注：1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2：证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3：2022 年 2 月 15 日，本公司增聘何文逸为本基金基金经理，由姚晨曦、何文逸共同管理该基金。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

## 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，公司均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

## 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

年初，在稳增长政策的推动下国内宏观经济稳步走好，然而 3 月份开始爆发的疫情再次打断了经济的复苏步伐，尤其上海的全面停摆严重冲击了长三角地区和部分行业的供应链，导致各项经济指标再次全面下滑。虽然，6 月份随着上海疫情的基本结束，以及更大力度宽松政策的全面推出，经济再次强势反弹，但是年内要实现 5.5%左右的经济增长目标依然面临较大压力，而且疫情防控也始终无法放松。

海外的局势就更加复杂了。俄乌战争的爆发进一步加剧了全球通胀压力，美联储不得不继续加快加息的步伐，欧洲也将提前进入加息周期。提前冲高回落的美债收益率显示市场开始越来越担心后续可能的经济硬着陆和衰退。

市场方面，伴随 2 季度经济的下滑和反弹，指数也走出先弱后强的 V 形走势。其中，伴随前期估值的充分调整以及美债收益率的阶段性见顶，以新能源板块为代表的成长股反弹尤为显著，市场也重新回到去年的结构性行情轨道上。

去年调整了一年的消费板块再次遭遇了疫情的冲击，尽管有各种政策的刺激，但居民整体收入水平的下降以及线下消费的制约使得消费行业的整体复苏依然长路漫漫。

本基金上半年的配置结构做过几次比较明显的调整。年初以线下出行产业链和可选消费品为主，疫情爆发后调整为稳增长主线的房地产和建筑建材板块以及以养殖为主的必选消费品。5 月份之后，随着疫情缓解和市场的反弹，我们重新把仓位调整到了医美、汽车、人造钻石等可选消费板块上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值 4.684 元（累计净值 4.894 元）。报告期内本基金净值增长率为-17.42%，低于业绩比较基准 15.17 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为市场会拥有更好的外部环境，国内经济的稳步复苏以及美联储加息预期的大幅缓解，有利于市场继续在结构性行情轨道中前行，业绩高增长的优质成长股依然是市场追逐的主要目标。

虽然我们对年内消费板块的整体复苏依然保持谨慎的态度，但结构性机会依然存在。除了显著受益政策刺激的汽车以及零部件板块外，我们会更多受疫情冲击更小的高端消费领域以及一些新兴消费子行业寻找机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风控总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按

约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

—

### § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中海基金基金管理有限公司基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，中海基金基金管理有限公司基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，中海基金基金管理有限公司基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：中海消费主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6. 4. 7. 1	29, 154, 209. 31	32, 620, 158. 79
结算备付金		1, 300, 561. 75	1, 163, 969. 00
存出保证金		266, 637. 40	339, 544. 98
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	353, 885, 809. 44	517, 444, 745. 83
其中：股票投资		353, 885, 809. 44	517, 444, 745. 83
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	—	—
债权投资	6. 4. 7. 5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6. 4. 7. 6	—	—
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	—	—
应收清算款		12, 117, 626. 98	1, 130, 532. 15
应收股利		—	—
应收申购款		574, 814. 97	536, 340. 22
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	10, 611. 39
资产总计		397, 299, 659. 85	553, 245, 902. 36
<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		—	2, 696, 290. 89
应付赎回款		1, 034, 246. 11	748, 300. 68
应付管理人报酬		470, 804. 86	750, 773. 43
应付托管费		78, 467. 47	125, 128. 87
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6. 4. 7. 9	1, 343, 971. 86	1, 499, 129. 14
负债合计		2, 927, 490. 30	5, 819, 623. 01
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	84,195,651.88	96,516,196.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	310,176,517.67	450,910,082.53
净资产合计		394,372,169.55	547,426,279.35
负债和净资产总计		397,299,659.85	553,245,902.36

注： 1： 报告截止日 2022 年 6 月 30 日， 基金份额净值 4.684 元， 基金份额总额 84,195,651.88 份。

2:以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：中海消费主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-91,266,677.63	103,527,527.95
1. 利息收入		162,353.88	170,936.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	162,353.88	170,814.07
债券利息收入		-	122.09
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）		-111,953,798.98	121,237,848.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-115,227,603.70	120,019,716.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	67,237.60	147,885.55
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6. 4. 7. 19	3, 206, 567. 12	1, 070, 246. 59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 20	20, 386, 809. 82	-18, 203, 894. 89
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 21	137, 957. 65	322, 638. 30
<b>减: 二、营业总支出</b>		3, 776, 985. 52	6, 911, 198. 31
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 151, 730. 81	3, 743, 020. 98
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	525, 288. 44	623, 836. 86
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	—	—
4. 投资顾问费	6. 4. 10. 2. 1. 1	—	—
5. 利息支出		—	—
其中: 卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	—	—
7. 税金及附加		0. 18	0. 44
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	99, 966. 09	2, 544, 340. 03
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-95, 043, 663. 15	96, 616, 329. 64
<b>减: 所得税费用</b>		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-95, 043, 663. 15	96, 616, 329. 64
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		—	—
<b>六、综合收益总额</b>		-95, 043, 663. 15	96, 616, 329. 64

注: 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示: 2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 中海消费主题精选混合型证券投资基金

本报告期: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	

一、上期期末净资产(基金份额)	96,516,196.82	-	450,910,082.53	547,426,279.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金份额)	96,516,196.82	-	450,910,082.53	547,426,279.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,320,544.94	-	-140,733,564.86	-153,054,109.80
(一)、综合收益总额	-	-	-95,043,663.15	-95,043,663.15
(二)、本期基金份额交易产生的基金份额变动数(净值减少以“-”号填列)	-12,320,544.94	-	-45,689,901.71	-58,010,446.65
其中：1.基金申购款	12,651,949.38	-	48,304,575.78	60,956,525.16
2.基金赎回款	-24,972,494.32	-	-93,994,477.49	-118,966,971.81
(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)	84,195,651.88	-	310,176,517.67	394,372,169.55
项目 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日				
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	102,487,578.81	-	415,211,347.63	517,698,926.44
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)	102,487,578.81	-	415,211,347.63	517,698,926.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,646,339.36	-	73,402,270.16	68,755,930.80
(一)、综合收益总额	-	-	96,616,329.64	96,616,329.64

(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)	-4,646,339.36	-	-23,214,059.48	-27,860,398.84
其中:1. 基金申 购款	48,593,793.44	-	209,698,956.78	258,292,750.22
2 .基金赎 回款	-53,240,132.80	-	-232,913,016.26	-286,153,149.06
(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)	97,841,239.45	-	488,613,617.79	586,454,857.24

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:

曾杰

李俊

周琳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中海消费主题精选混合型证券投资基金(原名为中海消费主题精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1112号《关于核准中海消费主题精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,于2011年10月10日至2011年11月4日向社会公开募集。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336,478,373.07元,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2011]B105号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年11月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为336,549,461.88份基金份额,其中认购资金利息折合71,088.81份基金份额。本基金的基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,中海消费主题精选股票型证券投资基金于2015年8月5日公告后更名为中海消费主题精选混合型证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为:中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财

务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金在本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

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

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

阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/(损失) 的确认和计量

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

- (2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；  
 债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；  
 处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；
- (3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；
- (4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；
- (5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；
- (6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

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

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

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映

在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

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

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

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,620,158.79 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,934.79 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,630,093.58 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,163,969.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 523.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,164,492.80 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 339,544.98 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 152.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 339,697.78 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 536,340.22 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 536,340.22 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,611.39 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 9,934.79 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 523.80 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 152.80 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等

增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化

个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	29,154,209.31
等于： 本金	29,147,575.11
加： 应计利息	6,634.20
减： 坏账准备	—
定期存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—
减： 坏账准备	—
其中： 存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—
减： 坏账准备	—
合计	29,154,209.31

##### 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	331,326,641.53	—	353,885,809.44	22,559,167.91
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	331,326,641.53	-	353,885,809.44	22,559,167.91	

### 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

本基金在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

本基金在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

本基金在本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

本基金在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

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金在本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金在本报告期无债权投资，不需计提减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金在本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金在本报告期无其他债权投资，不需计提减值准备。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,774.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,165,335.29
其中：交易所市场	1,165,335.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	164,219.55
其他	11,642.25
合计	1,343,971.86

### 6.4.7.10 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
上年度末	96,516,196.82	96,516,196.82
本期申购	12,651,949.38	12,651,949.38
本期赎回(以“-”号填列)	-24,972,494.32	-24,972,494.32
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	84,195,651.88	84,195,651.88

### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金在本报告期末无其他综合收益。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

本期期初	336,870,083.64	114,039,998.89	450,910,082.53
本期利润	-115,430,472.97	20,386,809.82	-95,043,663.15
本期基金份额交易产生的变动数	-33,527,092.41	-12,162,809.30	-45,689,901.71
其中：基金申购款	35,735,091.89	12,569,483.89	48,304,575.78
基金赎回款	-69,262,184.30	-24,732,293.19	-93,994,477.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,912,518.26	122,263,999.41	310,176,517.67

#### 6.4.7.13 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	145,094.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,814.31
其他	2,445.56
合计	162,353.88

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-115,227,603.70
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	-115,227,603.70

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,292,621,896.97
减：卖出股票成本总额	1,404,085,699.79
减：交易费用	3,763,800.88
买卖股票差价收入	-115,227,603.70

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期无股票投资收益—证券出借差价收入。

### 6.4.7.15 债券投资收益

#### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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	56.35
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	67,181.25
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	67,237.60

#### 6.4.7.15.2 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	331,239.50
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	264,000.00
减: 应计利息总额	57.86
减: 交易费用	0.39
买卖债券差价收入	67,181.25

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

### 6.4.7.17 贵金属投资收益

#### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

### 6.4.7.18 衍生工具收益

#### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,206,567.12
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	3,206,567.12

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	20,386,809.82
股票投资	20,386,809.82
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	20,386,809.82

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	132,157.97
基金转换费收入	5,799.68
合计	137,957.65

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	5,746.54
合计	99,966.09

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日	成交金额	2021年1月1日至2021年6月30日	占当期股票成交总额的比例(%)
国联证券	127,522,699.33	5.08	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)	
国联证券	118,760.35	5.28	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)	
国联证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月	2021年1月1日至2021年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,151,730.81	3,743,020.98
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,384,245.03	1,615,525.98

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提, 计算方法如下:

$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$  ( $H$  为每日应支付的基金管理费,  $E$  为前一日的基金资产净值)

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付。

#### 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	525,288.44	623,836.86

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$  ( $H$  为每日应支付的基金托管费,  $E$  为前一日的基金资产净值)

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付。

#### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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
农业银行	29,154,209.31	145,094.01	39,445,860.84	156,615.24

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2022 半年度获得的利息收入为人民币 14,814.31 元(2021 半年度：人民币 11,205.45 元)，2022 年 6 月末结算备付金余额为人民币 1,300,561.75 元(2021 年 6 月末：人民币 1,274,218.62 元)。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期未发生利润分配。

#### 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
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	413	16,470.44	12,840.17	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	4,628	177,992.88	177,992.88	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	515	19,806.90	19,806.90	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	72.76	45.69	347	25,248.30	15,854.43	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	251	14,276.88	14,161.42	-

		日								
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	504	17,982.72	15,039.36	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	96.54	87.82	173	16,702.08	15,192.86	-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	48.55	31.38	623	30,245.20	19,549.74	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
688150	莱特光电	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688207	格灵深瞳	2022年3月9日	6个月	新股流通受限	39.49	26.38	5,803	229,160.47	153,083.14	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司基金信用债业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阀值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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

#### **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管理的托管户中，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市或在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

## 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具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、结算备付金及存出保证金等。

下表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予以分类。

#### 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
<b>资产</b>							
银行存款	29,154,209.31	-	-	-	-	-	29,154,209.31
结算备付金	1,300,561.75	-	-	-	-	-	1,300,561.75
存出保证金	266,637.40	-	-	-	-	-	266,637.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-353,885,809.44	353,885,809.44	
应收申购款	-	-	-	-	-	574,814.97	574,814.97
应收清算款	-	-	-	-	-	12,117,626.98	12,117,626.98
<b>资产总计</b>	<b>30,721,408.46</b>	-	-	-	-366,578,251.39	<b>397,299,659.85</b>	
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,034,246.11	1,034,246.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	470,804.86	470,804.86
应付托管费	-	-	-	-	-	78,467.47	78,467.47
其他负债	-	-	-	-	-	1,343,971.86	1,343,971.86
<b>负债总计</b>	<b>30,721,408.46</b>	-	-	-	-	<b>2,927,490.30</b>	<b>2,927,490.30</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>30,721,408.46</b>	-	-	-	-	<b>-363,650,761.09</b>	<b>394,372,169.55</b>
<b>上年度末 2021年12月31 日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							

银行存款	32,620,158.79	-	-	-	-	-	32,620,158.79
结算备付金	1,163,969.00	-	-	-	-	-	1,163,969.00
存出保证金	339,544.98	-	-	-	-	-	339,544.98
交易性金融资产		-	-	-	-	-517,444,745.83	517,444,745.83
应收证券清算款		-	-	-	-	-1,130,532.15	1,130,532.15
应收申购款		-	-	-	-	-536,340.22	536,340.22
其他资产		-	-	-	-	-10,611.39	10,611.39
资产总计	34,123,672.77	-	-	-	-	-519,122,229.59	553,245,902.36
负债							
应付证券清算款		-	-	-	-	-2,696,290.89	2,696,290.89
应付赎回款		-	-	-	-	-748,300.68	748,300.68
应付管理人报酬		-	-	-	-	-750,773.43	750,773.43
应付托管费		-	-	-	-	-125,128.87	125,128.87
其他负债		-	-	-	-	-1,499,129.14	1,499,129.14
负债总计		-	-	-	-	-5,819,623.01	5,819,623.01
利率敏感度缺口	34,123,672.77	-	-	-	-	-513,302,606.58	547,426,279.35

#### 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。		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
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	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日同），银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无

重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-35%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，现金或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 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	353,885,809.44	89.73	517,444,745.83	94.52
交易性金融资产 —基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 —贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	353,885,809.44	89.73	517,444,745.83	94.52

#### 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沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	+5%	19,212,149.63	18,592,597.34
	-5%	-19,212,149.63	-18,592,597.34

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。		
	根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。		
	以 95% 的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值 (不足 100 个交易日不予计算)。		
分析	风险价值 (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)
	收益率绝对 VaR (%)	2.82	3.25
	合计	-	-

注：上述分析衡量了在 95% 的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

## 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	353,299,692.32	515,466,022.55
第二层次	197,799.78	1,978,723.28
第三层次	388,317.34	-
合计	353,885,809.44	517,444,745.83

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## § 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	353,885,809.44	89.07
	其中：股票	353,885,809.44	89.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,454,771.06	7.67
8	其他各项资产	12,959,079.35	3.26
9	合计	397,299,659.85	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,689,656.00	0.68
B	采矿业	-	-
C	制造业	319,037,696.45	80.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,063,488.16	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	19,186,462.00	4.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	370,432.66	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,689,826.00	0.68
L	租赁和商务服务业	1,028,572.17	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	819,676.00	0.21
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	353,885,809.44	89.73

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	12,900	26,380,500.00	6.69
2	300896	爱美客	33,570	20,142,335.70	5.11
3	300268	佳沃食品	566,100	16,841,475.00	4.27
4	000519	中兵红箭	554,100	16,152,015.00	4.10
5	300750	宁德时代	30,100	16,073,400.00	4.08
6	603345	安井食品	95,400	16,014,798.00	4.06
7	002352	顺丰控股	284,500	15,877,945.00	4.03
8	002126	银轮股份	1,324,900	15,170,105.00	3.85
9	603043	广州酒家	582,100	14,680,562.00	3.72
10	301071	力量钻石	79,437	12,323,061.81	3.12
11	603055	台华新材	978,900	12,294,984.00	3.12
12	603908	牧高笛	128,900	12,264,835.00	3.11
13	603728	鸣志电器	536,600	11,392,018.00	2.89
14	688017	绿的谐波	94,083	11,195,877.00	2.84
15	002105	信隆健康	1,400,700	10,939,467.00	2.77
16	001215	千味央厨	191,600	10,785,164.00	2.73
17	002568	百润股份	339,300	10,192,572.00	2.58
18	600085	同仁堂	192,400	10,174,112.00	2.58
19	002271	东方雨虹	190,055	9,782,130.85	2.48
20	688007	光峰科技	352,896	8,575,372.80	2.17
21	002472	双环传动	255,700	8,141,488.00	2.06
22	000026	飞亚达	752,300	8,042,087.00	2.04
23	688800	瑞可达	62,805	7,932,899.55	2.01
24	688628	优利德	241,797	7,106,413.83	1.80
25	003021	兆威机电	129,100	6,167,107.00	1.56
26	001206	依依股份	123,200	4,084,080.00	1.04
27	000858	五粮液	15,000	3,028,950.00	0.77
28	600809	山西汾酒	8,300	2,695,840.00	0.68
29	000596	古井贡酒	10,500	2,621,430.00	0.66
30	002572	索菲亚	91,100	2,505,250.00	0.64

31	000568	泸州老窖	8,200	2,021,628.00	0.51
32	603816	顾家家居	32,890	1,862,560.70	0.47
33	600048	保利发展	103,100	1,800,126.00	0.46
34	002714	牧原股份	32,400	1,790,748.00	0.45
35	600298	安琪酵母	35,800	1,745,250.00	0.44
36	601111	中国国航	110,700	1,285,227.00	0.33
37	600009	上海机场	22,100	1,253,070.00	0.32
38	002372	伟星新材	45,100	1,084,204.00	0.27
39	600600	青岛啤酒	10,100	1,049,592.00	0.27
40	600138	中青旅	78,800	1,015,732.00	0.26
41	002507	涪陵榨菜	26,500	914,780.00	0.23
42	600975	新五丰	103,800	898,908.00	0.23
43	000002	万科 A	43,400	889,700.00	0.23
44	000729	燕京啤酒	92,100	889,686.00	0.23
45	002557	洽洽食品	15,500	882,415.00	0.22
46	002567	唐人神	96,700	822,917.00	0.21
47	603136	天目湖	28,600	819,676.00	0.21
48	601021	春秋航空	13,200	770,220.00	0.20
49	603027	千禾味业	33,600	581,280.00	0.15
50	002043	兔宝宝	49,949	579,408.40	0.15
51	603755	日辰股份	10,500	431,550.00	0.11
52	300390	天华超净	3,100	270,940.00	0.07
53	301139	元道通信	5,143	197,799.78	0.05
54	688207	格灵深瞳	5,803	153,083.14	0.04
55	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.03
56	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
57	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.01
58	301236	软通动力	623	19,549.74	0.00
59	301206	三元生物	347	15,854.43	0.00
60	301219	腾远钴业	173	15,192.86	0.00
61	301216	万凯新材	504	15,039.36	0.00
62	301207	华兰疫苗	251	14,161.42	0.00
63	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
64	301102	兆讯传媒	413	12,840.17	0.00
65	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
66	301237	和顺科技	261	10,925.46	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	600519	贵州茅台	27,931,288.00	5.10

2	603345	安井食品	25,360,134.68	4.63
3	002603	以岭药业	24,995,456.66	4.57
4	002271	东方雨虹	24,061,477.70	4.40
5	300896	爱美客	20,886,158.50	3.82
6	603737	三棵树	19,954,806.00	3.65
7	002352	顺丰控股	18,677,044.73	3.41
8	600048	保利发展	18,350,541.42	3.35
9	300268	佳沃食品	17,167,617.00	3.14
10	300413	芒果超媒	16,857,967.50	3.08
11	002036	联创电子	16,833,384.00	3.08
12	000519	中兵红箭	16,464,901.00	3.01
13	002567	唐人神	16,143,977.00	2.95
14	002714	牧原股份	15,765,202.00	2.88
15	600690	海尔智家	15,478,967.00	2.83
16	601689	拓普集团	15,345,735.36	2.80
17	300750	宁德时代	15,176,434.00	2.77
18	002594	比亚迪	15,012,410.26	2.74
19	002126	银轮股份	14,928,731.00	2.73
20	301071	力量钻石	14,308,191.23	2.61
21	000876	新希望	14,105,371.00	2.58
22	300094	国联水产	14,021,989.00	2.56
23	603043	广州酒家	13,602,861.02	2.48
24	000786	北新建材	13,478,744.10	2.46
25	000796	ST 凯撒	13,374,970.00	2.44
26	600138	中青旅	13,364,967.00	2.44
27	600096	云天化	13,151,821.00	2.40
28	002707	众信旅游	13,025,967.00	2.38
29	603055	台华新材	13,006,104.00	2.38
30	603908	牧高笛	12,964,447.00	2.37
31	603477	巨星农牧	12,954,538.00	2.37
32	002105	信隆健康	12,896,475.00	2.36
33	300498	温氏股份	12,539,206.90	2.29
34	600383	金地集团	12,308,762.00	2.25
35	603208	江山欧派	12,199,241.76	2.23
36	603363	傲农生物	11,993,140.50	2.19
37	002572	索菲亚	11,905,268.82	2.17
38	000521	长虹美菱	11,902,703.00	2.17
39	001979	招商蛇口	11,869,922.00	2.17
40	600336	澳柯玛	11,833,473.00	2.16
41	600115	中国东航	11,815,320.00	2.16
42	002457	青龙管业	11,772,483.00	2.15
43	603728	鸣志电器	11,728,683.00	2.14

44	605108	同庆楼	11,715,189.56	2.14
45	605567	春雪食品	11,693,967.00	2.14
46	002982	湘佳股份	11,690,960.00	2.14
47	603885	吉祥航空	11,463,912.87	2.09
48	600085	同仁堂	11,417,025.16	2.09
49	601021	春秋航空	11,375,298.00	2.08
50	002539	云图控股	11,238,187.76	2.05

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600597	XD 光明乳	27,296,302.07	4.99
2	002459	晶澳科技	25,919,195.00	4.73
3	001215	千味央厨	22,874,721.75	4.18
4	603806	福斯特	22,727,237.00	4.15
5	002043	兔 宝 宝	22,698,556.08	4.15
6	603288	海天味业	22,535,553.42	4.12
7	002372	伟星新材	21,722,664.20	3.97
8	600882	妙可蓝多	21,323,083.63	3.90
9	002594	比亚迪	20,488,506.12	3.74
10	601633	长城汽车	19,943,518.27	3.64
11	603816	顾家家居	19,510,610.00	3.56
12	300413	芒果超媒	19,160,645.90	3.50
13	603076	乐惠国际	18,080,500.40	3.30
14	002273	水晶光电	17,991,850.51	3.29
15	300274	阳光电源	17,785,426.00	3.25
16	688680	海优新材	17,781,706.67	3.25
17	300146	汤臣倍健	17,602,005.00	3.22
18	600048	保利发展	17,122,679.00	3.13
19	601012	隆基绿能	16,197,915.45	2.96
20	603606	东方电缆	16,148,808.08	2.95
21	000796	ST 凯撒	15,701,834.02	2.87
22	605089	味知香	15,233,823.00	2.78
23	002603	以岭药业	15,230,522.00	2.78
24	600522	中天科技	15,215,355.00	2.78
25	002475	立讯精密	15,146,321.80	2.77
26	600690	海尔智家	14,990,402.00	2.74
27	603737	三棵树	14,979,952.00	2.74
28	600096	云天化	14,601,786.00	2.67

29	002531	天顺风能	14,387,985.84	2.63
30	002271	东方雨虹	14,159,435.25	2.59
31	002703	浙江世宝	13,944,497.00	2.55
32	002707	众信旅游	13,605,576.00	2.49
33	601689	拓普集团	13,548,440.24	2.47
34	600336	澳柯玛	13,487,780.00	2.46
35	300973	立高食品	13,041,993.20	2.38
36	002567	唐人神	13,029,453.56	2.38
37	300094	国联水产	12,849,394.00	2.35
38	600138	中青旅	12,829,725.00	2.34
39	603136	天目湖	12,693,030.01	2.32
40	002714	牧原股份	12,304,212.00	2.25
41	000876	新希望	12,279,032.00	2.24
42	002036	联创电子	12,200,233.94	2.23
43	603345	安井食品	12,175,844.00	2.22
44	600383	金地集团	11,894,708.00	2.17
45	000786	北新建材	11,879,613.65	2.17
46	001979	招商蛇口	11,811,436.00	2.16
47	603363	傲农生物	11,681,296.00	2.13
48	600233	圆通速递	11,546,470.00	2.11
49	603208	江山欧派	11,463,345.67	2.09
50	002457	青龙管业	11,368,517.00	2.08
51	600054	黄山旅游	11,284,282.70	2.06
52	002468	申通快递	11,261,505.00	2.06
53	300498	温氏股份	11,157,854.64	2.04

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,220,139,953.58
卖出股票收入（成交）总额	1,292,621,896.97

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

**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**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**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**

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**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	266,637.40
2	应收清算款	12,117,626.98
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	574,814.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,959,079.35

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
55,100	1,528.05	1,230,945.02	1.46	82,964,706.86	98.54

### 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	26,577.30	0.0316

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年11月9日) 基金份额总额	336,549,461.88
本报告期期初基金份额总额	96,516,196.82
本报告期基金总申购份额	12,651,949.38
减：本报告期基金总赎回份额	24,972,494.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,195,651.88

注：报告期内基金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，本基金管理人于 2022 年 2 月 22 日发布公告，石枫女士担任本公司副总经理。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、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**

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

为本基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未改聘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、托管机构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 (%)	
民生证券	2	464,269,918. 53	18.50	432,377.65	19.23	-
招商证券	1	281,271,006. 94	11.21	261,950.96	11.65	-
东北证券	1	263,964,700. 34	10.52	193,037.97	8.59	-
东兴证券	1	256,078,405. 68	10.21	238,486.33	10.61	-
兴业证券	2	235,545,819. 28	9.39	190,203.74	8.46	-
华创证券	1	205,095,077. 99	8.17	191,002.05	8.50	-
国泰君安	1	186,049,486. 02	7.41	173,267.75	7.71	-
长江证券	1	163,432,625. 97	6.51	152,205.48	6.77	-

国信证券	1	149,838,344. 42	5.97	139,546.08	6.21	-
中信建投	1	144,099,830. 92	5.74	134,199.11	5.97	-
国联证券	1	127,522,699. 33	5.08	118,760.35	5.28	-
浙商证券	1	31,952,049.6 3	1.27	23,366.60	1.04	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风险管理部审核后确定租用交易单元。

2：本报告期内退租了川财证券的上海交易单元。  
3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

4：以上数据由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 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	成交金额	占当期债券回 购成交总额的	成交金额	占当期权证 成交总额的

		比例(%)		比例(%)		比例(%)
民生证券		-	-	-	-	-
招商证券		-	-	-	-	-
东北证券		-	-	-	-	-
东兴证券		-	-	-	-	-
兴业证券		-	-	-	-	-
华创证券	331,239.50	100.00		-	-	-
国泰君安		-	-	-	-	-
长江证券		-	-	-	-	-
国信证券		-	-	-	-	-
中信建投		-	-	-	-	-
国联证券		-	-	-	-	-
浙商证券		-	-	-	-	-
安信证券		-	-	-	-	-
渤海证券		-	-	-	-	-
川财证券		-	-	-	-	-
第一创业		-	-	-	-	-
方正证券		-	-	-	-	-
光大证券		-	-	-	-	-
国盛证券		-	-	-	-	-
华西证券		-	-	-	-	-
平安证券		-	-	-	-	-
申万宏源		-	-	-	-	-
西南证券		-	-	-	-	-
新时代		-	-	-	-	-
银河证券		-	-	-	-	-
中金公司		-	-	-	-	-
中泰证券		-	-	-	-	-

## 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	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	上证报	2022-1-4
2	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华林证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	上证报	2022-1-13

3	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022-1-24
4	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	上证报	2022-1-25
5	中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	上证报	2022-2-15
6	中海消费主题精选混合型证券投资基金产品资料概要更新	公司网站	2022-2-17
7	中海消费主题精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	公司网站	2022-2-17
8	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022-3-30
9	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022-4-22
10	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	上证报	2022-4-25
11	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	上证报	2022-4-26

## § 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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海消费主题精选股票型证券投资基金的文件
- 2、中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同
- 3、中海消费主题精选股票型证券投资基金托管协议
- 4、中海消费主题精选股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

## 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2022 年 8 月 27 日