

睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:睿远基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62
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	62
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	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	睿远均衡价值三年持有混合	
基金主代码	008969	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年02月21日	
基金管理人	睿远基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,895,975,488.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	睿远均衡价值三年持有混合A	睿远均衡价值三年持有混合C
下属分级基金的交易代码	008969	008970
报告期末下属分级基金的份额总额	9,697,844,575.26份	1,198,130,913.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，通过对宏观经济趋势、市场环境、财政政策、货币政策、行业周期阶段等的评估分析，研判国内经济发展形势，在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中各类资产的配置比例，从而实现本基金长期、持续、稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则

	等差异带来的特有风险。
--	-------------

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		睿远基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李雁飞	张燕
	联系电话	021-38173200	0755-83199084
	电子邮箱	liyf@foresightfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009201000	95555
传真		021-38173001	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区临潼路170号608室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1155号42-43层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		201204	518040
法定代表人		陈光明	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.foresightfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区芳甸路1155号42-43层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	睿远基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼42楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	睿远均衡价值三年 持有混合A	睿远均衡价值三年 持有混合C
本期已实现收益	-1,231,209,866.25	-151,250,372.12
本期利润	-1,348,449,385.68	-158,206,942.63
加权平均基金份额本期利润	-0.1430	-0.1383
本期加权平均净值利润率	-10.09%	-9.82%
本期基金份额净值增长率	-9.26%	-9.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	2,966,503,653.57	353,763,277.16
期末可供分配基金份额利润	0.3059	0.2953
期末基金资产净值	14,635,011,163.65	1,795,428,566.41
期末基金份额净值	1.5091	1.4985
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	50.91%	49.85%

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。

2、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：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

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

睿远均衡价值三年持有混合A

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	11.21%	1.41%	6.36%	0.87%	4.85%	0.54%
过去三个月	13.00%	1.71%	5.16%	1.10%	7.84%	0.61%
过去六个月	-9.26%	1.83%	-5.99%	1.20%	-3.27%	0.63%
过去一年	-13.77%	1.45%	-12.28%	1.02%	-1.49%	0.43%
自基金合同 生效起至今	50.91%	1.31%	4.75%	1.02%	46.16%	0.29%

睿远均衡价值三年持有混合C

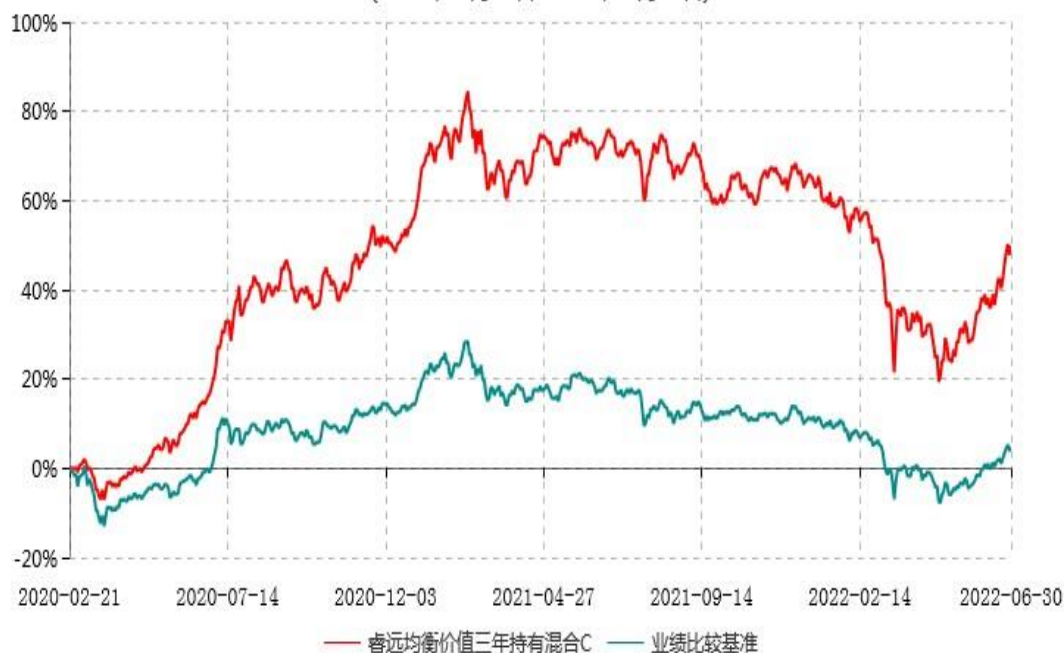
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	11.17%	1.41%	6.36%	0.87%	4.81%	0.54%
过去三个月	12.91%	1.71%	5.16%	1.10%	7.75%	0.61%
过去六个月	-9.40%	1.83%	-5.99%	1.20%	-3.41%	0.63%
过去一年	-14.03%	1.45%	-12.28%	1.02%	-1.75%	0.43%
自基金合同 生效起至今	49.85%	1.31%	4.75%	1.02%	45.10%	0.29%

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

睿远均衡价值三年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年02月21日-2022年06月30日)



睿远均衡价值三年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年02月21日-2022年06月30日)



本基金建仓期为本基金的《基金合同》生效之日（2020年2月21日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

睿远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]1682号文批准，于2018年10月29日取得营业执照正式成立，并于2018年11月19日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司注册地上海，注册资本一亿元人民币。公司致力于成为领先的长期价值投资机构，追求持有人长期利益最大化。截至2022年6月30日，公司共管理三只公募基金，即睿远成长价值混合型证券投资基金、睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金、睿远稳进配置两年持有期混合型证券投资基金。

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		
赵枫	本基金基金经理	2020-02-21	-	23年	赵枫先生，毕业于中国人民大学、哥伦比亚大学，硕士研究生学历。历任上海中技投资顾问有限公司研究员，鹏华基金管理有限公司研究员、基金经理助理，融通基金管理有限公司基金经理。2005年参与筹建交银施罗德基金管理有限公司，并任基金经理、投资副总监、专户投资总监等职。2014年，参与筹建兴聚投资管理有限公司，并任副总经理，投资经理。2019年11月加入

					睿远基金管理有限公司。2020年2月至今任睿远均衡价值三年持有期混合型基金经理。
艾菁	本基金基金经理助理	2020-04-21	-	15年	艾菁女士，毕业于加拿大卡尔顿大学，硕士研究生学历。历任交银施罗德基金管理有限公司研究员，上海兴聚投资有限公司研究员。2019年7月加入睿远基金管理有限公司，2020年4月至今任睿远均衡价值三年持有期混合型基金经理助理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金基金经理仅担任本基金的基金经理，未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《睿远基金管理有限公司公平交易管理办法》，通过制度确保不同投资组

合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池、交易对手库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、事后分析评估、监察稽核和信息披露等手段确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和《睿远基金管理有限公司公平交易管理办法》，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本管理人未发生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超过该证券当日成交量的5%的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

在2022年上半年，A股市场受疫情和海外市场的影响呈现了先抑后扬的走势，4月底上证综指年内跌幅一度接近22%，后来随着疫情缓解出现大幅回升，半年度指数下跌6.7%。虽然市场在二季度明显回升，但上半年市场表现却更加分化。按中信证券一级行业指数，上半年表现最好的煤炭行业和最差的电子行业回报相差了约57个百分点，不同行业间半年度回报率方差达到11个百分点。上半年行业配置对组合收益率水平影响很大，过去一年多来上游盈利大幅增长，其中煤炭行业盈利改善最为明显，中下游受到成本上升和需求增长放缓的双重压力，盈利表现不佳，盈利和估值的双重影响拉大了行业间回报差距。自基金成立以来，我们一直采用均衡配置、自下而上的方法架构组合，综合考量行业增长、企业竞争力和估值等方面进行个股选择，因此在行业配置上会比较分散。这种方法在宏观经济稳定增长时，在均值回归力量的作用下，组合的风险和回报会有一个比较好的平衡，长短期回报也会比较稳定。但是过去两年多来，伴随国内经济增长放缓和行业规制措施增多、中美竞争加剧、国外地缘政治局势动荡、新老能源接替等多重因素的影响，宏观经济和行业基本面波动加大，均值回归的趋势受到较大的干扰，

导致投资者更加集中投资于少数景气度良好行业，大部分行业则因业绩乏善可陈而持续表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末睿远均衡价值三年持有混合A基金份额净值为1.5091元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.26%，同期业绩比较基准收益率为-5.99%；截至报告期末睿远均衡价值三年持有混合C基金份额净值为1.4985元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.40%，同期业绩比较基准收益率为-5.99%。

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，组合投资仍然面临基本面因素的困扰。散发疫情减弱了经济活动，房地产行业的快速调整对整个产业链造成较大的冲击，海外控制通胀会带来外需的收缩，宏观基本面展望仍然较为疲弱。经过两年多的结构分化，估值差异在不同成长预期的行业中表现明显，如果景气行业不能通过超预期增长进一步提升估值，其回报水平已经大幅下降；大部分景气度不佳的行业虽然估值已处于历史较低分位，但如果需求短期难见起色，投资者需要更长的时间等待盈利和估值的回升。当然市场整体估值处于历史较低分位值，对未来盈利疲弱的预期已经一定程度得到反映。今年以来货币环境一直比较宽松，居民存款水平大幅上升，居民财富缺乏配置方向。综合来看，虽然目前看下半年缺乏趋势性的投资机会，但市场出现系统性风险的概率也较低，下半年A股市场很可能是一个指数振荡、个股活跃的态势，组合想要获取超额收益存在较大的挑战。

过去几年来，A股市场的有效性大幅提升，研究能力提升、公司信息披露更加透明和投资者更加价值理性是主要的原因。另一方面，先进的信息技术和管理技术越来越快为企业所采用，企业构建竞争壁垒的要素也在随之发展变化，在某一方面的领先很难形成持续的竞争优势，未来企业的竞争力更多体现在无短板的综合能力上，通过在产能、研发、技术、市场、渠道、管理、组织和企业文化等方面持续投入获取在成本、品质和品牌等方面的竞争优势。这给投资者未来获取超额收益带来了更大的难度，尤其考验投资者对公司和行业理解的深度，需要投资者通过提高在更长周期内的决策准确性去战胜市场。对我们而言，没有一招致胜的绝招，要巩固优势，也要不断学习和进化，不断适应新的社会变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公

司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员包括常设委员和临时列席参会人员。常设委员包括下列成员：投资、研究、会计和风控等岗位资深人员；临时参会人员包括投资经理及其他内外部人员。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式为现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	76,707,285.63	59,022,941.88
结算备付金		301,057.78	1,012.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	15,821,588,780.13	16,419,664,735.55
其中：股票投资		15,037,579,495.48	15,537,208,679.08
基金投资		-	-
债券投资		784,009,284.65	882,456,056.47
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	450,000,000.00	406,000,146.50
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		100,012,120.00	-
应收股利		33,558,207.91	229,529.29
应收申购款		4,370,712.80	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	14,550,690.21
资产总计		16,486,538,164.25	16,899,469,055.79
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		34,873,699.98	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,832,252.18	21,412,461.44
应付托管费		1,883,225.21	2,141,246.15
应付销售服务费		410,491.90	453,157.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		165.67	102.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	98,599.25	196,321.50
负债合计		56,098,434.19	24,203,289.20
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	10,895,975,488.78	10,153,073,407.56
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	5,534,464,241.28	6,722,192,359.03
净资产合计		16,430,439,730.06	16,875,265,766.59
负债和净资产总计		16,486,538,164.25	16,899,469,055.79

注:1、报告截止日2022年6月30日, 睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金A份额净值1.5091元, 基金份额9,697,844,575.26份; 睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金C份额净值1.4985元, 基金份额1,198,130,913.52份。

2、以下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: 睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金

本报告期: 2022年01月01日至2022年06月30日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-1,381,369,518.29	1,337,270,131.22
1. 利息收入		3,940,127.68	22,735,286.94
其中: 存款利息收入	6.4.7.10	885,317.65	901,159.01
债券利息收入		-	10,549,134.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,054,810.03	11,284,993.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-1,261,113,556.03	2,049,304,540.00
其中: 股票投资收益	6.4.7.11	-1,457,443,673.43	1,923,725,936.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	15,430,711.61	29,557,042.56

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	180,899,405.79	96,021,560.69
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-124,196,089.94	-734,769,695.72
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		125,286,810.02	160,866,029.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	111,616,615.21	116,115,237.62
2. 托管费	6.4.10.2. 2	11,161,661.55	11,611,523.72
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	2,400,484.21	2,289,766.52
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		80.13	98.57
8. 其他费用	6.4.7.20	107,968.92	30,849,402.94
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,506,656,328.3 1	1,176,404,101.85
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,506,656,328.31	1,176,404,101.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,506,656,328.31	1,176,404,101.85

注：以下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：睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06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）	10,153,073,407.56	-	6,722,192,359.03	16,875,265,766.59
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）	10,153,073,407.56	-	6,722,192,359.03	16,875,265,766.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	742,902,081.22	-	-1,187,728,117.75	-444,826,036.53
（一）、综合收益总额	-	-	-1,506,656,328.31	-1,506,656,328.31
（二）、本期基金份	742,902,081.	-	318,928,210.	1,061,830,29

额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	22		56	1.78
其中: 1. 基金申购款	742,902,081. 22	-	318,928,210. 56	1,061,830,29 1.78
2. 基金赎回 款	-	-	-	-
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	10,895,975,4 88.78	-	5,534,464,24 1.28	16,430,439,7 30.06
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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)	8,499,337,66 5.98	-	5,229,916,84 5.37	13,729,254,5 11.35
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	8,499,337,66 5.98	-	5,229,916,84 5.37	13,729,254,5 11.35
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	1,086,867,38 9.88	-	1,953,045,41 9.78	3,039,912,80 9.66
(一)、综合收益总 额	-	-	1,176,404,10 1.85	1,176,404,10 1.85

(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)	1,086,867,38 9.88	-	776,641,317. 93	1,863,508,70 7.81
其中: 1. 基金申购款	1,086,867,38 9.88	-	776,641,317. 93	1,863,508,70 7.81
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	9,586,205,05 5.86	-	7,182,962,26 5.15	16,769,167,3 21.01

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:

陈光明

许志雄

廉洪舰

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

睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由睿远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2020]101号文《关于准予睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金(注册的批复)核准。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为5,964,534,263.20份,于2020年2月18日首发并募集结束。经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具上会师报字(2020)第0324号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年2月

21日生效。本基金的基金管理人与注册登记机构均为睿远基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+上证国债指数收益率×20%。

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颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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2022年1月1日至2022年6月30日止期间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，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

① 债务工具

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

a) 以摊余成本计量：

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

b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

② 权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

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，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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；

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。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，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，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），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

根据财政部发布的《企业会计准则第22号-金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保

险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0.00元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，金额分别为人民币59,022,941.88元、人民币1012.36元、人民币0元、人民币406000146.50元、人民币14550690.21元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息。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，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息的金额分别为人民币59,057,655.27元、人民币1,012.80元、人民币0元、人民币405,834,835.95元、人民币0元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币16,419,664,735.55元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币14681286.93元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币16,434,346,022.48元。

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

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金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06月30日
活期存款	3,839,652.52

等于：本金	3,838,117.68
加：应计利息	1,534.84
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	72,867,633.11
等于：本金	72,823,565.90
加：应计利息	44,067.21
减：坏账准备	-
合计	76,707,285.63

注：其他存款为券商保证金

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		14,140,436.93 6.34	-	15,037,579.49 5.48	897,142,559.1 4
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,243,317.76	18,034.63	13,370,717.53	2,109,365.14
	银行间市场	761,066,170.0 0	10,452,567.12	770,638,567.1 2	-880,170.00
	合计	772,309,487.7 6	10,470,601.75	784,009,284.6 5	1,229,195.14

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,912,746,424.10	10,470,601.75	15,821,588,780.13	898,371,754.28

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

注:本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 2022年06月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	450,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	450,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注:本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	1,900.00

其中：交易所市场	—
银行间市场	1,900.00
应付利息	—
预提费用-审计费	37,191.88
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	98,599.25

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 睿远均衡价值三年持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (睿远均衡价值三年持有混合 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,071,671,990.98	9,071,671,990.98
本期申购	626,172,584.28	626,172,584.28
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	9,697,844,575.26	9,697,844,575.26

6.4.7.7.2 睿远均衡价值三年持有混合C

金额单位：人民币元

项目 (睿远均衡价值三年持有混合 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,081,401,416.58	1,081,401,416.58
本期申购	116,729,496.94	116,729,496.94
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	1,198,130,913.52	1,198,130,913.52

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

6.4.7.9.1 睿远均衡价值三年持有混合A

单位：人民币元

项目 (睿远均衡价值三年持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,949,902,428.90	2,065,197,091.61	6,015,099,520.51
本期利润	-1,231,209,866.25	-117,239,519.43	-1,348,449,385.68
本期基金份额交易产生的变动数	247,811,090.92	22,705,362.64	270,516,453.56
其中：基金申购款	247,811,090.92	22,705,362.64	270,516,453.56
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,966,503,653.57	1,970,662,934.82	4,937,166,588.39

6.4.7.9.2 睿远均衡价值三年持有混合C

单位：人民币元

项目 (睿远均衡价值三年持有混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	460,736,275.01	246,356,563.51	707,092,838.52
本期利润	-151,250,372.12	-6,956,570.51	-158,206,942.63
本期基金份额交易产生的变动数	44,277,374.27	4,134,382.73	48,411,757.00
其中：基金申购款	44,277,374.27	4,134,382.73	48,411,757.00
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	353,763,277.16	243,534,375.73	597,297,652.89

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	68,315.95
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	516,956.72
结算备付金利息收入	300,044.98
其他	—
合计	885,317.65

注：其中“其他存款利息收入”为保证金利息收入。

6.4.7.11 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01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	7,235,558,689.43
减：卖出股票成本总额	8,668,717,676.17
减：交易费用	24,284,686.69
买卖股票差价收入	-1,457,443,673.43

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	10,663,360.02
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,767,351.59
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	15,430,711.61

6.4.7.12.2 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01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	641,452,028.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	619,554,648.34
减：应计利息总额	17,127,956.06
减：交易费用	2,072.14
买卖债券差价收入	4,767,351.59

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	180,899,405.79

基金投资产生的股利收益	—
合计	180,899,405.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-124,196,089.94
——股票投资	-123,939,195.65
——债券投资	-256,894.29
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-124,196,089.94

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37

汇划手续费	2,269.67
账户维护费	9,000.00
合计	107,968.92

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债后事项。

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害的关联方变化情况。

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
睿远基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期未发生应付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	111,616,615.21	116,115,237.62
其中：支付销售机构的客户维护费	43,190,576.75	46,251,988.86

注：本基金的管理费按前一日资产净值1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,161,661.55	11,611,523.72

注：本基金的托管费按前一日资产净值0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	睿远均衡价值三年持有混 合A	睿远均衡价值三年持有混 合C	合计
招商银行 股份有限公司	0.00	277,643.63	277,643.63
睿远基金 管理有限公司	0.00	1,024,543.23	1,024,543.23
合计	0.00	1,302,186.86	1,302,186.86
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	睿远均衡价值三年持有混 合A	睿远均衡价值三年持有混 合C	合计
招商银行 股份有限公司	0.00	255,718.87	255,718.87
睿远基金 管理有限公司	0.00	866,796.67	866,796.67
合计	0.00	1,122,515.54	1,122,515.54

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

注：本基金本报告期未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

睿远均衡价值三年持有混合A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	55,647,031.50	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	55,647,031.50	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.57%	0.00%

睿远均衡价值三年持有混合C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

6.4.10.4.2 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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	3,839,652.52	68,315.95	3,554,761.72	72,851.59

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金报告期末未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06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
002064	华峰化学	2022-03-28	6个月	非公开发行锁定	8.51	8.14	35,252,679	300,000,298.29	286,956,807.06	-
600941	中国移动	2021-12-24	6个月	新股锁定	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
600938	中国海油	2022-04-	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.	1,332,30	-

		14						20	3.44	
688207	格灵深瞳	2022-03-09	6个月	科创板打新限售	39.49	26.38	13,391	528,810.59	353,254.58	-
688045	必易微	2022-05-19	6个月	科创板打新限售	55.15	61.98	3,939	217,235.85	244,139.22	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板打新限售	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	创业板打新限售	72.83	45.69	1,106	80,554.10	50,533.14	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	109.18	82.76	403	43,997.64	33,352.28	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板打新限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-	6个月	创业板打	38.46	38.46	566	21,768.3	21,768.3	-

		30		新限售				6	6	
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板打新限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	创业板打新限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	23.19	16.14	920	21,338.53	14,848.80	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-

3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个月	创业 板打 新限 售	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-
3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个月	创业 板打 新限 售	22.4 9	27.4 2	327	7,35 4.23	8,96 6.34	-
3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	6个月	创业 板打 新限 售	22.5 5	37.7 0	237	5,34 4.35	8,93 4.90	-
3011 35	瑞德 智能	2022 -04- 01	6个月	创业 板打 新限 售	31.9 8	26.2 6	338	10,8 09.2 4	8,87 5.88	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	6个月	创业 板打 新限 售	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	-
3011 58	德石 股份	2022 -01- 07	6个月	创业 板打 新限 售	15.6 4	20.3 8	379	5,92 7.56	7,72 4.02	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个月	创业 板打 新限 售	20.0 8	20.3 4	373	7,48 9.84	7,58 6.82	-
3012 79	金道 科技	2022 -04- 06	6个月	创业 板打 新限 售	31.2 0	22.8 1	296	9,23 5.20	6,75 1.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌流通受限股票。

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

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了“董事会及其下设风险控制委员会-经营层及其下设风险管理委员会-风险管理部-各业务部门及一线合规风控人员”的四级风险管理的职责架构。董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，并对公司风险管理的有效性承担最终责任；公司经营管理层负责领导经营管理中风险管理工作的落实；部门层面设置了风险管理部作为独立的风险管理部门，全面推动风险管理工作，监测、评估、报告公司的整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；其他各部门及一线合规风控人员对其业务中涉及的风险管理负直接责任，直接参与相关业务的风险管理工作。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了“董事会及其下设风险控制委员会-经营层及其下设风险管理委员会-风险管理部-各业务部门及一线合规风控人员”的四级风险管理的职责架构。董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，并对公司风险管理的有效性承担最终责任；公司经营管理层负责领导经营管理中风险管理工作的落实；部门层面设置了风险管理部作为独立的风险管理部门，全面推动风险管理工作，监测、评估、报告公司的整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；其他各部门及一线合规风控人员对其业务中涉及的风险管理负直接责任，直接参与相关业务的风险管理工作。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	182,942,098.63	420,100,000.00
合计	182,942,098.63	420,100,000.00

注：未评级债券为国债或政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	13,370,717.53	-
未评级	587,696,468.49	462,356,056.47

合计	601,067,186.02	462,356,056.47
----	----------------	----------------

注：未评级债券为国债或政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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于开放日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于每个开放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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部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该比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式 借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。 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。

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会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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为利率债、银行存款、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年	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
---------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

06 月 30 日							
资产							
银行存款	76,707,285.63	-	-	-	-	-	76,707,285.63
结算备付金	37.90	-	-	-	-	301,019.88	301,057.78
交易性金融资产	135,060,704.11	-	635,577,863.01	1,913,304.66	11,457,412.87	15,037,579,495.48	15,821,588,780.13
买入返售金融资产	450,000,000.00	-	-	-	-	-	450,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	100,012,120.00	100,012,120.00
应收股利	-	-	-	-	-	33,558,207.91	33,558,207.91
应收申购款	-	-	-	-	-	4,370,712.80	4,370,712.80
资产总计	661,768,027.64	-	635,577,863.01	1,913,304.66	11,457,412.87	15,175,821,556.07	16,486,538,164.25
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	34,873,699.98	34,873,699.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,832,252.18	18,832,252.18
应付托管费	-	-	-	-	-	1,883,225.21	1,883,225.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	410,491.90	410,491.90
应交税费	-	-	-	-	-	165.67	165.67
其他负债	-	-	-	-	-	98,599.25	98,599.25
负债总计	-	-	-	-	-	56,098,434.19	56,098,434.19
利率敏感度缺口	661,768,027.64	-	635,577,863.01	1,913,304.66	11,457,412.87	15,119,723,121.88	16,430,439,730.06
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	59,022,941.88	-	-	-	-	-	59,022,941.88
结算备付金	-	-	-	-	-	1,012.36	1,012.36
交易性	150,045,000.	-	672,576,000.	1,964,298.	57,870,758.	15,537,208,679.	16,419,664,735.

金融资产	00		00	20	27	08	55
买入返售金融资产	406,000,146.50	-	-	-	-	-	406,000,146.50
应收利息	-	-	-	-	-	14,550,690.21	14,550,690.21
应收股利	-	-	-	-	-	229,529.29	229,529.29
资产总计	615,068,088.38	-	672,576,000.00	1,964,298.20	57,870,758.27	15,551,989,910.94	16,899,469,055.79
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,412,461.44	21,412,461.44
应付托管费	-	-	-	-	-	2,141,246.15	2,141,246.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	453,157.34	453,157.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,321.50	1,321.50
应交税费	-	-	-	-	-	102.77	102.77
其他负债	-	-	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	24,203,289.20	24,203,289.20
利率敏感度缺口	615,068,088.38	-	672,576,000.00	1,964,298.20	57,870,758.27	15,527,786,621.74	16,875,265,766.59

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降100个基点	4,596,467.41	7,170,008.41
	市场利率上升100个基点	-4,501,894.57	-6,892,811.31

注：1、上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于2020年2月21日生效。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	6,342,415.15 6.00	-	6,342,415.15 6.00
应收股利	-	33,558,207.91	-	33,558,207.91
资产合计	-	6,375,973.36 3.91	-	6,375,973.36 3.91
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	6,375,973.36 3.91	-	6,375,973.36 3.91
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	6,661,935.27 8.00	-	6,661,935.27 8.00
应收股利	-	229,529.29	-	229,529.29
资产合计	-	6,662,164.80 7.29	-	6,662,164.80 7.29

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口		6,662,164,80		6,662,164,80
净额	-	7.29	-	7.29

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	港币相对人民币升值5%	317,054,983.20	333,108,240.36
	港币相对人民币贬值5%	-317,054,983.20	-333,108,240.36

注：本基金合同于2020年2月21日生效。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

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06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	15,037,579,495.48	91.52	15,537,208,679.08	92.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资	784,009,284.65	4.77	882,456,056.47	5.23

产—债券投资				
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	15,821,588,780.13	96.29	16,419,664,735.55	97.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,306,466,073.81	929,658,154.60
	业绩比较基准下降5%	-1,306,466,073.81	-929,658,154.60

注：1、本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于2020年2月21日生效。

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	14,756,204,878.62	15,235,472,364.78
第二层次	770,855,904.58	876,884,609.65
第三层次	294,527,996.93	307,307,761.12
合计	15,821,588,780.13	16,419,664,735.55

根据《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>》的要求，本基金期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本基金对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

6.4.14.2 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

注：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

注：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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	15,037,579,495.48	91.21
	其中：股票	15,037,579,495.48	91.21
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	784,009,284.65	4.76
	其中：债券	784,009,284.65	4.76
	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	450,000,000.00	2.73
	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	77,008,343.41	0.47
8	其他各项资产	137,941,040.71	0.84
9	合计	16,486,538,164.25	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人民币6,342,415,156.00元，占期末基金资产净值比例为38.60%。

2、其他各项资产包括且不限于应收股利、应收申购款、应收证券清算款等。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,332,303.44	0.01
C	制造业	6,837,980,527.77	41.62
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,096,729.68	0.04

J	金融业	917,347,704.67	5.58
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	104,838,459.78	0.64
M	科学研究和技术服务业	234,428,227.84	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	593,124,152.16	3.61
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	8,695,164,339.48	52.92

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	240,300,000.00	1.46
非日常生活消费品	1,963,394,226.00	11.95
日常消费品	630,492,230.00	3.84
能源	105,200,000.00	0.64
金融	191,620,000.00	1.17
医疗保健	493,229,700.00	3.00
工业	32,085,000.00	0.20
信息技术	322,671,000.00	1.96
通讯业务	1,277,950,000.00	7.78
房地产	1,085,473,000.00	6.61
合计	6,342,415,156.00	38.60

注： 以上分类采用全球行业分类标准

(Global Industry Classification Standard, 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	00941	中国移动	30,500,000	1,277,950,000.00	7.78
1	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.03
2	06098	碧桂园服务	35,200,000	1,052,128,000.00	6.40
3	002271	东方雨虹	18,499,870	952,188,308.90	5.80
4	600309	万华化学	9,793,930	949,913,270.70	5.78
5	03690	美团-W	4,728,500	785,309,280.00	4.78
6	300298	三诺生物	26,649,357	748,846,931.70	4.56
7	300750	宁德时代	1,399,667	747,422,178.00	4.55
8	00175	吉利汽车	43,487,000	663,611,620.00	4.04
9	603568	伟明环保	17,773,728	593,109,303.36	3.61
10	300059	东方财富	22,299,613	566,410,170.20	3.45
11	002028	思源电气	15,694,759	559,675,105.94	3.41
12	00291	华润啤酒	9,346,000	467,580,380.00	2.85
13	600031	三一重工	19,000,000	362,140,000.00	2.20
14	002142	宁波银行	9,799,987	350,937,534.47	2.14
15	02382	舜宇光学科技	2,950,000	322,671,000.00	1.96
16	600885	宏发股份	7,289,492	305,065,240.20	1.86
17	01066	威高股份	38,000,000	296,400,000.00	1.80
18	002064	华峰化学	35,252,679	286,956,807.06	1.75
19	002254	泰和新材	13,499,923	226,123,710.25	1.38
20	002967	广电计量	11,909,862	225,572,786.28	1.37
21	300285	国瓷材料	5,853,663	210,263,574.96	1.28
22	01548	金斯瑞生物科技	8,090,000	196,829,700.00	1.20

23	03908	中金公司	13,400,000	191,620,000.00	1.17
24	600519	贵州茅台	91,602	187,326,090.00	1.14
25	000661	长春高新	799,945	186,723,161.90	1.14
26	01999	敏华控股	23,894,400	173,234,400.00	1.05
27	603501	韦尔股份	966,200	167,181,586.00	1.02
28	300037	新宙邦	2,799,758	147,155,280.48	0.90
29	06969	思摩尔国际	6,860,000	142,002,000.00	0.86
30	688665	四方光电	924,819	136,873,212.00	0.83
31	600019	宝钢股份	21,050,000	126,721,000.00	0.77
32	02899	紫金矿业	15,000,000	123,300,000.00	0.75
33	03993	洛阳钼业	31,200,000	117,000,000.00	0.71
34	600887	伊利股份	2,851,300	111,058,135.00	0.68
35	01171	兖矿能源	5,000,000	105,200,000.00	0.64
36	601888	中国中免	450,000	104,818,500.00	0.64
37	02331	李宁	1,642,000	102,083,140.00	0.62
38	03606	福耀玻璃	2,994,400	101,929,376.00	0.62
39	01691	J S 环球生活	8,526,500	74,521,610.00	0.45
40	603517	绝味食品	1,023,400	59,172,988.00	0.36
41	688598	金博股份	200,000	58,940,000.00	0.36
42	603659	璞泰来	600,000	50,640,000.00	0.31
43	03998	波司登	11,930,000	49,628,800.00	0.30
44	002311	海大集团	780,547	46,840,625.47	0.29
45	603826	坤彩科技	700,000	41,202,000.00	0.25
46	002938	鹏鼎控股	1,204,000	36,372,840.00	0.22
47	01995	旭辉永升服务	3,900,000	33,345,000.00	0.20
48	00631	三一国际	4,500,000	32,085,000.00	0.20
49	603181	皇马科技	1,899,986	28,670,788.74	0.17
50	688157	松井股份	266,200	27,777,970.00	0.17
51	603733	仙鹤股份	1,003,500	26,693,100.00	0.16
52	300856	科思股份	435,000	18,870,300.00	0.11
53	300257	开山股份	999,956	14,959,341.76	0.09

54	02015	理想汽车—W	100,000	13,076,000.00	0.08
55	06186	中国飞鹤	1,535,000	11,834,850.00	0.07
56	688326	经纬恒润	77,635	11,417,003.10	0.07
57	01579	颐海国际	375,000	9,075,000.00	0.06
58	688133	泰坦科技	50,000	8,832,000.00	0.05
59	002507	涪陵榨菜	100,000	3,452,000.00	0.02
60	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
61	688153	唯捷创芯	7,674	391,374.00	0.00
62	301150	中一科技	4,025	365,815.66	0.00
63	688207	格灵深瞳	13,391	353,254.58	0.00
64	688690	纳微科技	3,477	280,976.37	0.00
65	688045	必易微	3,939	244,139.22	0.00
66	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
67	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
68	301206	三元生物	1,106	50,533.14	0.00
69	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
70	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
71	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
72	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
73	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
74	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
75	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
76	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
77	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
78	301109	军信股份	920	14,848.80	0.00
79	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
80	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
81	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
82	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
83	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
84	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00

85	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
86	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
87	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
88	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

注：参照《证券投资基金信息披露XBRL第3号》规定“A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。”

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	06098	碧桂园服务	718,123,133.18	4.26
2	300750	宁德时代	654,398,846.28	3.88
3	03690	美团-W	636,175,414.65	3.77
4	300059	东方财富	446,691,812.87	2.65
5	600031	三一重工	446,571,409.76	2.65
6	601888	中国中免	440,773,509.31	2.61
7	002064	华峰化学	368,486,424.29	2.18
8	002254	泰和新材	236,702,712.81	1.40
9	603501	韦尔股份	221,301,735.59	1.31
10	002415	海康威视	221,015,408.94	1.31
11	000661	长春高新	198,542,823.80	1.18
12	300285	国瓷材料	197,931,093.79	1.17
13	300037	新宙邦	171,632,492.83	1.02
14	00883	中国海洋石油	167,454,606.01	0.99
15	002271	东方雨虹	165,969,772.85	0.98
16	002028	思源电气	158,062,189.11	0.94
17	002001	新和成	155,701,908.24	0.92
18	600885	宏发股份	151,972,476.13	0.90

19	02331	李宁	130,872,098.69	0.78
20	688598	金博股份	126,939,486.49	0.75

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	451,887,687.29	2.68
2	600201	生物股份	433,473,752.10	2.57
3	601166	兴业银行	371,064,936.59	2.20
4	00700	腾讯控股	368,928,978.13	2.19
5	002001	新 和 成	324,438,246.64	1.92
6	601888	中国中免	299,040,275.00	1.77
7	600030	中信证券	259,948,123.63	1.54
8	02382	舜宇光学科技	240,775,684.18	1.43
9	002444	巨星科技	237,556,055.23	1.41
10	01810	小米集团—W	211,881,486.13	1.26
11	002555	三七互娱	199,956,501.00	1.18
12	06969	思摩尔国际	193,880,092.32	1.15
13	00291	华润啤酒	180,868,758.92	1.07
14	00883	中国海洋石油	166,547,367.34	0.99
15	02899	紫金矿业	164,894,974.58	0.98
16	002008	大族激光	152,711,101.96	0.90
17	00941	中国移动	143,715,589.11	0.85
18	601877	正泰电器	143,291,947.63	0.85
19	600060	海信视像	140,666,295.93	0.83
20	600031	三一重工	139,959,212.20	0.83

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,293,027,688.22
卖出股票收入（成交）总额	7,235,558,689.43

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	81,324,975.34	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	689,313,591.78	4.20
	其中：政策性金融债	689,313,591.78	4.20
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)	13,370,717.53	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	784,009,284.65	4.77

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200202	20国开02	3,300,000	330,966,764.38	2.01
2	150216	15国开16	1,300,000	135,060,704.11	0.82

3	210216	21国开16	1,000,000	101,617,123.29	0.62
4	210016	21付息国债16	800,000	81,324,975.34	0.49
5	200402	20农发02	700,000	70,460,945.21	0.43

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

注：本基金本报告期期末无股指期货持仓。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

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	100,012,120.00
3	应收股利	33,558,207.91
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,370,712.80
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	137,941,040.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113632	鹤21转债	10,192,643.77	0.06
2	113584	家悦转债	1,913,304.66	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	0.03	新股锁定

注：1、根据《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采用大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%；前款交易的受让方在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、根据《上市公司非公开发行股票实施细则》，发行对象属于本细则第七条第二款规定以外的情形的，发行对象认购的股份自发行结束之日起六个月内不得转让。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

份额 级别	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
睿远 均衡 价值 三年 持有 混合A	453, 180	21,399.54	145,633,425.09	1.50%	9,552,211,150. 17	98.50%
睿远 均衡 价值 三年 持有 混合C	74,2 49	16,136.66	6,171,049.54	0.52%	1,191,959,863. 98	99.48%
合计	527, 429	20,658.66	151,804,474.63	1.39%	10,744,171,01 4.15	98.61%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	睿远均衡价值三年 持有混合A	55,216,289.40	0.57%
	睿远均衡价值三年 持有混合C	2,116,021.19	0.18%
	合计	57,332,310.59	0.53%

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	份额级别	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	睿远均衡价值三年持有混合A	10~50
	睿远均衡价值三年持有混合C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	睿远均衡价值三年持有混合A	>100
	睿远均衡价值三年持有混合C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	睿远均衡价值三年持有混合A	睿远均衡价值三年持有混合C
基金合同生效日(2020年02月21日)基金份额总额	5, 578, 401, 219. 44	386, 133, 043. 76
本报告期期初基金份额总额	9, 071, 671, 990. 98	1, 081, 401, 416. 58
本报告期基金总申购份额	626, 172, 584. 28	116, 729, 496. 94
减：本报告期基金总赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	9, 697, 844, 575. 26	1, 198, 130, 913. 52

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无变化。

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是上会会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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	
中信证券	2	15,182,950,882.83	100.00%	12,146,532.34	100.00%	-

注：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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	170,488,969.85	100.00%	34,819,300.00	100.00%	-	-	-	-

注：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	睿远基金管理有限公司旗下基金2021年12月31日净值情况公告	证券时报，公司网站	2022-01-14
2	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金调整大额申购及定期定额投资业务限额的公告	证券时报，公司网站	2022-01-14
3	关于睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金增加代销机构的公告	证券时报，公司网站	2022-01-19
4	睿远基金管理有限公司旗下全部基金2021年第四季度报告提示性公告	证券时报，公司网站	2022-01-20
5	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金2021年第四季度报告	证券时报，公司网站	2022-01-20
6	睿远基金管理有限公司关于旗下证券投资基金增加代销机构的公告	证券时报，公司网站	2022-01-21
7	睿远基金管理有限公司关于固有资金及基金经理投资旗下公募基金的公告	证券时报，公司网站	2022-01-27
8	睿远基金管理有限公司关于固有资金投资旗下公募基金的公告	证券时报，公司网站	2022-03-16
9	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金调整大额申购及定期定额投资业务限额的公告	证券时报，公司网站	2022-03-17
10	睿远基金管理有限公司旗下	证券时报，公司网站	2022-03-29

	全部基金2021年年度报告提示性公告		
11	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金2021年年度报告	证券时报，公司网站	2022-03-29
12	睿远基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证券时报，公司网站	2022-03-30
13	关于《睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金2021年年度报告》的更正公告	证券时报，公司网站	2022-03-31
14	睿远基金管理有限公司旗下全部基金2022年第一季度报告提示性公告	证券时报，公司网站	2022-04-22
15	睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金2022年第一季度报告	证券时报，公司网站	2022-04-22

§ 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

注：本报告期内本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

- 6、报告期内睿远均衡价值三年持有期混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼42-43层 睿远基金管理有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.foresightfund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-920-1000 查询相关信息。

睿远基金管理有限公司
二〇二二年八月二十五日