

恒越核心精选混合型证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：恒越基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 14 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 恒越核心精选混合 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 006299 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 11 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,148,528,721.04 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，主要投资于具有核心竞争优势的上市公司股票和优质债券，追求长期稳健的资产增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济环境、国家经济周期、财政货币政策、证券市场流动性等因素综合分析的基础上，结合市场上各大类资产的估值水平及市场情绪的比较分析，评估各类别资产的风险收益特征，适度调整基金资产在股票、债券及现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>A 股市场和港股市场的优势行业具有差异性和互补性，本基金将充分挖掘资本市场互联互通资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金以企业基本面研究为核心，结合实地调研，重点考察上市公司的行业发展前景、行业地位、核心竞争力、持续盈利的能力、成长性、公</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>司治理结构等，综合运用市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、折现现金流法（DCF）等估值方法对上市公司的估值水平进行分析比较，自下而上精选具有核心竞争优势且估值合理的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>在保证资产流动性的基础上，通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等投资策略，在控制各类风险的基础上，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对市场利率、资产支持证券发行条款、支持资产的构成和质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素的综合分析，在严格控制风险的基础上进行投资，以获得稳定收益。</p> <p>6、可转换债券、可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券、可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金对可转换债券和可交换债券的选择主要通过结合其债性和股性兼具的特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的标的，以获取稳健的投资回报。</p> <p>7、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资主要从“自上而下”判断景气周期和“自下而上”精选标的两个角度出发，结合信用分析和信用评估，同时通过有纪律的风险监控实现对投资组合风险的有效管理。</p> <p>8、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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</p> |
|--|---|

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | <p>作，以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>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。</p> <p>9、权证投资策略</p> <p>本基金将通过权证标的证券进行深入研究的基础上，结合权证定价模型评估其合理价值，并充分考量可投权证品种的流动性等因素，在有效控制风险的前提下进行投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×55%+中证香港 100 指数收益率×20%+中债总全价指数收益率×25% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>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。</p> | |
| 基金管理人 | 恒越基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 恒越核心精选混合 A | 恒越核心精选混合 C |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 006299 | 007193 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 006299 | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 006313 | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,219,626,636.74 份 | 928,902,084.30 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 4 月 1 日 — 2022 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|------------------|
| | 恒越核心精选混合 A | 恒越核心精选混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -115,669,766.37 | -80,792,074.32 |
| 2. 本期利润 | 348,584,648.14 | 255,465,713.85 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2798 | 0.2847 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,023,498,950.68 | 2,301,176,156.35 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.4790 | 2.4773 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

恒越核心精选混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 12.93% | 1.85% | 4.72% | 1.04% | 8.21% | 0.81% |
| 过去六个月 | -11.42% | 1.86% | -5.64% | 1.14% | -5.78% | 0.72% |
| 过去一年 | -13.74% | 1.89% | -12.19% | 0.97% | -1.55% | 0.92% |
| 过去三年 | 139.56% | 1.70% | 7.61% | 0.91% | 131.95% | 0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 147.90% | 1.59% | 21.49% | 0.92% | 126.41% | 0.67% |

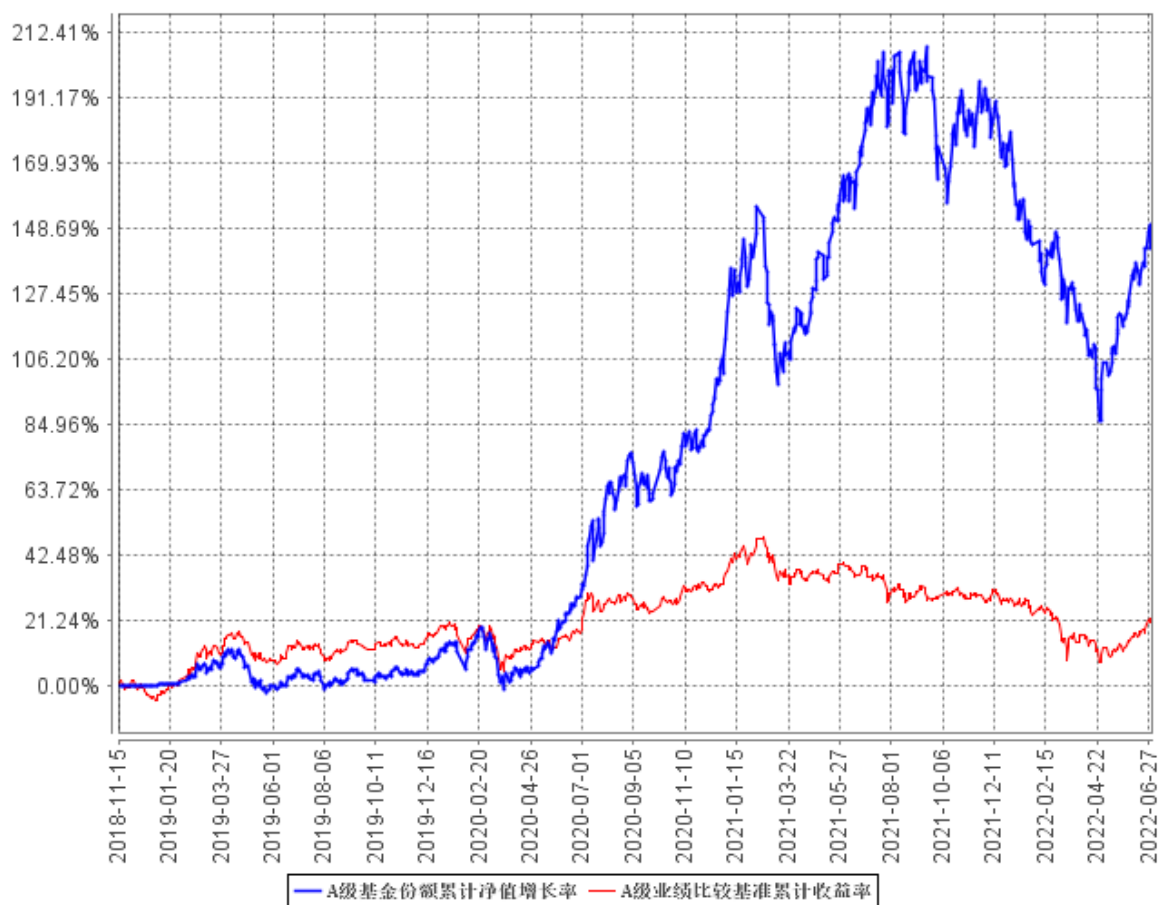
恒越核心精选混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 12.88% | 1.85% | 4.72% | 1.04% | 8.16% | 0.81% |
| 过去六个月 | -11.51% | 1.86% | -5.64% | 1.14% | -5.87% | 0.72% |
| 过去一年 | -13.90% | 1.89% | -12.19% | 0.97% | -1.71% | 0.92% |
| 过去三年 | 137.97% | 1.70% | 7.61% | 0.91% | 130.36% | 0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 120.89% | 1.68% | 3.51% | 0.92% | 117.38% | 0.76% |

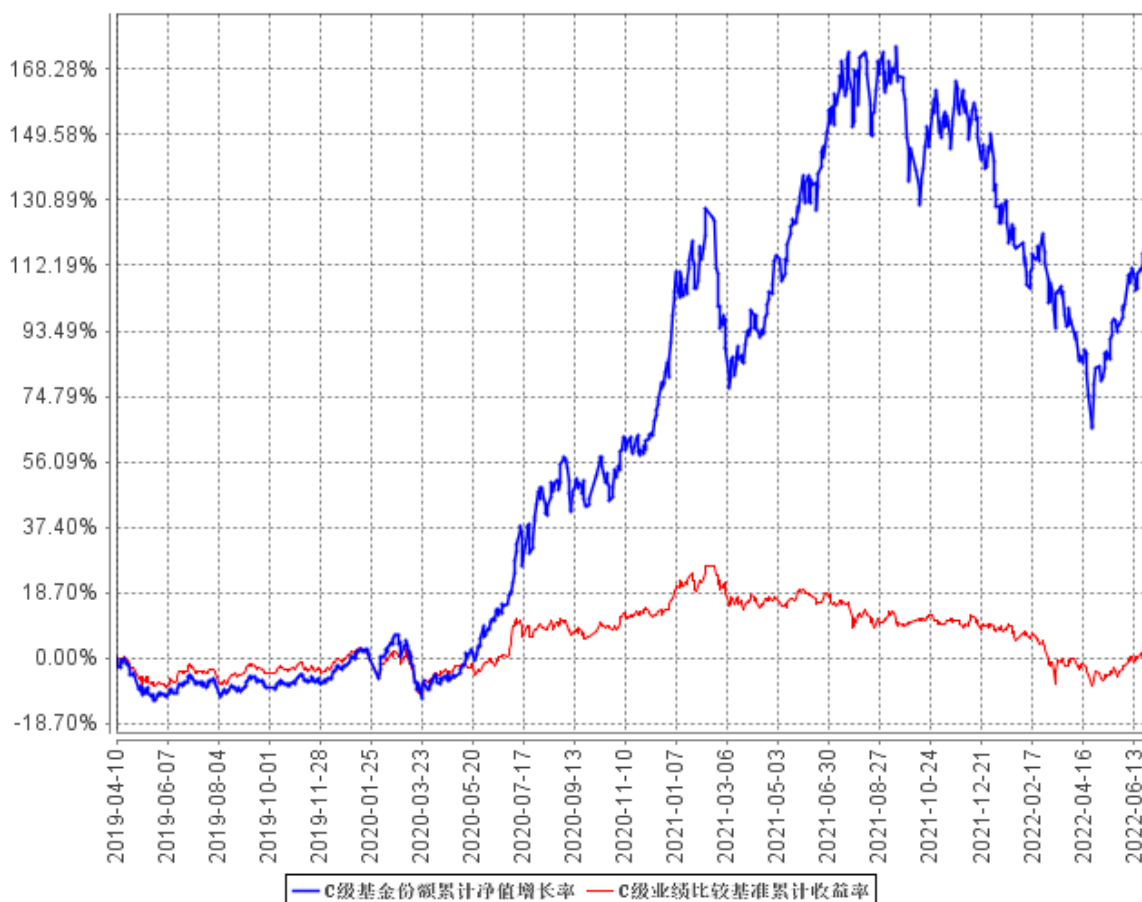
注：本基金基金合同于 2018 年 11 月 15 日生效，本基金自 2019 年 4 月 10 日起增设恒越核心精选混合 C 类基金份额，原基金份额转为恒越核心精选 A 类基金份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、A 级基金份额指 A 类基金份额，C 级基金份额指 C 类基金份额。

2、本基金基金合同于 2018 年 11 月 15 日生效，本基金自 2019 年 4 月 10 日起增设恒越核心精选混合 C 类基金份额，原基金份额转为恒越核心精选 A 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-------------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 高楠 | 投资副总监、权益投资部总监、本基金 | 2020 年 7 月 30 日 | - | 10 | 北京大学硕士研究生，中国国籍，具有基金从业资格。2012 年 7 月至 2017 年 7 月在平安资产管理有限责任公司工作。2017 年 7 月至 |

| | | | | |
|--|----------|--|--|---|
| | 基金经 理 | | | 2020年4月在国泰基金管理 有限公司工作，先后任投资 经理、国泰融安多策略灵活 配置混合型证券投资基金 基金经理（2017年11月24 日-2020年4月2日）。2020 年4月入职恒越基金管理有 限公司。 |
|--|----------|--|--|---|

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

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

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 公平交易专项说明

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。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

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，未发现本基金存在异常交易情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年二季度，国内经济受到新冠疫情反复、原料价格高企等因素影响，下行压力阶段性加剧，4月多个增长类指标出现负增。5、6月起经济进入修复通道但幅度较缓，分项上生产端恢复快于需求端，地产投资和居民消费修复较慢。政策积极发力稳定经济大盘，一方面在疫后推动复工复产，另一方面以积极财政和宽松货币政策进行逆周期调节。二季度资金面较为宽裕，资金利率持续位于政策利率之下，R007、DR007 均值分别为 1.9%、1.7%，新增社融同比多增。

海外方面，地缘政治冲突长期化加剧通胀压力，主要经济体加快货币紧缩步伐，但衰退风险也在上升。例如，美联储在 3 月首次加息 25bp 后，5 月、6 月分别加息 50bp 和 75bp，但美国 PMI、GDP 等增长指标正在出现衰退早期迹象。货币加快紧缩与衰退风险上升的背景下，全球风险资产多数调整，欧美股市大幅下跌，铜、铝等工业金属价格进入下跌趋势。

本基金的投资策略依然是以自下而上寻找优质成长股为主导，在满足确定性的前提下去评估企业成长空间以及合理长期市值空间。但客观上来说，追求中长期确定性较强的成长股这种自下而上选股的操作策略，并不是当下最有效率的方法。当下多种可测不可测的宏观变量，均会导致海内外基本面的预期在短期出现剧烈波动。这种波动通常是非线性的，是极端的，但真实世界的演变并不会像预期一般戏剧化波动，所以预期背离基本面的部分通常是以超跌或者超涨的快速且极端的形式来向真实世界收敛。自下而上的投资方法导致对于企业和产业的研究能更多的让人保持理性，但这种理性反倒可能使投资者在某个短期受到伤害。而我们理解的自上而下研究更类似于盲人摸象，大家都从自己擅长的角度去推测宏观的全貌，但却没人知道宏观全面的真实模样。所以历史上，看短期，股市对于宏观基本面的反馈，通常都是最容易形成的一致预期的自我实现，但这个预期的准度其实并不高。股市真正理性的可以映射经济事实，主要是中长期维度，通过错判后的不停修正（多个阶段的超涨超跌）来实现，即长期看理性层面较多，短期看非理性层面较多。

而投资的根本目的是寻找到有效，且可复制的方法。当前从可预见的几个季度的中期维度看，宏观扰动仍是主导股市的最主要矛盾，因此我们会在后续操作中增加自上而下因子的考量和市场潜在预期的分析，以此对纯粹的自下而上选股进行辅助。

二季度，市场波动较大受宏观系统性风险影响，以新能源为代表中期景气成长赛道的产业趋势并未改变，本基金底部增配估值调整到位的优质个股，挖掘受益于汽车促消费政策、防疫政策调整的投资机遇。此外，我们密切关注宏观环境变化，在经济探底企稳的过程中，寻找景气度预计见底回升的板块和个股进行布局，包括消费和制造业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末恒越核心精选混合 A 基金份额净值为 2.4790 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.93%；截至本报告期末恒越核心精选混合 C 基金份额净值为 2.4773 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.88%；同期业绩比较基准收益率为 4.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,931,675,000.12 | 92.35 |
| | 其中：股票 | 4,931,675,000.12 | 92.35 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 348,582.82 | 0.01 |
| | 其中：债券 | 348,582.82 | 0.01 |
| | 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 | 379,593,459.44 | 7.11 |
| 8 | 其他资产 | 28,471,154.26 | 0.53 |
| 9 | 合计 | 5,340,088,196.64 | 100.00 |

注：1、本基金通过港港股交易机制投资的港股公允价值为 67,763,625.00 元，占资产净值比例为 1.27%。

2、本基金报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 11,994,786.00 | 0.23 |
| B | 采矿业 | 223,497,432.00 | 4.20 |
| C | 制造业 | 4,171,775,893.01 | 78.35 |
| 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 | 21,401.16 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 227,065,378.69 | 4.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务 | 1,024,679.84 | 0.02 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| | 业 | | |
| J | 金融业 | 64,805,648.00 | 1.22 |
| K | 房地产业 | 23,016,287.70 | 0.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 27,668,750.78 | 0.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 192,727.31 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 312,944.13 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 112,535,446.50 | 2.11 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,863,911,375.12 | 91.35 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | - | - |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | 27,745,575.00 | 0.52 |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | 40,018,050.00 | 0.75 |
| 合计 | 67,763,625.00 | 1.27 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 605117 | 德业股份 | 1,330,590 | 372,418,835.10 | 6.99 |
| 2 | 002459 | 晶澳科技 | 4,703,718 | 371,123,350.20 | 6.97 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 2,388,803 | 298,122,614.40 | 5.60 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 1,078,140 | 265,804,635.60 | 4.99 |
| 5 | 600809 | 山西汾酒 | 719,035 | 233,542,568.00 | 4.39 |
| 6 | 600559 | 老白干酒 | 7,764,579 | 222,765,771.51 | 4.18 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 399,490 | 213,327,660.00 | 4.01 |
| 8 | 600026 | 中远海能 | 19,654,293 | 203,028,846.69 | 3.81 |
| 9 | 002738 | 中矿资源 | 2,134,720 | 197,696,419.20 | 3.71 |
| 10 | 002049 | 紫光国微 | 1,004,101 | 190,498,041.72 | 3.58 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 348,582.82 | 0.01 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 348,582.82 | 0.01 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1 | 127052 | 西子转债 | 3,000 | 348,582.82 | 0.01 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金不投资贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|-----------------|---------------|----------------|
| IC2207 | IC2207 | -92 | -118,396,640.00 | -5,123,560.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -5,123,560.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -38,289,060.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -5,123,560.00 |

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金不投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金不投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金不投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期内没有出现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、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 16,575,529.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利 | 227,039.50 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 11,668,585.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 28,471,154.26 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 127052 | 西子转债 | 348,582.82 | 0.01 |

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 恒越核心精选混合 A | 恒越核心精选混合 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,259,768,189.62 | 902,045,587.24 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 101,235,475.11 | 180,482,066.77 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 141,377,027.99 | 153,625,569.71 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,219,626,636.74 | 928,902,084.30 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 6,772,966.49 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 6,772,966.49 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.32 |

注：本期内基金管理人持有恒越核心精选 C 类份额（007193），以上占“基金总份额比例”为占恒

越核心精选 A 类和 C 类总份额的比例。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|--------------|---------------|-------|
| 1 | 转换转入 | 2022年5月23日 | 6,772,966.49 | 14,955,387.30 | 0.00% |
| 合计 | | | 6,772,966.49 | 14,955,387.30 | |

注：C 类份额不收取申购费。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《恒越核心精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《恒越核心精选混合型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、报告期内恒越核心精选混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 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：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号资产托管部。

9.3 查阅方式

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

恒越基金管理有限公司

2022 年 7 月 21 日