

恒越乐享添利混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：恒越基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 17 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 13 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 恒越乐享添利混合 |
| 基金主代码 | 012572 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 154,645,069.51 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济环境、国家经济周期、财政货币政策、证券市场流动性等因素综合分析的基础上，结合市场上各大类资产的估值水平及市场情绪的比较分析，评估各类别资产的风险收益特征，适度调整基金资产在股票、债券及现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要通过自下而上精选个股的方式，挖掘具有核心竞争优势且具有一定投资安全边际的优质上市公司股票，构建投资组合。重点投资于符合中国经济结构转型升级的发展方向、具有核心竞争优势、具有持续盈利能力、公司治理结构完善、估值与中长期成长速度相匹配的优质上市公司。</p> <p>(1) 核心竞争优势分析</p> <p>企业的竞争优势是企业获得长期增长的根本动力。本基金将选择具有市场竞争优势的企业，主要考察公司是否拥有难以被竞争对手模仿的竞争优势，提供的产品（或</p> |

服务)是否具有较高的技术壁垒,是否具有良好的销售网络、市场品牌或垄断资源等,是否具有领先的经营模式,是否在行业细分市场中占据较大的市场份额,或拥有较高的市场份额增长率。

(2) 持续盈利能力分析

本基金结合公司所处行业的发展前景及其在行业中的相对竞争地位,分析公司是否具有持续盈利能力。本基金在考察公司盈利能力的同时,还要考察支撑公司保持盈利增长的因素是否具备可持续性。除了从财务角度分析公司的利润率、利润构成、资产收益率及其变化、现金流情况等,还要对公司未来盈利状况进行预测,综合考察行业发展前景、下游需求、市场地位和财务结构等方面。

(3) 公司治理结构分析

主要考察公司治理结构是否完善,是否拥有良好的管理团队,是否具备清晰的公司发展战略,是否已建立起市场化的经营机制、企业的信息披露是否公开透明等。

(4) 估值分析

本基金将根据上市公司所处行业、业务模式以及公司发展所处的不同阶段等特征,综合利用市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、市盈率—长期成长法(PEG)、折现现金流法(DCF)等估值方法对公司的估值水平进行比较分析,筛选出估值合理且具有一定投资安全边际的公司进行投资。

3、港股通标的股票投资策略

本基金将充分挖掘资本市场互联互通资金双向流动机制下A股市场和港股市场的投资机会,通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。

本基金将精选基本面良好、具有核心竞争优势,且具有一定投资安全边际的港股通标的股票纳入投资组合。

4、债券投资策略

(1) 久期管理策略

本基金根据中长期宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场的未来走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以控制债券市场下跌的风险。

(2) 期限结构配置策略

本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响外,还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响,如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等,对未来收益率曲线的变化趋势进行研判。本基金基

于对收益率曲线形状和变化趋势的分析和判断，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

（3）信用债投资策略

债券信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金通过对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、债券供需情况等各方面的综合分析，考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，本基金将根据债券发行人的公司背景、行业景气度、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，结合信用评级机构的信用评级，分析违约风险以及合理信用利差水平，选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债，并采取分散化投资策略，严格控制投资组合整体的违约风险水平。

本基金不得主动投资于债项评级低于 AAA 级别的信用债。本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 A-1 级。对于没有债项评级的信用债，上述评级参照主体评级。本基金对信用债券评级的认定，将参照取得中国证监会证券评级业务许可的资信评级机构发布的最新评级结果。

本基金所指信用债包括金融债（不含政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、分离交易可转债的纯债部分以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他非国家信用的固定收益类品种，不包括可转换债券（含分离交易可转债）和可交换债券。

（4）回购策略

本基金将通过回购利率和现券收益率以及其他投资品种收益率的比较，通过回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于回购成本的债券以及其他获利机会，从而获得杠杆放大收益，并根据市场利率水平以及对利率期限结构的预期等，对回购放大的杠杆比例适时进行调整。

5、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券（含交易分离可转债）和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的投资品种，获取稳健的投资回报。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过对市场利率、资产支持证券发行条款、支持资产的构成和质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 流动性等因素的综合分析，在严格控制风险的基础上进行投资，以获得稳定收益。 | |
| | 7、同业存单投资策略 本基金将重点关注同业存单的参考收益率、流动性（日均成交量、发行规模）和期限结构，结合对未来利率走势的判断（经济景气度、季节性因素和货币政策变动等），进行投资决策。 | |
| | 8、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*15%+中证香港 100 指数收益率*5%+中债综合指数（全价）收益率*80% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及香港市场的风险。 | |
| 基金管理人 | 恒越基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 广发证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 恒越乐享添利混合 A | 恒越乐享添利混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012572 | 012573 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 60,934,319.83 份 | 93,710,749.68 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 恒越乐享添利混合 A | 恒越乐享添利混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 284,669.45 | 306,061.37 |
| 2. 本期利润 | 1,504,740.22 | 2,175,501.73 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0219 | 0.0206 |
| 4. 期末基金资产净值 | 59,603,432.24 | 90,975,898.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9782 | 0.9708 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

恒越乐享添利混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.14% | 0.30% | 1.04% | 0.18% | 1.10% | 0.12% |
| 过去六个月 | 1.26% | 0.25% | 1.58% | 0.23% | -0.32% | 0.02% |
| 过去一年 | 0.46% | 0.28% | 0.28% | 0.23% | 0.18% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.18% | 0.24% | -1.87% | 0.24% | -0.31% | 0.00% |

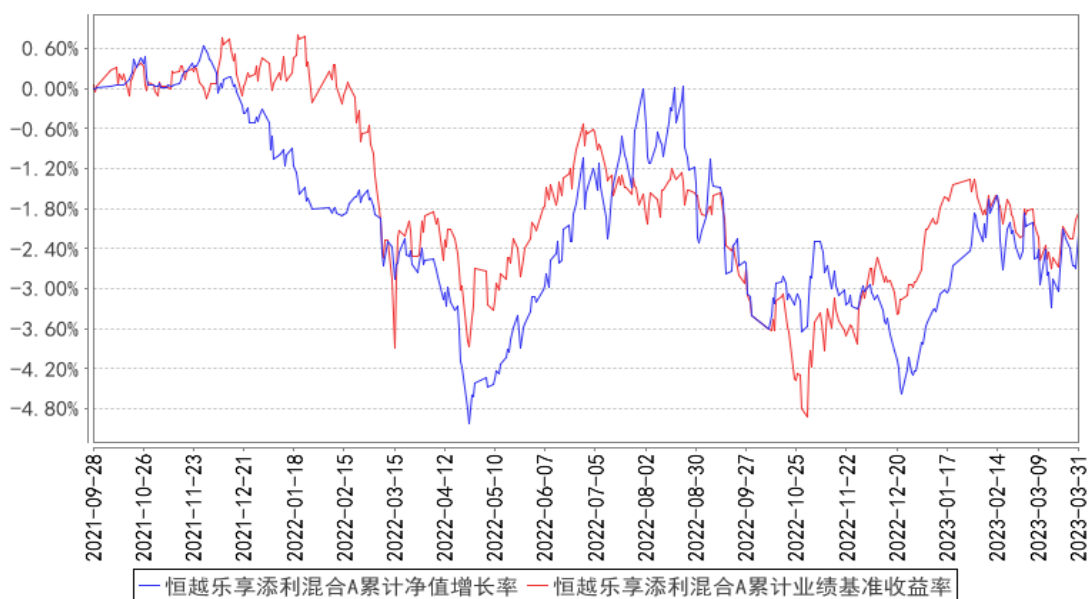
恒越乐享添利混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.01% | 0.30% | 1.04% | 0.18% | 0.97% | 0.12% |
| 过去六个月 | 1.00% | 0.25% | 1.58% | 0.23% | -0.58% | 0.02% |
| 过去一年 | -0.05% | 0.28% | 0.28% | 0.23% | -0.33% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.92% | 0.24% | -1.87% | 0.24% | -1.05% | 0.00% |

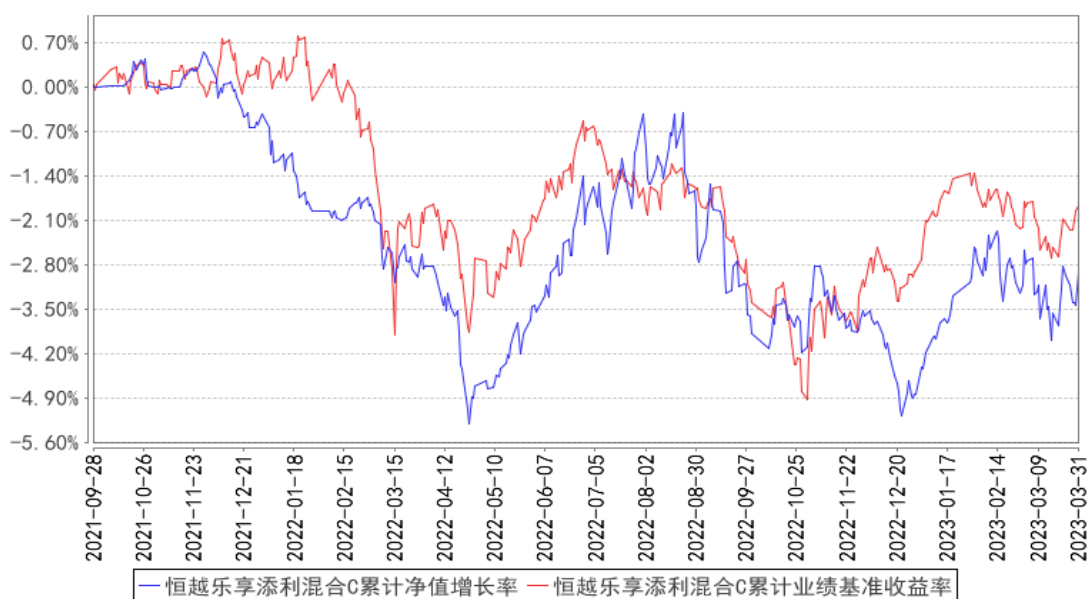
注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 28 日生效。

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

恒越乐享添利混合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



恒越乐享添利混合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



注：本基金基金合同于 2021 年 9 月 28 日生效。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------|------|--------|-------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶佳 | 投资总监助理、固 | 2021年9月28日 | - | 13年 | 曾任银华基金管理有限公司固定收益部研究员、基金经理助理；申万宏源证券有 |

| | | | | | |
|--|----------------------------|--|--|--|---|
| | 定收益部 总监、本 基金基金 经理 | | | | 限公司资产管理事业部,担任债券产品投资主办;东亚前海证券有限公司资产管理部副总经理,债券产品投资主办。 |
|--|----------------------------|--|--|--|---|

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

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金运作合法合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期内, 不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金管理人严格执行了异常交易监控与报告相关制度。本报告期内, 未发现本基金存在异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年一季度, 宏观经济呈现疫后弱复苏态势, 结构分化显著。旅游、餐饮等服务消费随消费场景恢复而强劲回升、地产销售回暖带动部分后周期商品消费改善、财政靠前发力支持基建项目加快开工, 是内需回升的主要动力。但与此同时, 汽车等大宗消费表现较弱, 地产销售回暖向投资传导不畅, 出口继续负增, 拖累复苏斜率。政策层面, 一季度稳增长政策出台有限, 围绕数字经济、一带一路、国央企重估等方面的产业政策较多。流动性层面, 一季度信贷温和扩张, 资金面波动加大但在降准等支持下季末回归均衡偏宽松状态。

海外方面, 一季度频现超预期事件, 海外对美国经济前景和美联储加息预期不断出现调整,

主要资产价格波动较大。2月初美国公布的就业、通胀、零售数据等均大幅超预期，使得市场对美联储加息预期大幅升温，对利率峰值的预测不断调高。3月8日以硅谷银行事件为标志的银行流动性危机爆发，倒逼美联储放缓加息节奏，市场主线重新回到衰退交易。

权益市场，以春节为分界点，市场交易逻辑逐步从经济“强预期”向“弱现实”回归，随后在积极产业政策背景下开启以数字经济、人工智能等为代表的科技板块结构性牛市。年初到春节前主要行业板块几乎普涨，其中有色、计算机、非银金融、新能源、电子、家电等涨幅靠前。春节后，传媒、计算机和通信、电子涨幅分别高达 28%、21.6%、18.7%和 5.8%，“中特估”概念的建筑装饰涨幅 5.9%，电力设备新能源、地产、非银金融、商贸零售、银行领跌。

一季度债券收益率先上后下，春节前在疫情冲击消退后，强经济复苏预期下“十债”上行 12BP 至 2.93%，春节后在“强预期+弱现实”背景下，“十债”小幅下行。2月资金高位波动，NCD 利率持续上行，开门红表现较好，收益率曲线平坦化。3月两会的 GDP 目标略低于市场预期，海外金融风险事件爆发，叠加 3月降准缓解流动性压力，“十债”下行至 2.85%附近，曲线牛陡。一季度随着理财赎回潮逐步平息，信用债配置行情显现，信用表现好于利率，信用利差大幅压缩。

操作上，债券方面，在严控信用风险的前提下，主要以配置利率债和高等级信用债为主以获得稳定的票息，随着权益市场行情的回暖，组合也逐步配置部分优质转债。权益方面，逐步提升权益资产仓位，积极参与数字经济、人工智能等板块的行情，同时也积极关注受益美元下行、行业供给收缩的部分大宗商品板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末恒越乐享添利混合 A 基金份额净值为 0.9782 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.14%；截至本报告期末恒越乐享添利混合 C 基金份额净值为 0.9708 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.01%；同期业绩比较基准收益率为 1.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 39,273,843.94 | 26.02 |
| | 其中：股票 | 39,273,843.94 | 26.02 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 91,735,482.30 | 60.77 |
| | 其中：债券 | 91,735,482.30 | 60.77 |
| | 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 | 4,000,004.00 | 2.65 |
| | 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 | 15,882,730.83 | 10.52 |
| 8 | 其他资产 | 59,952.79 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 150,952,013.86 | 100.00 |

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 6,110,640.60 元，占资产净值比例为 4.06%。

2、本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,482,917.00 | 2.31 |
| C | 制造业 | 19,546,994.74 | 12.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,619.60 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 701,564.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | 689,769.00 | 0.46 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,638,476.00 | 1.09 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,920,227.00 | 3.93 |
| J | 金融业 | 657,696.00 | 0.44 |
| K | 房地产业 | 361,200.00 | 0.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 157,740.00 | 0.10 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |

| | | |
|----|---------------|-------|
| 合计 | 33,163,203.34 | 22.02 |
|----|---------------|-------|

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料 | 539,545.00 | 0.36 |
| 非日常生活消费品 | - | - |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | 1,398,390.00 | 0.93 |
| 金融 | 579,158.00 | 0.38 |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | 2,123,250.00 | 1.41 |
| 信息技术 | 620,574.00 | 0.41 |
| 通信服务 | 553,703.60 | 0.37 |
| 公用事业 | 296,020.00 | 0.20 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 6,110,640.60 | 4.06 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601899 | 紫金矿业 | 118,600 | 1,469,454.00 | 0.98 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 5,500 | 1,408,110.00 | 0.94 |
| 3 | 603019 | 中科曙光 | 29,500 | 1,130,735.00 | 0.75 |
| 4 | 601728 | 中国电信 | 172,800 | 1,093,824.00 | 0.73 |
| 5 | 300418 | 昆仑万维 | 21,900 | 1,024,482.00 | 0.68 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 42,000 | 925,680.00 | 0.61 |
| 7 | 601872 | 招商轮船 | 122,600 | 859,426.00 | 0.57 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 148,000 | 802,160.00 | 0.53 |
| 9 | 002050 | 三花智控 | 31,100 | 800,825.00 | 0.53 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 2,900 | 770,965.00 | 0.51 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,425,536.82 | 3.60 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 21,796,038.25 | 14.47 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,221,794.52 | 6.79 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 50,869,607.68 | 33.78 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 13,644,299.55 | 9.06 |

| | | | |
|----|------|---------------|-------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 91,735,482.30 | 60.92 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 2128015 | 21 农业银行小微债 | 100,000 | 10,399,510.14 | 6.91 |
| 2 | 200207 | 20 国开 07 | 100,000 | 10,221,794.52 | 6.79 |
| 3 | 102001683 | 20 宁舟港 MTN001 | 100,000 | 10,221,230.14 | 6.79 |
| 4 | 102101635 | 21 浦东开发 MTN003 | 100,000 | 10,210,096.44 | 6.78 |
| 5 | 102101826 | 21 中建材集 MTN001 | 100,000 | 10,206,534.25 | 6.78 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金不投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金不投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金不投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金不投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金不投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

根据公开市场信息显示，本报告编制日前一年内，中国农业银行股份有限公司因理财业务存在违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会处以 150 万元的罚款。江苏银行股份有限公司因基金销售业务违反法律法规规定被中国证券监督管理委员会江苏监管局采取责令改正的的行政监督管理措施；因违反账户管理规定等违法行为被中国人民银行处以警告、没收违法所得 42 元以及 773.6 万元的罚款。除此以外，前十名其余证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述证券的投资决策说明：本公司投研团队基于对上述证券的基本面研究，认为上述事件不改变其长期投资价值。本基金管理人对上述证券的投资决策遵循公司的投资决策制度。

5.11.2 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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 18,710.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | 41,241.92 |
| 8 | 合计 | 59,952.79 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 110053 | 苏银转债 | 1,174,733.59 | 0.78 |
| 2 | 123077 | 汉得转债 | 1,135,662.56 | 0.75 |
| 3 | 110085 | 通 22 转债 | 1,002,549.65 | 0.67 |
| 4 | 127020 | 中金转债 | 989,345.96 | 0.66 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 5 | 110089 | 兴发转债 | 986,146.48 | 0.65 |
| 6 | 118008 | 海优转债 | 961,226.53 | 0.64 |
| 7 | 123107 | 温氏转债 | 909,977.22 | 0.60 |
| 8 | 127045 | 牧原转债 | 674,002.91 | 0.45 |
| 9 | 113639 | 华正转债 | 658,768.90 | 0.44 |
| 10 | 118003 | 华兴转债 | 516,295.11 | 0.34 |
| 11 | 123075 | 贝斯转债 | 487,334.40 | 0.32 |
| 12 | 118019 | 金盘转债 | 477,615.52 | 0.32 |
| 13 | 128132 | 交建转债 | 465,928.15 | 0.31 |
| 14 | 113648 | 巨星转债 | 367,739.53 | 0.24 |
| 15 | 113643 | 风语转债 | 332,768.56 | 0.22 |
| 16 | 113530 | 大丰转债 | 325,243.49 | 0.22 |
| 17 | 113647 | 禾丰转债 | 323,655.36 | 0.21 |
| 18 | 128119 | 龙大转债 | 320,427.55 | 0.21 |
| 19 | 113045 | 环旭转债 | 317,240.87 | 0.21 |
| 20 | 128023 | 亚太转债 | 306,899.89 | 0.20 |
| 21 | 110062 | 烽火转债 | 301,211.35 | 0.20 |
| 22 | 111006 | 嵘泰转债 | 275,965.86 | 0.18 |
| 23 | 113631 | 皖天转债 | 192,083.06 | 0.13 |
| 24 | 128097 | 奥佳转债 | 169,004.65 | 0.11 |
| 25 | 123145 | 药石转债 | 146,179.36 | 0.10 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 恒越乐享添利混合 A | 恒越乐享添利混合 C |
|---------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 75,556,010.52 | 119,727,184.60 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,884.31 | 1,499,023.32 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 14,659,575.00 | 27,515,458.24 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 60,934,319.83 | 93,710,749.68 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《恒越乐享添利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《恒越乐享添利混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内恒越乐享添利混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区龙阳路 2277 号 21 楼，基金托管人办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼资产托管部。

9.3 查阅方式

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

恒越基金管理有限公司

2023 年 4 月 17 日