

# 华润元大臻选回报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：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中泰证券股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大臻选回报混合型证券投资基金	
基金简称	华润元大臻选回报混合	
基金主代码	013598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 18 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	中泰证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	233,222,979.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华润元大臻选回报混合 A	华润元大臻选回报混合 C
下属分级基金的交 易代码	013598	013599
报告期末下属分级 基金的份额总额	168.05 份	233,222,811.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金具有前瞻性的宏观策略分析，自上而下分析与自下而上选股相结合，进行深入的个股挖掘。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过对企业的全面深入研究，优选具备优质企业资质的公司。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期的收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。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。

### 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		华润元大基金管理有限公司	中泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘豫皓	王秀荣
	联系电话	0755-88399008	0531-68889484
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	wangxr01@zts.com.cn
客户服务电话		4000-1000-89	95538
传真		0755-88399045	0531-68889445

注册地址	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	山东省济南市经七路 86 号
办公地址	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	山东省济南市经七路 86 号证券大厦 10 楼 1006 室
邮政编码	518066	250001
法定代表人	费凡	李峰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cryuantafund.com">http://www.cryuantafund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-2105 单元

## § 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	2022 年 02 月 18 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
和指标	华润元大臻选回报混合 A	华润元大臻选回报混合 C
本期已实现收益	2.01	3,022,158.46
本期利润	6.93	10,014,654.18
加权平均基金份额本期利润	0.0616	0.0482
本期加权平均净值利润率	6.30%	4.93%
本期基金份额净值增长率	5.34%	5.26%
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	2.72	3,636,508.72

期末可供分配基金份额利润	0.0162	0.0156
期末基金资产净值	177.02	245,494,962.56
期末基金份额净值	1.0534	1.0526
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	5.34%	5.26%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

华润元大臻选回报混合 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	10.51%	0.92%	5.13%	0.87%	5.38%	0.05%
过去三个月	6.29%	1.12%	1.63%	1.33%	4.66%	-0.21%
自基金合同生效起至今	5.34%	0.99%	-4.17%	1.38%	9.51%	-0.39%

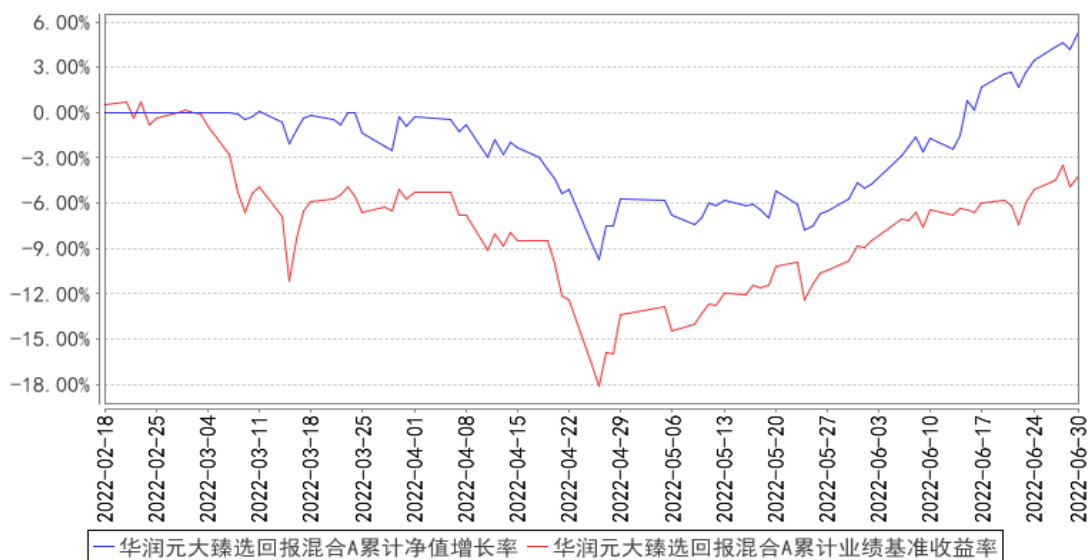
华润元大臻选回报混合 C

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	10.49%	0.92%	5.13%	0.87%	5.36%	0.05%
过去三个月	6.25%	1.12%	1.63%	1.33%	4.62%	-0.21%

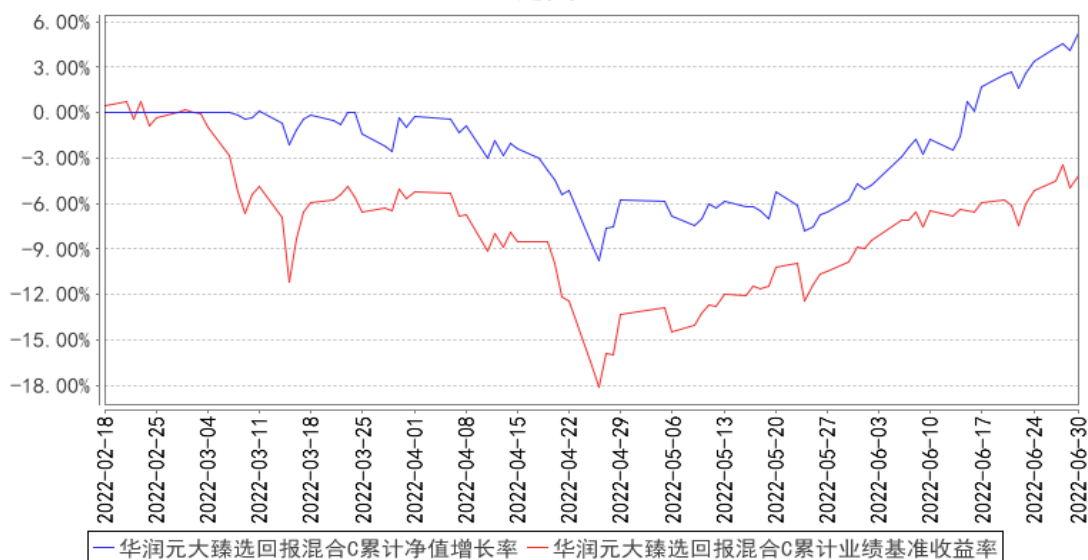
自基金合同生效起 至今	5.26%	0.99%	-4.17%	1.38%	9.43%	-0.39%
----------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

### 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

华润元大臻选回报混合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



华润元大臻选回报混合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



## § 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746号文批准，于2013年1月



17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十九只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大景泰混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大润安混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大臻选回报混合型证券投资基金、华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金。

#### 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		
李武群	本基金的基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	13 年	曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2015 年 8 月 13 日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司量化指数部总经理。2017 年 8 月 2 日起担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 18 日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 13 日起担任华润元大景泰混合型证券投资基金基金经理；2020 年 10 月 23 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日担任华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理；2022 年 6 月 23 日起担任华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金经理。
胡永杰	本基金的基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	7 年	曾任招商银行总行信息技术部开发工程师、深圳前海金信大数据金融服务有限公司研究员。2017 年加入公司，现担任量化指数部基金经理。2021 年 1 月 25 日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基

					金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大富时 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日起担任华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理；2022 年 6 月 23 日起担任华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

##### 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。基金管理人管理的所有投资组合未存在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% 的情形。

#### 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

2022 年上半年我国经济处于下行趋势，供需下滑，经济增速显著放缓，主要原因在于外部俄乌冲突导致国际能源价格大幅上行、国内疫情反复防控政策收紧等超预期因素。在此背景下，股市加速下跌，4 月下旬触底后反弹，呈现 V 型反转走势。

本基金根据市场环境精选优质价值公司组合。未来市场展望方面，继续保持乐观，优选核心资产。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大臻选回报混合 A 基金份额净值为 1.0534 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.34%，同期业绩基准收益率为-4.17%；华润元大臻选回报混合 C 基金份额净值为 1.0526 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.26%，同期业绩基准收益率为-4.17%。

#### 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 2022 年下半年，经济底部逐步显现，后期将缓慢修复，但仍有突发性扰动因素需注意。股市方面，预计将保持区间震荡格局，且区间底部缓慢抬升，收益波动率会提升，结构性机会明显。建议关注半导体、军工等景气度较高行业，以及医药、白酒等经济修复受益标的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现该情况的时间范围为 2022 年 5 月 23 日至 6 月 30 日。本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现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

本托管人认真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，认为其真实、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：华润元大臻选回报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
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	812,609.57
结算备付金		97,275,068.96
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	143,574,151.75
其中：股票投资		130,858,752.93
基金投资		-
债券投资		12,715,398.82
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	4,000,921.64
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		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		245,662,751.92
<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>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		20.96
应付管理人报酬		100,519.38
应付托管费		16,753.23
应付销售服务费		16,753.22
应付投资顾问费		-
应交税费		0.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	33,565.21
负债合计		167,612.34
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	233,222,979.55
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	12,272,160.03
净资产合计		245,495,139.58
负债和净资产总计		245,662,751.92

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 233,222,979.55 份，其中华润元大华润元大臻选回报混合 A 类基金份额净值人民币 1.0534 元，份额总额 168.05 份；华润元大华润元大臻选回报混合 C 类基金份额净值人民币 1.0526 元，份额总额 233,222,811.50 份。

（2）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：华润元大臻选回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		10,635,245.64
1. 利息收入		355,331.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	219,766.84
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		135,564.61
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,287,413.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,628,159.79

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	56,333.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,602,919.85
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	6,992,500.64
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	-
<b>减：二、营业总支出</b>		620,584.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	438,825.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,137.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	73,137.62
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		0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	35,483.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,014,661.11
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,014,661.11
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		10,014,661.11

注：本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华润元大臻选回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	209,023,762.00	-	-	209,023,762.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	24,199,217.55	-	12,272,160.03	36,471,377.58
(一)、综合收益总额	-	-	10,014,661.11	10,014,661.11
(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)	24,199,217.55	-	2,257,498.92	26,456,716.47
其中:1.基金申购款	133,202,216.30	-	-1,538,864.02	131,663,352.28
2.基金赎回款	-109,002,998.75	-	3,796,362.94	-105,206,635.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	233,222,979.55	-	12,272,160.03	245,495,139.58

注：本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

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：

<u>费凡</u>	<u>张彦军</u>	<u>张彦军</u>
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

华润元大臻选回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2788 号文《关于准予华润元大臻选回报混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大臻选回报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，首次募集期间为 2021 年 12 月 10 日至 2022 年 2 月 16 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 209,019,209.75 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2022）验字第 61032987\_H01 号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 2 月 18 日正式生效。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中泰证券股份有限公司。

根据《华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同》和《华润元大臻选回报混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资



产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。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并公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大臻选回报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（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中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：中证 500 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。

#### 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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### （1）金融资产分类

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

#### （2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

无。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### (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。

### (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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

(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。

(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。

(5) 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和



转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	812,609.57
等于：本金	812,110.44
加：应计利息	499.13
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	812,609.57

##### 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	123,887,210.09	-	130,858,752.93	6,971,542.84	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,604,633.00	89,808.02	12,715,398.82	20,957.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,604,633.00	89,808.02	12,715,398.82	20,957.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	136,491,843.09	89,808.02	143,574,151.75	6,992,500.64	

##### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

本基金本报告期末未持有期货合约。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

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	4,000,921.64	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,921.64	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	33,565.21
合计	33,565.21

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华润元大臻选回报混合 A

项目	本期 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	110.17	110.17
本期申购	57.88	57.88
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	168.05	168.05

##### 华润元大臻选回报混合 C

项目	本期 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	209,023,651.83	209,023,651.83
本期申购	133,202,158.42	133,202,158.42
本期赎回（以“-”号填列）	-109,002,998.75	-109,002,998.75
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	233,222,811.50	233,222,811.50

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华润元大臻选回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2.01	4.92	6.93
本期基金份额交易产生的变动数	0.71	1.33	2.04
其中：基金申购款	0.71	1.33	2.04
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2.72	6.25	8.97

华润元大臻选回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,022,158.46	6,992,495.72	10,014,654.18
本期基金份额交易产生的变动数	614,350.26	1,643,146.62	2,257,496.88
其中：基金申购款	559,314.81	-2,098,180.87	-1,538,866.06
基金赎回款	55,035.45	3,741,327.49	3,796,362.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,636,508.72	8,635,642.34	12,272,151.06

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	18,330.51
定期存款利息收入	15,555.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	185,880.77
其他	-
合计	219,766.84

#### 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2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,628,159.79
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	1,628,159.79

#### 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2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出股票成交总额	24,970,002.94
减：卖出股票成本总额	23,190,213.74
减：交易费用	151,629.41
买卖股票差价收入	1,628,159.79

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

-

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	55,435.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	898.76
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	56,333.91

##### 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2月18日（基金合同生效日）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	19,882,586.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,712,950.00
减：应计利息总额	160,585.63
减：交易费用	8,152.04
买卖债券差价收入	898.76

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

-

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,602,919.85
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	1,602,919.85

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2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	6,992,500.64
股票投资	6,971,542.84
债券投资	20,957.80
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	6,992,500.64

#### 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未计提信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年 6月30日
审计费用	33,565.21
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇款费	1,118.26
其他	800.00
合计	35,483.47

注：其他为证券账户开户费。

#### 6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 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，本基金无需作说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金托管人、基金销售机构
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
珠海华润银行股份有限公司（“珠海华润”）	与基金管理人受同一实际控制的公司

银行”)	
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人控股股东的联营公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期通过关联方交易单元进行交易的情况如下：

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年2月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
中泰证券	86,855,959.94	51.72

注：本基金基金合同于2022年2月18日生效，无上年度可比期间及可比数据。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年2月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
中泰证券	33,247,353.00	64.11

注：本基金基金合同于2022年2月18日生效，无上年度可比期间及可比数据。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年2月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
中泰证券	1,130,500,000.00	99.08

注：本基金基金合同于2022年2月18日生效，无上年度可比期间及可比数据。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易，本基金基金合同于2022年2月18日生效，无上年度可比期间及可比数据。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	92,795.89	68.24	-	-

注：（1）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据；

（2）上述佣金费率由本基金管理人参考市场佣金率在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的证券经纪服务协议进行约定，包含经手费、证管费和过户费。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	17.95

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

（3）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：（1）基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

（2）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

##### 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2月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日

	华润元大臻选回报混合 A	华润元大臻选回报混合 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	73,131.54	73,131.54
中泰证券	-	2.40	2.40
合计	-	73,133.94	73,133.94

注：（1）支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.10%。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日该级别基金资产净值 × 对应销售服务费年费率 / 当年天数。

（2）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

#### 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

本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（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

本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

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

-

#### 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

-

#### 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 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
	中泰证券	812,609.57

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人中泰证券转存于招商银行股份有限公司济南经十路支行，按银行间同业利率计息。

（2）本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中泰证券	838171	邦德股份	网上配售发行	3,800	26,600.00
国信证券	001270	铖昌科技	新股网下发行	568	12,314.24
中泰证券	831278	泰德股份	网上配售发行	400	1,624.00

注：本基金为新设立基金，无上年度可比区间。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	27.53	45.04	275	7,570.75	12,386.00	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1-6 个月（含）	新股未上市	38.46	38.46	2,486	95,611.56	95,611.56	-

		日									
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	234	7,881.12	10,291.32	-	
301175	中科环保	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股未上市	3.82	3.82	22,505	85,969.10	85,969.10	-	
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1-6个月(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	572	10,970.96	18,344.04	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1-6个月(含)	新股未上市	33.65	33.65	1,723	57,978.95	57,978.95	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	192	6,460.80	6,460.80	-	
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股锁定	26.86	47.07	396	10,636.56	18,639.72	-	
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	577	9,757.07	11,418.83	-	
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-	
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	175	9,105.25	9,873.50	-	
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-	
688047	龙芯中科	2022年6月17日	6个月	新股锁定	60.06	82.01	1,483	89,068.98	121,620.83	-	
688120	华海	2022年	6个月	新股锁	136.66	217.12	663	90,605.58	143,950.56	-	

	清科	5月30日		定						
688237	超卓航科	2022年6月24日	1-6个月(含)	新股未上市	41.27	41.27	1,957	80,765.39	80,765.39	-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股未上市	30.99	30.99	3,674	113,857.26	113,857.26	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1-6个月(含)	新股未上市	21.93	21.93	3,390	74,342.70	74,342.70	-

#### 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

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由涉及金融工具产生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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中泰证券股份有限公司，与该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 2022 年 6 月 30 日，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占基金资产净值的比例为 0.08%（上年度末：未持有）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 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 6 月 30 日
AAA	198,310.80
AAA 以下	-
未评级	12,427,280.00
合计	12,625,590.80

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债和央行票据。

（3）债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 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。

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

### 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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本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。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	812,609.57	-	-	-	-	812,609.57
结算备付金	97,275,068.96	-	-	-	-	97,275,068.96
交易性金融资产	-	12,517,076.38	198,322.44	-	130,858,752.93	143,574,151.75
买入返售金融资产	4,000,921.64	-	-	-	-	4,000,921.64
资产总计	102,088,600.17	12,517,076.38	198,322.44	-	130,858,752.93	245,662,751.92
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	20.96	20.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	100,519.38	100,519.38
应付托管费	-	-	-	-	16,753.23	16,753.23
应付销售服务费	-	-	-	-	16,753.22	16,753.22
应交税费	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	33,565.21	33,565.21
负债总计	-	-	-	-	167,612.34	167,612.34
利率敏感度缺口	102,088,600.17	12,517,076.38	198,322.44	-	130,691,140.59	245,495,139.58

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	
	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）
分析	市场利率增加 25 个基点	-23,051.40
-	市场利率减少 25 个基点	23,121.66

#### 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。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场



交易的证券，所面临的最大其他价格风险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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、股指期货、银行存款、资产支持证券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相关规定。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	130,858,752.93	53.30
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	12,715,398.82	5.18
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	143,574,151.75	58.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	—	
	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）
分析	中证 500 指数上升 5%	6,726,475.00
	中证 500 指数下降 5%	-6,726,475.00

## 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
第一层次	128,566,173.10
第二层次	13,295,820.10
第三层次	1,712,158.55
合计	143,574,151.75

注：本基金基金合同于 2022 年 2 月 18 日生效，无上年度可比期间及可比数据。

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	130,858,752.93	53.27
	其中：股票	130,858,752.93	53.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,715,398.82	5.18
	其中：债券	12,715,398.82	5.18
	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	4,000,921.64	1.63
	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	98,087,678.53	39.93
8	其他各项资产	-	-
9	合计	245,662,751.92	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,303.44	0.54
C	制造业	115,757,386.26	47.15
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	10,449,796.38	4.26
J	金融业	3,168,858.00	1.29
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	85,969.10	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	64,439.75	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	130,858,752.93	53.30

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	600031	三一重工	835,000	15,915,100.00	6.48
2	000333	美的集团	257,700	15,562,503.00	6.34
3	600519	贵州茅台	6,900	14,110,500.00	5.75
4	300750	宁德时代	25,500	13,617,000.00	5.55
5	600276	恒瑞医药	320,000	11,868,800.00	4.83
6	600309	万华化学	113,700	11,027,763.00	4.49
7	000063	中兴通讯	422,600	10,788,978.00	4.39
8	000858	五粮液	45,300	9,147,429.00	3.73
9	300601	康泰生物	156,160	7,055,308.80	2.87
10	600570	恒生电子	158,200	6,888,028.00	2.81
11	000538	云南白药	92,800	5,604,192.00	2.28
12	002230	科大讯飞	83,600	3,445,992.00	1.40
13	600030	中信证券	146,300	3,168,858.00	1.29
14	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.54
15	688349	三一重能	3,591	146,333.25	0.06
16	688120	华海清科	663	143,950.56	0.06
17	688047	龙芯中科	1,483	121,620.83	0.05
18	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.05
19	688322	奥比中光	3,674	113,857.26	0.05
20	301139	元道通信	2,486	95,611.56	0.04
21	301175	中科环保	22,505	85,969.10	0.04
22	688237	超卓航科	1,957	80,765.39	0.03
23	688400	凌云光	3,390	74,342.70	0.03
24	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
25	301239	普瑞眼科	1,915	64,439.75	0.03
26	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.02
27	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
28	301266	宇邦新材	396	18,639.72	0.01
29	301238	瑞泰新材	572	18,344.04	0.01
30	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
31	301112	信邦智能	275	12,386.00	0.01

32	301286	侨源股份	577	11,418.83	0.00
33	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
34	301153	中科江南	234	10,291.32	0.00
35	301302	华如科技	175	9,873.50	0.00
36	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
37	833943	优机股份	500	3,680.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	15,090,582.00	6.15
2	600031	三一重工	14,756,626.00	6.01
3	000858	五粮液	14,723,989.00	6.00
4	300750	宁德时代	13,260,000.00	5.40
5	600519	贵州茅台	12,178,914.00	4.96
6	600276	恒瑞医药	11,782,400.00	4.80
7	000063	中兴通讯	9,994,490.00	4.07
8	600309	万华化学	9,758,406.00	3.97
9	601628	中国人寿	9,352,401.00	3.81
10	300601	康泰生物	8,394,864.00	3.42
11	600570	恒生电子	7,444,966.00	3.03
12	000538	云南白药	5,069,664.00	2.07
13	002049	紫光国微	4,377,197.00	1.78
14	002230	科大讯飞	4,038,298.00	1.64
15	600030	中信证券	2,750,440.00	1.12
16	600938	中国海油	1,296,054.00	0.53
17	688170	XD 德龙激	156,543.66	0.06
18	688348	昱能科技	153,220.00	0.06
19	688297	中无人机	130,111.70	0.05
20	688045	必易微	126,017.75	0.05

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601628	中国人寿	10,350,325.00	4.22
2	000858	五粮液	8,189,336.00	3.34
3	002049	紫光国微	3,341,060.00	1.36
4	600938	中国海油	498,493.84	0.20
5	688348	昱能科技	272,087.00	0.11
6	688119	中钢洛耐	229,930.00	0.09

7	688297	中无人机	210,438.08	0.09
8	301238	瑞泰新材	169,119.18	0.07
9	301266	宇邦新材	163,434.80	0.07
10	301298	东利机械	153,470.52	0.06
11	301112	信邦智能	147,456.62	0.06
12	301286	侨源股份	146,562.47	0.06
13	688045	必易微	141,561.70	0.06
14	688170	XD 德龙激	139,574.20	0.06
15	301153	中科江南	117,327.00	0.05
16	301125	腾亚精工	110,209.66	0.04
17	301302	华如科技	101,900.29	0.04
18	688320	禾川科技	81,912.60	0.03
19	688290	景业智能	79,694.71	0.03
20	871970	大禹生物	46,023.00	0.02

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	147,077,423.83
卖出股票收入（成交）总额	24,970,002.94

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	12,517,076.38	5.10
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）	198,322.44	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,715,398.82	5.18

#### 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	019629	20 国债 03	124,000	12,517,076.38	5.10

2	132026	G 三峡 EB2	1,770	198,322.44	0.08
---	--------	----------	-------	------------	------

注：本基金本报告期末仅持有 2 只债券。

#### 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

本基金本报告期末持仓股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，前十大证券发行主体未出现违法违规行为，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票未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

本基金本报告期末未持有其他资产。

##### 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

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字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 (%)
华润元大臻选回报混合 A	4	42.01	0.00	0	168.05	100
华润元大臻选回报混合 C	168	1,388,231.02	233,204,767.81	99.99	18,043.69	0.01
合计	172	1,355,947.56	233,204,767.81	99.99	18,211.74	0.01

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

### 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	华润元大臻选回报混合 A	10.16	6.0458
	华润元大臻选回报混合 C	10.02	0.0000
	合计	20.18	0.0000

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华润元大臻选回报混合 A	0
	华润元大臻选回报混合 C	0



	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	华润元大臻选回报混合 A	0
	华润元大臻选回报混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大臻选回报混合 A	华润元大臻选回报混合 C
基金合同生效日 (2022 年 2 月 18 日) 基金份额总额	110.17	209,023,651.83
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	57.88	133,202,158.42
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	109,002,998.75
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	168.05	233,222,811.50

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动如下：2022 年 4 月 1 日，华润元大基金管理有限公司第四届董事会第一次会议选举费凡先生、陈矛女士、江先达先生、刘宗圣先生、刘民先生、汪习根先生、代军勋先生为董事；聘任费凡先生代履行总经理职务、刘豫皓先生担任督察长、张彦军先生担任首席信息官。2022 年 4 月 1 日，华润元大基金管理有限公司第四届监事会第一次会议选举肖震宇先生、林瑞源先生、李晴女士、罗黎军先生为监事。上述变更已按照

规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人，托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	5	86,855,959.94	51.72	92,795.89	68.24	-
西南证券	3	81,087,280.00	48.28	43,192.67	31.76	-

注：1、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。2、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的 需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨

询服务。

选择的程序是：

- (1) 我公司根据上述标准测试并考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 我公司与被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议；
- (3) 上述佣金包含经手费、证管费和过户费。

本基金本报告期内的租用了中泰证券、西南证券的基金专用交易单元。

### 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 (%)
中泰证券	33,247,353.00	64.11	1,130,500,000.00	99.08	-	-
西南证券	18,615,230.80	35.89	10,500,000.00	0.92	-	-

### 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	华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-2-17
2	华润元大基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-4-1
3	华润元大基金管理有限公司关于费凡代为履行总经理职务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-4-1
4	关于华润元大基金管理有限公司董事、监事变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-4-2
5	华润元大臻选回报混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-5-17
6	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-5-26

7	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-5-26
8	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-6-10

## § 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	2022 年 6 月 8 日至 2022 年 6 月 20 日	0.00	44,819,499.90	0.00	44,819,499.90	19.2174
	2	2022 年 2 月 18 日至 2022 年 6 月 30 日	0.00	100,004,500.00	0.00	100,004,500.00	42.8794
	3	2022 年 6 月 8 日至 2022 年 6 月 30 日	0.00	56,460,355.38	0.00	56,460,355.38	24.2087
	4	2022 年 2 月 18 日至 2022 年 6 月 7 日	0.00	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00	0.0000

#### 产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

### 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、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日