

# 明亚价值长青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：明亚基金管理有限责任公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2022 年 8 月 19 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	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> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	49

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	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>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
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>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	明亚价值长青混合型证券投资基金	
基金简称	明亚价值长青	
基金主代码	009128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 24 日	
基金管理人	明亚基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,388,342.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	明亚价值长青 A	明亚价值长青 C
下属分级基金的交易代码	009128	009129
报告期末下属分级基金的份额总额	37,000,157.50 份	388,185.32 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金秉持价值投资的理念，通过选股策略结合资产配置策略，在控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金通过各大类资产的预期收益率和风险收益特征的相对变化，形成对不同大类资产市场的预测和判断，进而确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；在股票投资方面，本基金采用“自下而上”的策略，结合定性分析和定量分析的方法，选择估值合理，具有长期竞争优势的个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合全价（总值）指数收益*40%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 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	明亚基金管理有限责任公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖红
	联系电话	0755-23626571
	电子邮箱	compliance@mingyafunds.com
客户服务电话	4008-785-795	0574-83895886
传真	0755-23626574	0574-89103213
注册地址	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码	518000	315100
法定代表人	徐岱	陆华裕

## 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.mingyafunds.com
基金中期报告备置地点	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	明亚基金管理有限责任公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## § 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)		
	明亚价值长青 A	明亚价值长青 C	
本期已实现收益	-1,917,627.24	-23,923.68	
本期利润	-4,120,139.25	-58,901.30	
加权平均基金份额本期利润	-0.1110	-0.1336	
本期加权平均净值利润率	-10.58%	-12.77%	
本期基金份额净值增长率	-9.35%	-9.49%	
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	2,590,103.28	24,345.50
	期末可供分配基金份额利润	0.0700	0.0627

期末基金资产净值	39,590,260.78	412,530.82
期末基金份额净值	1.0700	1.0627
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	7.00%	6.27%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润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

明亚价值长青 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	5.30%	0.72%	4.94%	0.64%	0.36%	0.08%
过去三个月	5.74%	0.83%	3.90%	0.83%	1.84%	0.00%
过去六个月	-9.35%	0.89%	-4.74%	0.88%	-4.61%	0.01%
过去一年	-21.00%	0.87%	-8.62%	0.75%	-12.38%	0.12%
自基金合同生效起至今	7.00%	0.89%	8.90%	0.74%	-1.90%	0.15%

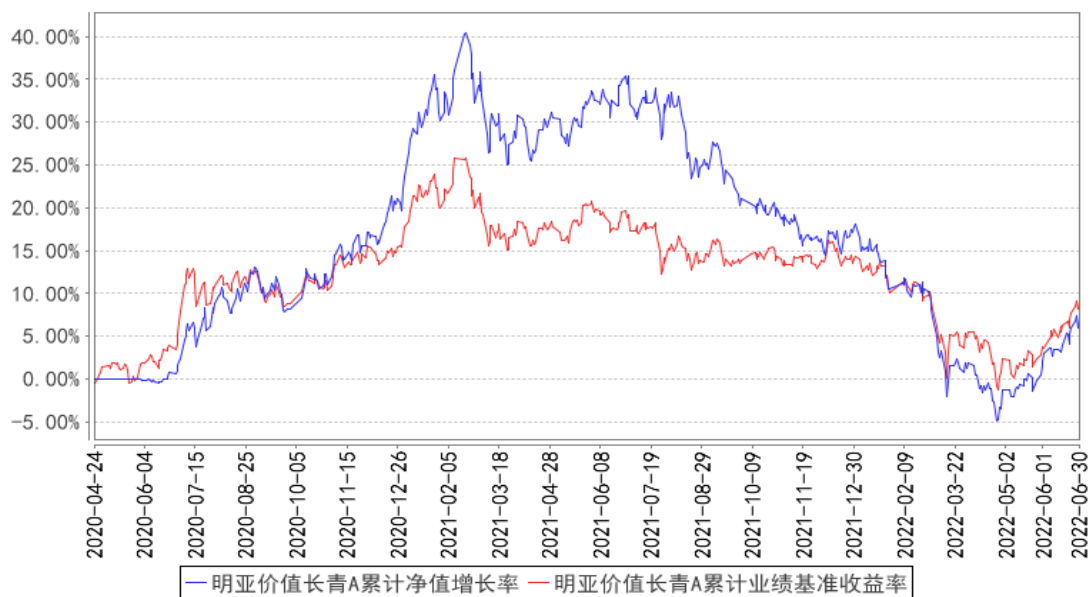
明亚价值长青 C

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	5.28%	0.72%	4.94%	0.64%	0.34%	0.08%
过去三个月	5.66%	0.83%	3.90%	0.83%	1.76%	0.00%
过去六个月	-9.49%	0.89%	-4.74%	0.88%	-4.75%	0.01%
过去一年	-21.25%	0.87%	-8.62%	0.75%	-12.63%	0.12%
自基金合同生效起至今	6.27%	0.89%	8.90%	0.74%	-2.63%	0.15%

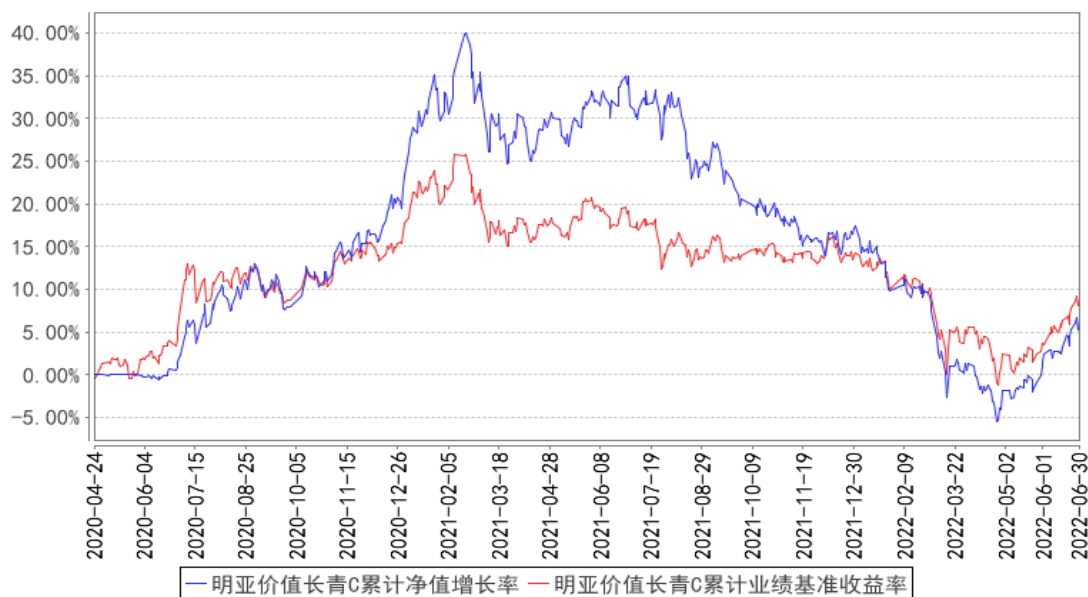
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

明亚价值长青A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





明亚价值长青C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



### 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

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司于 2019 年 2 月 11 日获得中国证监会核准设立，2019 年 11 月 18 日取得中华人民共和国经营证券期货业务许可证，实缴资本 1 亿元，注册地为深圳前海。明亚基金管理有限责任公司目前管理明亚价值长青混合型证券投资基金一只基金。明亚基金管理有限责任公司股东均为资产管理业专业人士，核心管理团队拥有二十多年的管理经验，将“基本面研究”和“量化策略”有效结合，秉持为投资者创造价值的坚定信念，致力于为投资者的长期利益服务。

#### 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		
何明	本基金的基金经理、研究部总监	2021 年 11 月 17 日	-	21 年	国际金融硕士、MBA，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、研究部总监、基金经理，2020 年 7 月加入明亚基金管理有限责任公司，现任研究部总监、权益投资部基金经理。

注：1、本处基金经理的“任职日期”指中国证券投资基金业协会核准任职注册的日期；

2、证券从业年限计算标准遵从《证券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

报告期内不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《明亚价值长青混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金财产，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。

#### 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

报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为，未出现基金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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年内外形势复杂，A 股先抑后扬。年初至四月中旬，市场在疫情反复、国内经济复苏一波三折、俄乌冲突催化大宗商品价格快速上涨以及美联储加息预期升温等不利因素的打击下持续下探。尽管三月中，政策暖风频吹，A 股“政策底”明确，但上海疫情爆发导致经济复苏预期再度延后，投资者风险偏好急剧下降，“市场底”于疫情形势渐趋明朗后出现，四月底至六月，成长股摆脱低迷态势，快速反弹。

中美经济周期错位的大背景下，A 股全面上涨的概率不高，更多以结构性机会为主。面临房地产行业下行、消费不振等多重压力，政策总体基调偏宽松。在经济弱复苏的环境下，高景气、成长性确定的领域成为资金共识。在 4 月 27 日至 6 月底的反弹中，创业板指数大幅跑赢上证综指，其中，前期超跌的高成长赛道，包括：泛新能源、先进制造、军工等行业领涨，表现出明显的成

长、中小盘风格特征。

本基金通过分析各大类资产的预期收益和预期风险的相对变化，确定不同类型资产的持仓水平。在股票资产配置方面，首先依据量化模型初步确定行业配比和行业内个股的配比，依照能够承受的最大回撤水平确定股票持仓；其次，结合基本面分析进行双重验证，最终确定合理且具有长期竞争优势的个股。报告期内，本基金维持了前期配置，持仓个股主要集中在制造业、计算机和大消费等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末明亚价值长青 A 基金份额净值为 1.0700，本报告期基金份额净值增长率为 -9.35%；截至本报告期末明亚价值长青 C 基金份额净值为 1.0627，本报告期基金份额净值增长率为 -9.49%；同期业绩比较基准收益率为 -4.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年谨慎乐观。由于上半年诸多预期外的因素导致经济增长差强人意。随着稳经济大盘的各项措施逐渐落地，疫情防控与经济增长之间的统筹更加科学合理，政策效果将在下半年更好地显现。因此，总量上看，二季度很可能是年内经济增速的低点，下半年较上半年有所修复。据此，与经济复苏相关的行业有望走出低谷，特别是需求相对刚性的必选消费、成本周期下行的制造业等领域。

本基金将根据企业盈利的可预见性、增长的可持续性以及估值水平等因素动态调整对行业和个股的配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

本基金管理人由总经理和投资部门、研究部、交易部、基金运营部、合规风控部负责人组成了估值委员会，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。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未实施利润分配。

#### 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

报告期内，基金资产净值持续低于五千万元。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并适时根据法律法规及基金合同规定的程序进行。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在明亚价值长青混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 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：明亚价值长青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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	555,823.39	1,162,842.75
结算备付金		40.41	40.41
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	31,636,151.86	41,409,812.42
其中：股票投资		20,748,579.73	32,099,194.12
基金投资		-	-
债券投资		10,887,572.13	9,310,618.30
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	7,900,079.00	2,500,025.00
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		-	-
应收股利		43,127.50	-
应收申购款		120.89	9.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	104,837.81
资产总计		40,135,343.05	45,177,568.38
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		533.60	-
应付管理人报酬		47,985.86	56,825.04
应付托管费		4,798.61	5,682.51
应付销售服务费		102.40	357.65
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	79,130.98	94,500.00
负债合计		132,551.45	157,365.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	37,388,342.82	38,143,189.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,614,448.78	6,877,013.83
净资产合计		40,002,791.60	45,020,203.18
负债和净资产总计		40,135,343.05	45,177,568.38

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 37,388,342.82 份，其中明亚价值长青 A 基金份额净值 1.0700 元，份额总额 37,000,157.50 份；明亚价值长青 C 基金份额净值 1.0627 元，份额总额 388,185.32 份。

## 6.2 利润表

会计主体：明亚价值长青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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,766,194.43	5,266,491.90
1. 利息收入		44,895.64	177,684.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,991.13	46,529.33
债券利息收入		-	40,681.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		42,904.51	90,472.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,575,591.65	8,237,664.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,936,123.40	8,173,412.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	117,990.89	-6,002.00
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	-	-195,780.00
股利收益	6.4.7.19	242,540.86	266,034.39
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	-2,237,489.63	-3,160,991.58
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	1,991.21	12,134.80
<b>减：二、营业总支出</b>		412,846.12	908,620.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	293,924.41	481,940.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,392.43	48,193.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	692.70	32,809.46
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	88,836.58	345,677.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,179,040.55	4,357,871.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,179,040.55	4,357,871.35
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,179,040.55	4,357,871.35

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：明亚价值长青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（基金净值）	38,143,189.35	-	6,877,013.83	45,020,203.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	38,143,189.35	-	6,877,013.83	45,020,203.18
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-754,846.53	-	-4,262,565.05	-5,017,411.58
(一)、 综合收 益总额	-	-	-4,179,040.55	-4,179,040.55
(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)	-754,846.53	-	-83,524.50	-838,371.03
其中:1. 基金申 购款	412,334.93	-	39,475.53	451,810.46
2 .基金 赎回 款	-1,167,181.46	-	-123,000.03	-1,290,181.49
(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)	37,388,342.82	-	2,614,448.78	40,002,791.60
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)	44,632,215.62	-	10,470,786.78	55,103,002.40
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)	44,632,215.62	-	10,470,786.78	55,103,002.40
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-6,180,226.71	-	3,152,709.17	-3,027,517.54
(一)、 综合收 益总额	-	-	4,357,871.35	4,357,871.35
(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)	-6,180,226.71	-	-1,205,162.18	-7,385,388.89

其中:1. 基金申购款	16,517,029.15	-	5,856,509.78	22,373,538.93
2. 基金赎回款	-22,697,255.86	-	-7,061,671.96	-29,758,927.82
(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)	38,451,988.91	-	13,623,495.95	52,075,484.86

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：

徐岱

肖红

李晓妹

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

明亚价值长青混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]338号《关于准予明亚价值长青混合型证券投资基金注册的批复》核准,由明亚基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚价值长青混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首

次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 344,663,183.18 元,已经致同会计师事务所(特殊普通合伙)致同验字(2020)第 441ZC0093 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《明亚价值长青混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 344,676,590.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,407.36 份基金份额。本基金的基金管理人为明亚基金管理有限责任公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,且不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚价值长青混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、货币市场工具(含同业存单等)、债券正逆回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 45%-90%,其中,投资于港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率\*50%+中证港股通综合指数收益率\*10%+中债综合全价(总值)指数收益率\*40%。

本财务报表由本基金的基金管理人明亚基金管理有限责任公司于 2022 年 8 月 26 日批准报出。

#### 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(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、中国

证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金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

###### 新金融工具准则

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

###### (1) 金融资产

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

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

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

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将其没有控制、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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### (2) 金融负债的分类

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

## 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

### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息

继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 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》(财会(2017)7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会(2017)8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会(2017)号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会(2017)14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则)和财政部 2020 年 12 月发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会(2020)22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (1) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。

于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款,金额分别为 1,162,842.75 元、40.41 元、2,500,025.00 元、104,837.81 元和 9.99 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为 1,162,970.72 元、40.41 元、2,499,081.20 元、0.00 元和 9.99 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 41,409,812.42 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 41,515,466.06 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”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。

(2) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

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

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	49,241.34
等于：本金	49,231.31
加：应计利息	10.03
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	506,582.05
等于：本金	506,276.71
加：应计利息	305.34
减：坏账准备	-
合计	555,823.39

注：本基金持有的其他存款为存放在在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	22,340,055.23	-	20,748,579.73	-1,591,475.50
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	201,367.23	10,887,572.13	8,963.51
	银行间市场	-	-	-
	合计	201,367.23	10,887,572.13	8,963.51
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	33,017,296.62	201,367.23	31,636,151.86	-1,582,511.99

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本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

本基金本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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	7,900,079.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,900,079.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提律师费	30,000.00
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	24,795.19
预提账户维护费	4,500.00
合计	79,130.98

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 明亚价值长青 A

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	37,475,519.16	37,475,519.16
本期申购	379,027.07	379,027.07
本期赎回（以“-”号填列）	-854,388.73	-854,388.73
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	37,000,157.50	37,000,157.50

##### 明亚价值长青 C

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	667,670.19	667,670.19
本期申购	33,307.86	33,307.86
本期赎回（以“-”号填列）	-312,792.73	-312,792.73
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	388,185.32	388,185.32

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 明亚价值长青 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,262,280.70	1,498,460.28	6,760,740.98
本期利润	-1,917,627.24	-2,202,512.01	-4,120,139.25

本期基金份额交易产生的变动数	-66,107.37	15,608.92	-50,498.45
其中：基金申购款	46,915.19	-8,169.80	38,745.39
基金赎回款	-113,022.56	23,778.72	-89,243.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,278,546.09	-688,442.81	2,590,103.28

## 明亚价值长青 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	89,636.13	26,636.72	116,272.85
本期利润	-23,923.68	-34,977.62	-58,901.30
本期基金份额交易产生的变动数	-34,207.56	1,181.51	-33,026.05
其中：基金申购款	3,314.11	-2,583.97	730.14
基金赎回款	-37,521.67	3,765.48	-33,756.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,504.89	-7,159.39	24,345.50

## 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	816.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,174.88
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,991.13

## 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	-1,936,123.40
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	-1,936,123.40

## 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	12,013,225.58
减：卖出股票成本总额	13,917,928.94
减：交易费用	31,420.04
买卖股票差价收入	-1,936,123.40

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

#### 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	127,079.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,088.19
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	117,990.89

##### 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	3,506,163.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,438,118.21
减：应计利息总额	76,077.81
减：交易费用	1,055.98
买卖债券差价收入	-9,088.19

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无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**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**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	242,540.86
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	242,540.86

**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	-2,237,489.63
股票投资	-2,251,344.44
债券投资	13,854.81
资产支持证券投资	-



基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,237,489.63

#### 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	1,991.21
合计	1,991.21

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 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	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
律师费	30,000.00
深港通证券组合费	205.60
账户维护费	9,000.00
公证费	5,000.00
合计	88,836.58

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无其他需要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

2022 年 1 月 20 日，基金管理人股东发生变更，股东西藏厚元资本管理有限公司完全退出，新增 3 位自然人股东孙超、徐岱、郭俊杰。西藏厚元资本不再属于基金关联方。

### 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
明亚基金管理有限责任公司（“明亚基金管理有限责任公司”）	基金管理人
宁波银行股份有限公司（“宁波银行股份有限公司”）	基金托管人
徐岱	基金管理人的股东

注：1、2022 年 1 月 20 日，基金管理人股东发生变更，股东西藏厚元资本管理有限公司完全退出，新增 3 位自然人股东孙超、徐岱、郭俊杰；

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未发生支付给关联方的佣金。

### 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	293,924.41	481,940.03
其中：支付销售机构的客户维护费	9,307.38	16,481.21

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式如下：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 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	29,392.43	48,193.95

注：支付基金托管人宁波银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15% / 当年天数。

#### 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	明亚价值长青 A	明亚价值长青 C	合计
明亚基金管理有限责任公司	-	38.66	38.66
宁波银行股份有限公司	-	1.81	1.81
合计	-	40.47	40.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	明亚价值长青 A	明亚价值长青 C	合计
明亚基金管理有限责任公司	-	31,158.17	31,158.17
宁波银行股份有限公司	-	2.07	2.07
合计	-	31,160.24	31,160.24

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%，按前一日 C 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
		明亚价值长青 A
基金合同生效日（2020年4月24日）持有的基金份额	9,989,824.18	-
报告期初持有的基金份额	35,044,652.15	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	35,044,652.15	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	94.7149%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
		明亚价值长青 A
基金合同生效日（2020年4月24日）持有的基金份额	9,989,824.18	-
报告期初持有的基金份额	29,838,612.28	-
报告期内申购/买入总份额	5,206,039.87	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	35,044,652.15	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	91.1387%	-
-------------------------	----------	---

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者使用的费率标准相一致。

#### 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

份额单位：份

##### 明亚价值长青 A

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
徐岱	40,618.75	0.1098	-	-

徐岱自 2022 年 1 月 20 日起变更为公司股东，其投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者使用的费率标准相一致。。

#### 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
宁波银行股份有限公司	49,241.34	816.25	1,117,946.37	9,405.90

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金管理人制定了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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，公司风险管理架构由风控合规委员会、督察长、合规风控部、以及各个业务部门组成。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

### 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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00%。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,887,572.13	9,310,618.30
合计	10,887,572.13	9,310,618.30

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波

动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主要投资于上市交易的证券，报告期末本基金所持的证券均能及时变现，资产变现能力强。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，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、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----



资产							
银行存款	555,823.39	-	-	-	-	-	555,823.39
结算备付金	40.41	-	-	-	-	-	40.41
交易性金融资产	10,887,572.13	-	-	-	-	20,748,579.73	31,636,151.86
买入返售金融资产	7,900,079.00	-	-	-	-	-	7,900,079.00
应收股利	-	-	-	-	-	43,127.50	43,127.50
应收申购款	-	-	-	-	-	120.89	120.89
资产总计	19,343,514.93	-	-	-	-	20,791,828.12	40,135,343.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	533.60	533.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,985.86	47,985.86
应付托管费	-	-	-	-	-	4,798.61	4,798.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	102.40	102.40
其他负债	-	-	-	-	-	79,130.98	79,130.98
负债总计	-	-	-	-	-	132,551.45	132,551.45
利率敏感度缺口	19,343,514.93	-	-	-	-	20,659,276.67	40,002,791.60
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	1,162,842.75	-	-	-	-	-	1,162,842.75
结算备付金	40.41	-	-	-	-	-	40.41
交易性金融资产	-	-	9,310,618.30	-	-	32,099,194.12	41,409,812.42
买入返售金融资产	2,500,025.00	-	-	-	-	-	2,500,025.00
应收申购款	-	-	-	-	-	9.99	9.99
其他资产	-	-	-	-	-	104,837.81	104,837.81
资产总计	3,662,908.16	-	9,310,618.30	-	-	32,204,041.92	45,177,568.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,825.04	56,825.04
应付托管费	-	-	-	-	-	5,682.51	5,682.51
应付销售服	-	-	-	-	-	357.65	357.65

务费							
其他负债	-	-	-	-	-	94,500.00	94,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	157,365.20	157,365.20
利率敏感度缺口	3,662,908.16	-	9,310,618.30	-	-	32,046,676.72	45,020,203.18

#### 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		
	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	市场利率上升 25 个基点	-1,608.03	-10,942.62
	市场利率下降 25 个基点	1,608.52	10,969.93

#### 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。本基金因投资港股通标的而持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,551,022.73	-	4,551,022.73
资产合计	-	4,551,022.73	-	4,551,022.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外	-	4,551,022.73	-	4,551,022.73

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
汇风险敞口净额				
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,962,361.12	-	7,962,361.12
资产合计	-	7,962,361.12	-	7,962,361.12
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	-	7,962,361.12	-	7,962,361.12

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇汇率以外的其他市场变量保持不变		
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	所有外币相对人民币升值 5%	227,551.14	398,118.06
	所有外币相对人民币贬值 5%	-227,551.14	-398,118.06

#### 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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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	20,748,579.73	51.87	32,099,194.12	71.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,887,572.13	27.22	9,310,618.30	20.68
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	31,636,151.86	79.09	41,409,812.42	91.98

#### 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		
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	业绩比较基准上升 5%	1,932,817.62	2,714,733.79
	业绩比较基准下降 5%	-1,932,817.62	-2,714,733.79

注：本基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*50%+中证港股通综合指数收益率\*10%+中债综合全价（总值）指数收益率\*40%

#### 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	20,748,579.73	32,099,194.12
第二层次	10,887,572.13	9,310,618.30
第三层次	-	-
合计	31,636,151.86	41,409,812.42

### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	20,748,579.73	51.70
	其中：股票	20,748,579.73	51.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,887,572.13	27.13

	其中：债券	10,887,572.13	27.13
	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	7,900,079.00	19.68
	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	555,863.80	1.38
8	其他各项资产	43,248.39	0.11
9	合计	40,135,343.05	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 4,551,022.73 元，占基金资产净值比例 11.38%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,616,709.00	36.54
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	1,580,848.00	3.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,197,557.00	40.49

### 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	-	-
非周期性消费品	-	-
周期性消费品	1,521,596.81	3.80
能源	-	-
金融	509,137.37	1.27
医疗	865,982.50	2.16
工业	445,810.55	1.11
信息科技	790,051.03	1.97
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产业	418,444.47	1.05
合计	4,551,022.73	11.38

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300481	濮阳惠成	76,700	1,802,450.00	4.51
2	603855	华荣股份	64,800	1,652,400.00	4.13
3	002859	洁美科技	55,400	1,524,608.00	3.81
4	300470	中密控股	41,500	1,464,535.00	3.66
5	002050	三花智控	51,000	1,401,480.00	3.50
6	603566	普莱柯	47,500	1,269,675.00	3.17
7	002032	苏泊尔	21,500	1,211,310.00	3.03
8	603899	晨光股份	18,800	1,054,304.00	2.64
9	300687	赛意信息	40,200	923,394.00	2.31
10	002706	良信股份	42,800	707,484.00	1.77
11	600570	恒生电子	15,100	657,454.00	1.64
12	300748	金力永磁	17,500	644,000.00	1.61
13	00322	康师傅控股	54,000	620,662.69	1.55
14	603187	海容冷链	16,500	603,075.00	1.51
15	00522	ASMPT	10,300	587,083.66	1.47
16	002507	涪陵榨菜	15,200	524,704.00	1.31
17	01299	友邦保险	7,000	509,137.37	1.27
18	02162	康诺亚-B	17,500	493,872.23	1.23
19	06993	蓝月亮集团	80,500	461,246.73	1.15
20	01882	海天国际	26,000	445,810.55	1.11
21	06186	中国飞鹤	57,000	439,687.39	1.10
22	603601	再升科技	66,500	422,940.00	1.06
23	06098	碧桂园服务	14,000	418,444.47	1.05
24	01789	爱康医疗	74,000	372,110.27	0.93
25	002139	拓邦股份	27,200	333,744.00	0.83

26	01810	小米集团-W	17,400	202,967.37	0.51
----	-------	--------	--------	------------	------

#### 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	603566	普莱柯	1,606,770.00	3.57
2	002032	苏泊尔	943,097.00	2.09
3	300748	金力永磁	488,791.00	1.09
4	603855	华荣股份	404,249.00	0.90
5	02162	康诺亚-B	353,173.46	0.78
6	06186	中国飞鹤	346,807.53	0.77
7	603899	晨光股份	269,892.00	0.60
8	300687	赛意信息	252,024.00	0.56
9	600570	恒生电子	81,090.00	0.18
10	002050	三花智控	72,765.00	0.16

注：1. 本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

2. 本基金本报告期内仅买入上述股票。

##### 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	002859	洁美科技	1,219,688.00	2.71
2	300470	中密控股	1,077,258.00	2.39
3	603187	海容冷链	1,010,929.16	2.25
4	300481	濮阳惠成	971,561.00	2.16
5	002032	苏泊尔	759,549.00	1.69
6	603855	华荣股份	695,329.00	1.54
7	603601	再升科技	611,400.00	1.36
8	300687	赛意信息	605,718.00	1.35
9	00322	康师傅控股	555,862.25	1.23
10	01882	海天国际	506,008.17	1.12
11	00522	ASMP	482,208.39	1.07
12	002139	拓邦股份	452,099.00	1.00
13	01299	友邦保险	435,206.42	0.97
14	002050	三花智控	419,819.00	0.93
15	002706	良信股份	383,602.00	0.85
16	06993	蓝月亮集团	371,205.37	0.82
17	01579	颐海国际	335,117.62	0.74
18	01789	爱康医疗	269,336.23	0.60
19	01810	小米集团-W	202,017.12	0.45
20	603566	普莱柯	191,470.00	0.43



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	4,818,658.99
卖出股票收入（成交）总额	12,013,225.58

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	10,887,572.13	27.22
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,887,572.13	27.22

#### 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	019658	21 国债 10	106,830	10,887,572.13	27.22

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 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

本基金在法律法规及合同允许的范围内进行股指期货的投资。本基金在 2022 年上半年未进行股指期货投资。

## 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，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

本报告期内，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	-
3	应收股利	43,127.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	120.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,248.39

### 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

由于计算结果四舍五入，分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
明亚价值 长青 A	199	185,930.44	35,044,652.15	94.71	1,955,505.35	5.29
明亚价值 长青 C	82	4,733.97	0.00	0	388,185.32	100
合计	281	133,054.60	35,044,652.15	93.73	2,343,690.67	6.27

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），  
 户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 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	明亚价值长青 A	132,283.27	0.3575
	明亚价值长青 C	210.48	0.0542
	合计	132,493.75	0.3544

注：（1）前述“明亚价值长青 A”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚价值长青 A 的份额占明亚价值长青 A 总份额比例；（2）前述“明亚价值长青 C”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚价值长青 C 的份额占明亚价值长青 C 总份额比例；（3）前述“合计”项下，占基金总份额比例=（基金管理人所有从业人员持有明亚价值长青 A 的总份额数+基金管理人所有从业人员持有明亚价值长青 C 的总份额数）/（明亚价值长青 A 总份额数+明亚价值长青 C 总份额数）。

## 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	明亚价值长青 A	0~10
	明亚价值长青 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	明亚价值长青 A	0~10
	明亚价值长青 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	明亚价值长青 A	明亚价值长青 C
基金合同生效日 (2020 年 4 月 24 日) 基金份额总额	45,928,916.97	298,747,673.57
本报告期期初基金份 额总额	37,475,519.16	667,670.19
本报告期基金总申购 份额	379,027.07	33,307.86
减：本报告期基金总 赎回份额	854,388.73	312,792.73
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	37,000,157.50	388,185.32

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于持续运作明亚价值长青混合型证券投资基金的议案》，相关情况详见基金管理人于 2022 年 6 月 15 日发布的公告。

### 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

1、报告期内，基金管理人督察长邓译娜女士离任公司督察长职务，由董事长肖红女士代为履行督察长职务，上述事项经明亚基金管理有限责任公司董事会审议通过，并按规定向监管机构备案。相关情况详见基金管理人于 2022 年 3 月 9 日发布的公告。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 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

报告期内无涉及管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
招商证券股份有限公司	2	16,831,884.57	100.00	22,564.42	100.00	-

注：1. 本基金采用券商交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2. 本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商的选择标准主要包括公司的财务状况、经营状况、研究实力、信息服务的全面性和及时性。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	5,229,936.00	100.00	565,900,000.00	100.00	-	-

## 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	明亚价值长青混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 1 月 21 日
2	明亚基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 3 月 9 日
3	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加中植基金为代销机构并开通定投业务的公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 3 月 24 日
4	明亚价值长青混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 3 月 31 日
5	明亚价值长青混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 4 月 22 日
6	明亚基金管理有限责任公司关于终止与北京唐鼎耀华基金销售有限公司合	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 4 月 27 日

	作关系的公告		
7	明亚基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开明亚价值长青混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 5 月 12 日
8	明亚基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开明亚价值长青混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 5 月 13 日
9	明亚基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开明亚价值长青混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 5 月 16 日
10	明亚基金管理有限责任公司关于明亚价值长青混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证监会规定网站、规定报刊	2022 年 6 月 17 日

注：前述规定网站包括：基金管理人网站（<http://www.mingyafunds.com>）、中国证监会基金电子信息披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）；规定报刊为证券时报。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	35,044,652.15	0.00	0.00	35,044,652.15	93.73

#### 产品特有风险

1、大额赎回风险本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能是基金资产净值收到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约

定的投资目的及投资策略；（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。2、大额申购风险若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予明亚价值长青混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《明亚价值长青混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《明亚价值长青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、报告期内明亚价值长青混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所或登陆基金管理人网站：[www.mingyafunds.com](http://www.mingyafunds.com) 免费查询，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可致电基金管理人全国统一客户服务电话：400-785-795。

明亚基金管理有限责任公司

2022 年 8 月 30 日