

# 上投摩根安裕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：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## 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。

基金托管人交通银行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> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
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> .....	9
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遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	16
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>7 投资组合报告</b> .....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 本报告期投资基金情况.....	53
7.13 投资组合报告附注.....	53
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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的情况 .....	55
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>55</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根安裕回报混合型证券投资基金	
基金简称	上投摩根安裕回报混合	
基金主代码	004823	
交易代码	004823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 13 日	
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	795,747,373.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C
下属分级基金的交易代码	004823	004824
报告期末下属分级基金的份额总额	282,388,311.77 份	513,359,061.59 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求稳健收益作为基金的投资目标，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>在大类资产配置上，本基金通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策的分析和预测，判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势，结合对资金供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析，评估各类别资产的风险收益特征，并加以分析比较，形成对不同类别资产表现的预测，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的配置比例。本基金密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，动态调整各大类资产之间的比例，在严格控制基金下行风险的前提下，力争提高基金收益。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金采用自下而上的分析方法，根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素，结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。对于港股，本基金在分析宏观经济形势和行业发展基础上，精选港股市场中的优质上市企业，有针对性地根据不</p>

	同指标选取具有成长性和投资价值的上市公司构建股票池。 4、其他投资策略：包括股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，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		上投摩根基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	陆志俊
	联系电话	021-38794888	95559
	电子邮箱	services@cifm.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-4888	95559
传真		021-20628400	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		陈兵	任德奇

## 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	http://www.cifm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C
本期已实现收益	6,979,967.32	9,059,256.78
本期利润	978,681.43	-2,887,495.29
加权平均基金份额本期利润	0.0032	-0.0054
本期加权平均净值利润率	0.23%	-0.40%
本期基金份额净值增长率	0.06%	-0.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>	
	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C
期末可供分配利润	119,609,645.54	201,409,912.34
期末可供分配基金份额利润	0.4236	0.3923
期末基金资产净值	401,997,957.31	714,768,973.93
期末基金份额净值	1.4236	1.3923
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>	
	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C
基金份额累计净值增长率	42.36%	39.23%

注：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，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。

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，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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

上投摩根安裕回报混合 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	1.54%	0.39%	2.89%	0.32%	-1.35%	0.07%
过去三个月	2.43%	0.50%	2.60%	0.42%	-0.17%	0.08%
过去六个月	0.06%	0.50%	-1.49%	0.43%	1.55%	0.07%
过去一年	3.12%	0.40%	-0.85%	0.37%	3.97%	0.03%
过去三年	38.48%	0.36%	14.42%	0.38%	24.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	42.36%	0.34%	25.22%	0.39%	17.14%	-0.05%

上投摩根安裕回报混合 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	1.49%	0.39%	2.89%	0.32%	-1.40%	0.07%
过去三个月	2.30%	0.50%	2.60%	0.42%	-0.30%	0.08%
过去六个月	-0.19%	0.50%	-1.49%	0.43%	1.30%	0.07%
过去一年	2.60%	0.39%	-0.85%	0.37%	3.45%	0.02%
过去三年	36.39%	0.36%	14.42%	0.38%	21.97%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	39.23%	0.34%	25.22%	0.39%	14.01%	-0.05%

### 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

上投摩根安裕回报混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2018年9月13日至2022年6月30日)

上投摩根安裕回报混合 A



注：本基金合同生效日为 2018 年 9 月 13 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

上投摩根安裕回报混合 C





注：本基金合同生效日为 2018 年 9 月 13 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2022 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十四只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券

投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根研究驱动股票型证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上投摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、上投摩根优势成长混合型证券投资基金、上投摩根行业睿选股票型证券投资基金、上投摩根安荣回报混合型证券投资基金、上投摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、上投摩根景气甄选混合型证券投资基金、上投摩根均衡优选混合型证券投资基金、上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、

上投摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、上投摩根全景优势股票型证券投资基金、上投摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
唐瑭	本基金基金经理	2021-04-16	-	13 年	唐瑭女士，英国爱丁堡大学硕士，2008 年 2 月至 2010 年 4 月任 JPMorgan(EMEA)分析师。2011 年 3 月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理、基金经理，2015 年 5 月至 2018 年 11 月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，2015 年 12 月至 2020 年 5 月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理，2015 年 12 月至 2018 年 9 月同时担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月至 2021 年 3 月担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 6 月至 2021 年 3 月担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月至 2021 年 3 月担任上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 9 月同时担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 1 月至 2021 年 3 月同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 10 月同时担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 2020 年 5 月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 7 月同时担任上投摩根安

					<p>腾回报混合型证券投资基金基金经理，2019年4月至2020年9月同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月至2021年3月同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理，2019年8月至2020年11月同时担任上投摩根瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理，自2021年4月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金和上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自2021年9月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理，自2021年12月起同时担任上投摩根安荣回报混合型证券投资基金基金经理。</p>
陈圆明	绝对收益投资部总监、本基金基金经理	2019-04-12	-	13年	<p>陈圆明先生，自2009年7月至2010年6月在东海证券有限责任公司任研究员；2010年7月至2011年8月在国联安基金管理有限公司任研究员；2011年8月至2014年9月在国投瑞银基金管理有限公司任研究员、投资经理；2014年9月至2019年2月在鹏华基金管理有限公司任投资经理、绝对收益副总监；2019年2月起加入上投摩根基金管理有限公司，现担任绝对收益投资部总监兼基金经理；自2019年4月起担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金和上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，自2019年11月起同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理，自2021年2月起同时担任上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自2021年7月起同时担任上投摩根安荣回报混合型证券投资基金基金经理，自2021年9月起同时担任上投摩根</p>

					双债增利债券型证券投资基金基金经理。
王娟	本基金基金经理助理	2020-08-24	-	9 年	上海财经大学金融学硕士，现任绝对收益投资部基金经理助理。王娟女士自 2009 年 7 月至 2013 年 6 月在海通期货有限公司研究所担任金融期货部经理；自 2013 年 7 月至 2016 年 10 月在中国农业银行担任金融市场部投资经理；自 2016 年 10 月至 2020 年 8 月在尚腾资本管理有限公司担任投资经理；自 2020 年 8 月加入上投摩根基金管理有限公司，现任绝对收益投资部基金经理助理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

#### 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，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以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相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，

本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

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% 的情形：无。

### 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，宏观形势较为复杂。一方面，受疫情反复，国内经济复产节奏相对缓慢。为了对冲疫情的影响，政府出台一系列稳增长措施，对经济基本面形成支撑。基建投资是主要抓手，表现出最强韧性；地产在地方政策放松的背景下在季末边际回暖；在较高的失业率水平、收入增速缓慢和较高居民杠杆率之下，消费恢复相对最慢，呈现出滞后性。另一方面，全球商品供需结构较为紧张，叠加俄乌冲突的影响，资源品价格快速上行，海外通胀压力增大，美联储加息节奏快于预期，经济增长的节奏受到了较大的影响。中美两国经济周期和货币周期表现出分化的情况。在这样的背景下，债券市场表现较为纠结，到期收益率窄幅震荡，以 10 年期国债到期收益率为例，上半年振幅不足 20bp，整体曲线走平。

权益市场呈 V 型走势。能源相关板块表现出明显的超赢。随着复工的恢复和疫情的好转，以汽车、消费等板块表现更为突出。本基金在报告期内保持了较短的债券久期以获得票息收入为主，股票上以能源、电力、电动车产业链和新能源中游制造业为主，增加了低估值的必选消费品行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根安裕回报混合 A 份额净值增长率为:0.06%，同期业绩比较基准收益率为:-1.49%，

上投摩根安裕回报混合 C 份额净值增长率为:-0.19%，同期业绩比较基准收益率为:-1.49%。

### 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，随着疫情防控态势逐渐向好，经济增长动能逐步恢复。预计稳增长政策持续发力，投资仍将领头带动经济回暖，房地产投资触底反弹方向明确；在十四五重点项目的持续推进和政策

性银行新增信贷支持下，基建投资仍保持高增速。同时需要关注消费刺激政策对消费倾向的修复。因此，债券方面我们仍将以持有收益为主。权益方面，我们将重点关注国内财政发力的“新、旧基建”受益方向、必选消费品板块以及科技股自下而上的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会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

无。

#### 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

无。

### 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

2022 半年度，基金托管人在上投摩根安裕回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2022 半年度，上投摩根基金管理有限公司在上投摩根安裕回报混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2022 半年度，由上投摩根基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关上投摩根安裕回报混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：上投摩根安裕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	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,765,063.12	4,838,425.39
结算备付金		1,821,688.55	4,893,830.64
存出保证金		124,350.78	124,209.73
交易性金融资产	6.4.7.2	1,117,038,230.34	1,401,866,860.11
其中：股票投资		384,595,458.75	368,305,759.31
基金投资		-	-
债券投资		732,442,771.59	1,033,561,100.80
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	-	-
应收清算款		3,107,317.96	5,101,718.61
应收股利		2,814,922.88	32,118.83
应收申购款		557,932.91	68,715.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	12,496,023.41
资产总计		1,128,229,506.54	1,429,421,902.00
<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		7,170,000.00	123,100,000.00



应付清算款		1,365,155.63	648,851.90
应付赎回款		1,327,215.71	713,109.02
应付管理人报酬		651,835.89	775,472.12
应付托管费		139,679.10	166,172.60
应付销售服务费		297,974.62	304,504.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,735.82	29,171.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	500,978.53	418,137.89
负债合计		11,462,575.30	126,155,419.68
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	795,747,373.36	926,090,923.52
未分配利润	6.4.7.8	321,019,557.88	377,175,558.80
净资产合计		1,116,766,931.24	1,303,266,482.32
负债和净资产总计		1,128,229,506.54	1,429,421,902.00

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日,基金份额总额:795,747,373.36 份,其中:

A 类,基金份额净值:1.4236,基金份额:282,388,311.77 份,

C 类,基金份额净值:1.3923,基金份额:513,359,061.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根安裕回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>5,477,333.06</b>	<b>42,490,696.37</b>
1.利息收入		174,205.93	21,803,102.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	86,179.17	287,902.93
债券利息收入		-	20,240,522.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		88,026.76	1,274,676.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,772,071.16	66,969,297.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,371,279.58	50,881,128.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,592,700.19	13,260,558.54
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	7,550,650.55	2,827,609.73
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-17,948,037.96	-46,854,665.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	479,093.93	572,962.38
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,386,146.92</b>	<b>15,257,141.80</b>
1. 管理人报酬		4,030,936.30	8,134,244.15
2. 托管费		863,772.08	2,541,951.19
3. 销售服务费		1,800,317.79	2,702,587.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		546,774.84	209,003.88
其中：卖出回购金融资产支出		546,774.84	209,003.88
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		8,714.53	19,223.51
8. 其他费用	6.4.7.16	135,631.38	1,650,131.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,908,813.86</b>	<b>27,233,554.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,908,813.86</b>	<b>27,233,554.57</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,908,813.86</b>	<b>27,233,554.57</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根安裕回报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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	926,090,923.52	-	377,175,558.80	1,303,266,482.32
二、本期期初净资产（基金净值）	926,090,923.52	-	377,175,558.80	1,303,266,482.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-130,343,550.16	-	-56,156,000.92	-186,499,551.08
（一）、综合收益总额	-	-	-1,908,813.86	-1,908,813.86

(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)	-130,343,550.16	-	-54,247,187.06	-184,590,737.22
其中: 1.基金申购款	234,595,309.16	-	94,083,634.24	328,678,943.40
2.基金赎回款	-364,938,859.32	-	-148,330,821.30	-513,269,680.62
(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、本期期末净资产(基金净值)	795,747,373.36	-	321,019,557.88	1,116,766,931.24
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(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,423,537,117.06	-	496,150,035.22	1,919,687,152.28
二、本期期初净资产(基金净值)	1,423,537,117.06	-	496,150,035.22	1,919,687,152.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	129,810,923.97	-	75,291,038.54	205,101,962.51
(一)、综合收益总额	-	-	27,233,554.57	27,233,554.57
(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)	129,810,923.97	-	48,057,483.97	177,868,407.94
其中: 1.基金申购款	771,463,615.40	-	276,635,356.42	1,048,098,971.82
2.基金赎回款	-641,652,691.43	-	-228,577,872.45	-870,230,563.88
(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、本期期末净资产（基金净值）	1,553,348,041.03	-	571,441,073.76	2,124,789,114.79
-----------------	------------------	---	----------------	------------------

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：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：郭海明，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根安裕回报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[2017]14 号《关于准予上投摩根安裕回报混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2018]594 号《关于准予上投摩根安裕回报混合型证券投资基金变更注册的批复》准予注册，由上投摩根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《上投摩根安裕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基金，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 244,246,093.25 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0606 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 244,328,800.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 82,707.07 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《上投摩根安裕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/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、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 类基金份额和 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《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内

的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权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(须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产(含国内股票及港股通标的股票)占基金资产的 5%-50%，其中港股通标的股票不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券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:沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《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。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 年上半年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

1 会计政策变更的性质、内容和原因

(a) 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。

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。

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和资产支持证券投资, 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。

(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。

(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。(c) 收入/(损失)的确认和计量 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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额 (a) 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 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。 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、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 4,838,425.39 元、4,893,830.64 元、124,209.73 元、12,496,023.41 元、5,101,718.61 元、32,118.83 元和 68,715.28 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、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 4,839,808.76 元、4,896,253.17 元、124,330.45 元、0.00 元、5,101,718.61 元、32,118.83 元和 68,719.28 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 1,401,866,860.11 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 1,414,358,952.90 元。 原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 123,100,000.00 元、648,851.90 元、713,109.02 元、775,472.12 元、166,172.60 元、304,504.34 元、204,166.42 元、-6,826.53 元和 798.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 123,093,173.47 元、648,851.90 元、713,109.02 元、775,472.12 元、166,172.60 元、304,504.34 元、204,166.42 元、0.00 元和 798.00 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”、“卖出回购金融资产款”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”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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	2,765,063.12
等于: 本金	2,763,848.83
加: 应计利息	1,214.29
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,765,063.12

#### 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	398,292,099.18	-	384,595,458.75	-13,696,640.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,173,934.46	211,805,508.76	4,517,843.97
	银行间市场	511,957,886.31	7,462,662.83	1,216,713.69
	合计	717,071,616.64	9,636,597.29	732,442,771.59
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,115,363,715.82	9,636,597.29	1,117,038,230.34	-7,962,082.77

#### 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

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 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	929.25

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	390,953.34
其中：交易所市场	390,390.84
银行间市场	562.50
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	500,978.53

#### 6.4.7.7 实收基金

上投摩根安裕回报混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	409,800,539.04	409,800,539.04
本期申购	133,184,701.92	133,184,701.92
本期赎回（以“-”号填列）	-260,596,929.19	-260,596,929.19
本期末	282,388,311.77	282,388,311.77

上投摩根安裕回报混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	516,290,384.48	516,290,384.48
本期申购	101,410,607.24	101,410,607.24
本期赎回（以“-”号填列）	-104,341,930.13	-104,341,930.13
本期末	513,359,061.59	513,359,061.59

#### 6.4.7.8 未分配利润

上投摩根安裕回报混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	166,627,134.46	6,620,877.19	173,248,011.65
本期利润	6,979,967.32	-6,001,285.89	978,681.43

本期基金份额交易产生的变动数	-52,679,735.35	-1,937,312.19	-54,617,047.54
其中：基金申购款	55,883,746.39	-2,018,798.92	53,864,947.47
基金赎回款	-108,563,481.74	81,486.73	-108,481,995.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	120,927,366.43	-1,317,720.89	119,609,645.54

上投摩根安裕回报混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	195,809,494.42	8,118,052.73	203,927,547.15
本期利润	9,059,256.78	-11,946,752.07	-2,887,495.29
本期基金份额交易产生的变动数	-1,056,354.41	1,426,214.89	369,860.48
其中：基金申购款	39,531,571.43	687,115.34	40,218,686.77
基金赎回款	-40,587,925.84	739,099.55	-39,848,826.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	203,812,396.79	-2,402,484.45	201,409,912.34

**6.4.7.9 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	46,687.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	37,250.10
其他	2,241.37
合计	86,179.17

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	365,426,753.99
减：卖出股票成本总额	367,581,294.80
减：交易费用	1,216,738.77
买卖股票差价收入	-3,371,279.58

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 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	10,319,775.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,272,924.95
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	18,592,700.19

#### 6.4.7.11.2 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	510,983,859.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	493,733,069.64
减：应计利息总额	8,948,689.36
减：交易费用	29,175.64
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	8,272,924.95

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.13 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	7,550,650.55
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	7,550,650.55

#### 6.4.7.14 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	-17,948,037.96
——股票投资	-12,342,866.64

——债券投资	-5,605,171.32
——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	-17,948,037.96

#### 6.4.7.15 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	179,823.81
转换费收入	299,270.12
合计	479,093.93

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2.本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.16 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	3,985.44
账户维护费	22,550.00
合计	135,631.38

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期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
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东

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

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 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	4,030,936.30	8,134,244.15
其中：支付销售机构的客户维护费	680,513.51	1,311,931.21

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.8% / 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	863,772.08	2,541,951.19

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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		
	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C	合计
上投摩根基金管理有 限公司	-	890,521.39	890,521.39
浦发银行	-	4,212.61	4,212.61
交通银行	-	8,817.55	8,817.55
合计	-	903,551.55	903,551.55
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		
	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C	合计
上投摩根基金管理有 限公司	-	829,230.44	829,230.44
浦发银行	-	8,654.50	8,654.50
交通银行	-	16,272.10	16,272.10
合计	-	854,157.04	854,157.04

注：1. 基金销售服务费仅对 C 类基金份额收取。2. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 X 0.5% / 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

单位：人民币元

银行间市场 交易的各关 联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					

银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	6,919,992.78	-	-	-	-
浦发银行	21,462,910.65	-	-	-	-	-

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

上投摩根安裕回报混合 C

份额单位：份

关联方名称	上投摩根安裕回报混合C本期末 2022年6月30日		上投摩根安裕回报混合C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
上海信托	7,582,075.97	1.48%	7,582,075.97	0.82%

#### 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,765,063.12	46,687.70	26,041,194.62	172,506.14

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 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
600941	中国移动	2021-12-24	1-6 个月(含)	新股锁定期内	57.58	60.26	87,363.00	5,030,361.54	5,264,494.38	-
600938	中国海油	2022-04-14	1-6 个月(含)	新股锁定期内	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	96.66	87.82	360.00	34,796.00	31,615.20	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、受限期为流通受限证券原始受限期。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

#### 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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,170,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金是混合型证券投资基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人 风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类 风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险控制的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险 指标进行控管，并提出内控建议。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	30,171,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	41,699,298.10	-
合计	41,699,298.10	30,171,000.00

注：未评级部分为国债及短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无余额。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	188,508,402.55	241,295,400.00
合计	188,508,402.55	241,295,400.00

**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	上年末 2021年12月31日
AAA	242,080,637.52	358,265,300.80
AAA 以下	-	-
未评级	260,154,433.42	403,829,400.00
合计	502,235,070.94	762,094,700.80

注：未评级的债券为国债和政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无余额。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无余额。

**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。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 7,170,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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的组合持仓集中度指标、流通受限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%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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建立了逆回购交易质押品管理制度：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。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,765,063.12	-	-	-	2,765,063.12
结算备付金	1,821,688.55	-	-	-	1,821,688.55
存出保证金	124,350.78	-	-	-	124,350.78
交易性金融资产	469,877,208.93	262,565,562.66	-	384,595,458.75	1,117,038,230.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-



应收证券清算款	-	-	-	3,107,317.96	3,107,317.96
应收利息	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	2,814,922.88	2,814,922.88
应收申购款	1,052.03	-	-	556,880.88	557,932.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	474,589,363.41	262,565,562.66	-	391,074,580.47	1,128,229,506.54
负债					
卖出回购金融资产款	7,170,000.00	-	-	-	7,170,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,365,155.63	1,365,155.63
应付赎回款	-	-	-	1,327,215.71	1,327,215.71
应付管理人报酬	-	-	-	651,835.89	651,835.89
应付托管费	-	-	-	139,679.10	139,679.10
应付销售服务费	-	-	-	297,974.62	297,974.62
应付税费	-	-	-	9,735.82	9,735.82
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	500,978.53	500,978.53
负债总计	7,170,000.00	-	-	4,292,575.30	11,462,575.30
利率敏感度缺口	467,419,363.41	262,565,562.66	-	386,782,005.17	1,116,766,931.24
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,838,425.39	-	-	-	4,838,425.39
结算备付金	4,893,830.64	-	-	-	4,893,830.64
存出保证金	124,209.73	-	-	-	124,209.73
交易性金融资产	551,712,776.40	479,641,324.40	2,207,000.00	368,305,759.31	1,401,866,860.11
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清	-	-	-	5,101,718.61	5,101,718.61

算款					
应收利息	-	-	-	12,496,023.41	12,496,023.41
应收股利	-	-	-	32,118.83	32,118.83
应收申购款	198.81	-	-	68,516.47	68,715.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	561,569,440.97	479,641,324.40	2,207,000.00	386,004,136.63	1,429,421,902.00
负债					
卖出回购金融资产款	123,100,000.00	-	-	-	123,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	648,851.90	648,851.90
应付赎回款	-	-	-	713,109.02	713,109.02
应付管理人报酬	-	-	-	775,472.12	775,472.12
应付托管费	-	-	-	166,172.60	166,172.60
应付销售服务费	-	-	-	304,504.34	304,504.34
应付交易费用	-	-	-	204,166.42	204,166.42
应付税费	-	-	-	29,171.81	29,171.81
应付利息	-	-	-	-6,826.53	-6,826.53
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	220,798.00	220,798.00
负债总计	123,100,000.00	-	-	3,055,419.68	126,155,419.68
利率敏感度缺口	438,469,440.97	479,641,324.40	2,207,000.00	382,948,716.95	1,303,266,482.32

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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：人民币万元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日

	1.市场利率下降 25 个基点	增加约 164	增加约 365
	2.市场利率上升 25 个基点	减少约 163	减少约 361

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 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	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	76,607,714.94	76,607,714.94
应收股利	-	2,814,922.88	2,814,922.88
资产合计	-	79,422,637.82	79,422,637.82
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	-	79,422,637.82	79,422,637.82
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	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	94,580,000.70	94,580,000.70

应收股利	-	32,118.83	32,118.83
资产合计	-	94,612,119.53	94,612,119.53
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	-	94,612,119.53	94,612,119.53

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 397	增加约 473
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 397	减少约 473

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(含国内股票及港股通标的股票)占基金资产的 5%-50%，其中港股通标的股票不超过股票资产的 50%；每个交易日日

终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	384,595,458. 75	34.44	368,305,759.3 1	28.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	134,580,301. 36	12.05	210,566,650.8 0	16.16
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	519,175,760.1 1	46.49	578,872,410.1 1	44.42

#### 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：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4,840	增加约 2,828
	业绩比较基准下降 5%	减少约 4,840	减少约 2,828

## 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	512,547,347.09	565,067,526.93
第二层次	597,862,470.23	832,393,111.23
第三层次	6,628,413.02	4,406,221.95
合计	1,117,038,230.34	1,401,866,860.11

#### 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的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

于 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	384,595,458.75	34.09
	其中：股票	384,595,458.75	34.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	732,442,771.59	64.92
	其中：债券	732,442,771.59	64.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,586,751.67	0.41
8	其他各项资产	6,604,524.53	0.59
9	合计	1,128,229,506.54	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

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	3,911,894.10	0.35
B	采矿业	11,713,886.79	1.05
C	制造业	169,795,928.34	15.20

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,784,890.72	4.19
E	建筑业	6,056,160.00	0.54
F	批发和零售业	4,190,148.20	0.38
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	5,264,494.38	0.47
J	金融业	24,617,655.06	2.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,405,253.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,247,433.22	2.26
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	307,987,743.81	27.58

### 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（%）
A 基础材料	5,371,379.97	0.48
B 消费者非必需品	4,364,684.51	0.39
C 消费者常用品	-	-
D 能源	10,773,478.37	0.96
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	16,760,287.28	1.50
J 公用事业	39,337,884.81	3.52
K 房地产	-	-
合计	76,607,714.94	6.86

### 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	占基金资产净值比例(%)
1	01816	中广核电力	24,210,000.00	39,337,884.81	3.52
2	600674	川投能源	2,119,081.00	25,259,445.52	2.26
3	003816	中国广核	7,687,659.00	21,525,445.20	1.93
4	603588	高能环境	1,726,374.00	19,905,092.22	1.78
5	300415	伊之密	1,083,722.00	19,756,252.06	1.77
6	601318	中国平安	373,754.00	17,450,574.26	1.56
7	00700	腾讯控股	55,300.00	16,760,287.28	1.50
8	601677	明泰铝业	703,740.00	16,749,012.00	1.50
9	000933	神火股份	986,349.00	12,901,444.92	1.16
10	600496	精工钢构	2,661,942.00	12,298,172.04	1.10
11	600580	卧龙电驱	849,164.00	12,244,944.88	1.10
12	00883	中国海洋石油	1,216,000.00	10,773,478.37	0.96
13	002027	分众传媒	1,546,100.00	10,405,253.00	0.93
14	600150	中国船舶	500,438.00	9,498,313.24	0.85
15	000725	京东方 A	2,329,908.00	9,179,837.52	0.82
16	600256	广汇能源	847,047.00	8,927,875.38	0.80
17	002236	大华股份	511,755.00	8,403,017.10	0.75
18	002032	苏泊尔	141,180.00	7,954,081.20	0.71
19	000333	美的集团	130,016.00	7,851,666.24	0.70
20	300151	昌红科技	397,349.00	7,509,896.10	0.67
21	601688	华泰证券	504,724.00	7,167,080.80	0.64
22	603866	桃李面包	403,065.00	6,670,725.75	0.60
23	002158	汉钟精机	261,016.00	6,068,622.00	0.54
24	600491	龙元建设	888,000.00	6,056,160.00	0.54
25	600330	天通股份	464,035.00	5,526,656.85	0.49
26	03993	洛阳钼业	1,434,000.00	5,371,379.97	0.48
27	600323	瀚蓝环境	260,602.00	5,342,341.00	0.48
28	600941	中国移动	87,363.00	5,264,494.38	0.47
29	002353	杰瑞股份	122,809.00	4,949,202.70	0.44
30	688560	明冠新材	131,165.00	4,491,089.60	0.40
31	03998	波司登	1,048,000.00	4,364,684.51	0.39

			0		
32	301177	迪阿股份	56,471.00	4,190,148.20	0.38
33	002982	湘佳股份	94,995.00	3,911,894.10	0.35
34	600426	华鲁恒升	131,952.00	3,852,998.40	0.35
35	300772	运达股份	147,950.00	3,763,848.00	0.34
36	603916	苏博特	122,985.00	3,134,887.65	0.28
37	002415	海康威视	64,641.00	2,340,004.20	0.21
38	002254	泰和新材	134,375.00	2,250,781.25	0.20
39	603105	芯能科技	152,940.00	1,709,869.20	0.15
40	600938	中国海油	84,004.00	1,332,303.44	0.12
41	600988	赤峰黄金	77,519.00	1,236,428.05	0.11
42	002557	洽洽食品	9,977.00	567,990.61	0.05
43	000975	银泰黄金	22,308.00	217,279.92	0.02
44	300616	尚品宅配	1,506.00	42,845.70	0.00
45	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	0.00
46	301219	腾远钴业	360.00	31,615.20	0.00
47	001268	联合精密	409.00	11,337.48	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300415	伊之密	23,946,698.54	1.84
2	000933	神火股份	19,544,288.00	1.50
3	600674	川投能源	19,486,088.18	1.50
4	601688	华泰证券	17,890,028.58	1.37
5	600150	中国船舶	17,265,799.87	1.32
6	600438	通威股份	16,624,921.74	1.28
7	01816	中广核电力	14,775,866.38	1.13
8	003816	中国广核	14,314,357.00	1.10
9	600256	广汇能源	14,185,570.71	1.09
10	601677	明泰铝业	13,951,062.60	1.07
11	600496	精工钢构	13,708,937.00	1.05
12	000333	美的集团	13,278,389.00	1.02
13	600031	三一重工	12,501,750.00	0.96
14	600580	卧龙电驱	10,971,020.09	0.84
15	002027	分众传媒	10,395,475.40	0.80
16	603916	苏博特	10,030,339.36	0.77
17	603699	纽威股份	9,932,562.52	0.76
18	002032	苏泊尔	9,580,247.53	0.74

19	002959	小熊电器	8,535,052.00	0.65
20	300151	昌红科技	7,957,265.00	0.61

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

#### 7.4.2 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	600585	海螺水泥	17,962,916.48	1.38
2	601677	明泰铝业	17,075,235.42	1.31
3	603699	纽威股份	16,855,662.62	1.29
4	600438	通威股份	16,587,753.17	1.27
5	002353	杰瑞股份	15,841,373.95	1.22
6	01816	中广核电力	15,491,967.20	1.19
7	600031	三一重工	14,173,458.54	1.09
8	002982	湘佳股份	13,067,067.57	1.00
9	603916	苏博特	12,864,750.21	0.99
10	000636	风华高科	12,385,693.31	0.95
11	000725	京东方 A	11,310,443.71	0.87
12	300415	伊之密	10,935,237.90	0.84
13	003816	中国广核	10,652,829.80	0.82
14	601318	中国平安	10,475,500.50	0.80
15	600507	方大特钢	10,314,422.24	0.79
16	600150	中国船舶	10,187,276.26	0.78
17	601688	华泰证券	9,315,948.64	0.71
18	600426	华鲁恒升	9,308,173.52	0.71
19	00883	中国海洋石油	9,006,746.76	0.69
20	603588	高能环境	8,898,196.97	0.68

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

#### 7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	396,213,860.88
卖出股票的收入（成交）总额	365,426,753.99

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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	260,744,098.10	23.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,538,221.92	4.61
	其中：政策性金融债	30,958,479.45	2.77
4	企业债券	35,466,107.11	3.18
5	企业短期融资券	10,151,153.97	0.91
6	中期票据	51,454,486.58	4.61
7	可转债（可交换债）	134,580,301.36	12.05
8	同业存单	188,508,402.55	16.88
9	其他	-	-
10	合计	732,442,771.59	65.59

## 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	210004	21 付息国债 04	1,030,000	104,734,096.71	9.38
2	200014	20 付息国债 14	1,010,000	103,876,396.99	9.30
3	132009	17 中油 EB	637,580	67,375,436.77	6.03
4	132015	18 中油 EB	424,190	44,450,986.32	3.98
5	102002261	20 深圳地铁 MTN003	400,000	41,088,376.99	3.68

## 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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 本报告期投资基金情况****7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.13 投资组合报告附注**

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.13.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.13.3 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	124,350.78
2	应收清算款	3,107,317.96
3	应收股利	2,814,922.88
4	应收利息	-
5	应收申购款	557,932.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	6,604,524.53
---	----	--------------

#### 7.13.4 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	132009	17 中油 EB	67,375,436.77	6.03
2	132015	18 中油 EB	44,450,986.32	3.98
3	113044	大秦转债	22,753,878.27	2.04

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中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)	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
上投摩根安裕回报混合 A	5,273	53,553.63	233,737,386.86	82.77%	48,650,924.91	17.23%
上投摩根安裕回报混合 C	6,423	79,925.12	434,267,021.97	84.59%	79,092,039.62	15.41%
合计	11,696	68,035.86	668,004,408.83	83.95%	127,742,964.53	16.05%

### 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	上投摩根安裕回报混合 A	642,271.06	0.2274%
	上投摩根安裕回报混合 C	33.37	0.0000%
	合计	642,304.43	0.0807%

**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的情况**

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	上投摩根安裕回报混合 A	0
	上投摩根安裕回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	上投摩根安裕回报混合 A	0
	上投摩根安裕回报混合 C	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	上投摩根安裕回报混合 A	上投摩根安裕回报混合 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 13 日）基金份额总额	106,828,396.42	137,500,403.90
本报告期期初基金份额总额	409,800,539.04	516,290,384.48
本报告期基金总申购份额	133,184,701.92	101,410,607.24
减：本报告期基金总赎回份额	260,596,929.19	104,341,930.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	282,388,311.77	513,359,061.59

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**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**

基金管理人：无。

基金托管人：本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

**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

报告期内无基金投资策略的改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

#### 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，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

#### 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	
东方证券	1	425,438,193.28	56.19%	420,283.14	55.92%	-
中信建投证券	1	271,709,589.48	35.88%	253,221.74	33.69%	-
中信证券	2	60,031,394.80	7.93%	78,040.92	10.38%	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 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。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、注销席位。

##### 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		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
东方证券	120,686,808.59	99.09%	3,063,476,000.00	100.00%	-	-
中信建投证券	1,102,400.00	0.91%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上投摩根基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2022-01-05
2	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2022-05-05

## 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	207,223,196.69	0.00	18,000,000.00	189,223,196.69	23.78%
	2	20220217-20220630	130,704,195.79	46,240,307.32	0.00	176,944,503.11	22.24%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准上投摩根安裕回报混合型证券投资基金设立的文件；
- 2.《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《上投摩根开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日