

国融融君灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:国融基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26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2022年6月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| §7 投资组合报告 | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 49 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 49 |
| 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 | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 52 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 57 |
| 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 | 57 |
| 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 | 58 |
| 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 | 58 |
| 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 | 58 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 58 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 58 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 58 |
| §8 基金份额持有人信息 | 60 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 60 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 60 |

| | |
|--|----|
| 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 | 60 |
| §9 开放式基金份额变动 | 60 |
| §10 重大事件揭示 | 61 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 61 |
| 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 | 61 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 61 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 61 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 61 |
| 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 | 61 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 61 |
| 10.8 其他重大事件 | 62 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 64 |
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息 | 64 |
| §12 备查文件目录 | 64 |
| 12.1 备查文件目录 | 64 |
| 12.2 存放地点 | 64 |
| 12.3 查阅方式 | 64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|------------|
| 基金名称 | 国融融君灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国融融君混合 | |
| 基金主代码 | 006231 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年09月12日 | |
| 基金管理人 | 国融基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 国泰君安证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 6,011,435.38份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国融融君混合A | 国融融君混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006231 | 006232 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,977,025.84份 | 34,409.54份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、存托凭证、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30%+上证国债指数收益率×70%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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 | 国融基金管理有限公司 | 国泰君安证券股份有限公司 |

| | | | |
|---------|------|----------------------------|--------------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 毛灵俊 | 帅芳 |
| | 联系电话 | 010-68779199 | 021-38031815 |
| | 电子邮箱 | maolingjun@gowinamc.com | shuaifang@gtjas.com |
| 客户服务电话 | | 4008190098 | 021-38917599-5 |
| 传真 | | 010-88576097 | 021-38677819 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区东大名路687号 1幢4楼440室 | 中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号 |
| 办公地址 | | 北京海淀区西直门外大街168 号腾达大厦20层 | 上海市静安区新闸路669号博 华广场19楼 |
| 邮政编码 | | 100044 | 200041 |
| 法定代表人 | | 侯守法 | 贺青 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.gowinamc.com |
| 基金中期报告备置地点 | 北京海淀区西直门外大街168号腾达大厦20层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------|
| 注册登记机构 | 国融基金管理有限公司 | 北京海淀区西直门外大街168号腾达大厦20层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | | |
|---------------|----------------------------------|---------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日) | |
| | 国融融君混合A | 国融融君混合C |

| | | |
|----------------------|-----------------------|-----------|
| 本期已实现收益 | -883,690.39 | -5,390.37 |
| 本期利润 | -783,276.58 | -4,032.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1271 | -0.1247 |
| 本期加权平均净值利润率 | -9.93% | -9.89% |
| 本期基金份额净值增长率 | -8.90% | -8.99% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 1,661,886.16 | 8,962.16 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2780 | 0.2605 |
| 期末基金资产净值 | 7,638,912.00 | 43,371.70 |
| 期末基金份额净值 | 1.2780 | 1.2605 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 39.36% | 37.52% |

注：1、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；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

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

国融融君混合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 | 2.50% | 0.39% | 2.97% | 0.32% | -0.47% | 0.07% |
| 过去三个月 | 3.73% | 0.55% | 2.73% | 0.43% | 1.00% | 0.12% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月 | -8.90% | 0.92% | -1.22% | 0.44% | -7.68% | 0.48% |
| 过去一年 | -16.69% | 0.97% | -1.02% | 0.38% | -15.67% | 0.59% |
| 过去三年 | 24.38% | 1.06% | 15.54% | 0.38% | 8.84% | 0.68% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.36% | 1.02% | 25.65% | 0.40% | 13.71% | 0.62% |

国融融君混合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 | 2.49% | 0.39% | 2.97% | 0.32% | -0.48% | 0.07% |
| 过去三个月 | 3.68% | 0.55% | 2.73% | 0.43% | 0.95% | 0.12% |
| 过去六个月 | -8.99% | 0.92% | -1.22% | 0.44% | -7.77% | 0.48% |
| 过去一年 | -16.85% | 0.97% | -1.02% | 0.38% | -15.83% | 0.59% |
| 过去三年 | 23.28% | 1.06% | 15.54% | 0.38% | 7.74% | 0.68% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.52% | 1.02% | 25.65% | 0.40% | 11.87% | 0.62% |

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

国融融君混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年09月12日-2022年06月30日)



国融融君混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年09月12日-2022年06月30日)



注：1、本基金合同于 2018 年 9 月 12 日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例符合合同约定。

§ 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

国融基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2017】821号文批准，于2017年6月20日成立，是国融证券发起的公募基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京。公司于2017年7月17日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。

截止本报告期末（2022年6月30日），基金管理人共管理7只公开募集证券投资基金及8只特定客户资产管理计划。其中，公开募集证券投资基金规模为1.71亿元，特定客户资产管理计划规模合计5.23亿元。

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 | | |
| 冯贇 | 本基金的基金经理、权益投资部副总监 | 2020-07-07 | - | 10年 | 冯贇先生，美国密歇根大学应用经济学、金融工程双硕士。具备10年证券从业经验，历任德勤华永会计师事务所税务及商务咨询部咨询员、埃森哲（中国）有限公司资本市场部高级分析师、永诚财产保险股份有限公司资产管理中心中级研究员、国泰君安证券股份有限公司研究所宏观分析师、圆信永丰基金管理有限公司专户投资部投资经理。 |

注：1、基金经理任职日期是基金管理人对外披露的任职日期。

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遵规守信情况的说明

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

公平交易程序包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各投资组合公平获得投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本基金管理人对旗下各投资组合的投资交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行T检验，未发现违反公平交易程序的交易。

本报告期内本基金管理人公平交易程序运作良好，旗下各投资组合不存在因不公平交易等导致的利益输送行为，未出现违反公平交易程序的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，本基金管理人制定《国融基金管理有限公司投资交易风险管理规定》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，本基金管理人严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，未发生同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易或利益输送的异常交易。

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年上半年国内股市和经济经历V型走势，海外经济出现增速放缓、通胀高企的滞涨情形，俄乌冲突加剧通胀上升，美联储加速收紧货币政策，6月一次加息75bp以抗击通胀，海外衰退风险越来越大。国内二季度上海突发疫情，消费和服务业深受影响，

房地产销售同比大幅下滑，俄乌冲突又进一步影响供应链，国内经济增长明显放缓，股市大幅调整。但4月底中央政治局会议布署抗议和稳增长政策后，疫情得到迅速控制，房地产政策放松，地方专项债发行加快，基建开始发力，稳增长不断加码。6月上海解封后，经济很快重拾动力，PMI连续回升，7月PMI重回荣枯线之上。伴随着疫情好转和各项稳增长政策的落地，股市大幅反弹，之前调整较多的光伏、新能源车板块在欧洲能源危机和国内购车补贴刺激下，股价快速上涨收复失地，同时白酒、消费医疗、汽车等领域表现也较好。

本基金以绝对收益为投资目标，坚持价值投资，在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择业绩增长安全边际高的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。在仓位方面，根据合同要求基金净值在1.2-1.3时，股票资产占净资产的比例在35-80%，我们根据市场环境在此范围内适当调整股票仓位。我们二季度将配置重心布局在低估值高股息板块、估值在低位行业出现拐点的稳增长板块、受益价格上涨的周期行业和市场调整后估值趋于合理的医药公司，同时攻守兼备的转债也是我们的配置方向。在报告期间产品净值总体平稳，产品的波动维持在相对较小的范围内。我们将继续坚持绝对收益的理念，以长期稳健的表现穿越不同市场周期，通过净值持续稳定的增长给投资者带来较好的投资体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国融融君混合A基金份额净值为1.2780元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.90%，同期业绩比较基准收益率为-1.22%；截至报告期末国融融君混合C基金份额净值为1.2605元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.99%，同期业绩比较基准收益率为-1.22%。

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，海外受高通胀影响仍将处于加息周期中，9月美联储每月缩表规模将翻倍，10月美国新财年财政预算赤字将大幅下降，四季度开始美国将面临货币财政政策双紧，经济面临衰退风险。欧洲同时面临高通胀和俄乌战争的冲击，7月开始加息，经济已显衰退迹象，对国内外需产生负面影响。国内方面，7月中央政治局会议强调用足用好政策工具箱，压实地方政府责任，保交楼，在政策推动下预计下半年房地产市场将逐步企稳。下半年宽信用推动社融增速继续回升，稳增长政策不断加码，加之上海疫情消退后，社零、服务业将逐步从疫情中恢复，我们预期下半年经济仍能保持平稳增长，经济发展更加注重调结构和高质量增长。

国外经济面临衰退风险，外需面临挑战，国内也面临房地产下行的压力，但总体国内将好于海外。我们预期2022年下半年市场整体震幅将变大，需要更多关注市场的结构性机会，我们选股时会特别关注公司面临国内外复杂环境时的应对能力，同时考虑公司

中长期增长潜力和估值水平的匹配。配置方面关注两条主线，一是估值在低位，行业出现拐点的稳增长板块，二是行业景气度仍处高位，估值仍旧合理的高增长公司，另外疫情后复苏的社服板块也值得关注。

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本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确了基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上，在遵守中国证监会相关规定和基金合同的同时，参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，以确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制定的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。对下属管理的不同基金持有的具有相同特征的同一投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

本基金管理人由公司总经理、分管运营支持部高管、分管投资高管、运营支持部负责人、基金运营部负责人、合规风控部负责人、相关基金经理/投资经理及其所处部门负责人组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术适用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和负责本基金审计业务的会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。托管人在复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格之前，应认真审阅基金管理人采用的估值原则及技术。当对估值原则及技术有异议时，托管人有义务要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人当发生改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的情况时，将所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。此外，会计师事务所出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程的各方之间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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2022年6月30日，国融融君A期末未分配利润为1,661,886.16元（其中：国融融君A的未分配利润已实现部分为3,241,601.65元，未分配利润未实现部分为-1,579,715.49元）；国融融君C期末未分配利润为8,962.16元（其中：国融融君C的未分配利润已实现部分为17,985.11元，未分配利润未实现部分为-9,022.95元）。

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

1、本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

2、本基金自2019年9月12日至2022年6月30日出现连续超六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人前期已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在国融融君灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、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：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,848,709.07 | 1,166,542.31 |
| 结算备付金 | | 14,430.25 | 14,430.25 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 6,015,192.00 | 8,477,393.00 |
| 其中：股票投资 | | 6,015,192.00 | 8,477,393.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,264.72 | 537.64 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 470.85 |
| 资产总计 | | 7,879,596.04 | 9,659,374.05 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 3,657.06 | 586.63 |
| 应付管理人报酬 | | 7,519.08 | 9,515.35 |
| 应付托管费 | | 1,253.19 | 1,585.91 |
| 应付销售服务费 | | 6.60 | 6.25 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 0.02 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 184,876.39 | 200,000.00 |
| 负债合计 | | 197,312.34 | 211,694.14 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 6,011,435.38 | 6,734,760.15 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 1,670,848.32 | 2,712,919.76 |
| 净资产合计 | | 7,682,283.70 | 9,447,679.91 |
| 负债和净资产总计 | | 7,879,596.04 | 9,659,374.05 |

注：（1）报告截止日2022年6月30日，A类基金净值人民币1.2780元，基金份额总额5,977,025.84份，C类基金净值人民币1.2605元，基金份额总额34,409.54份，总份额合计6,011,435.38份。

（2）比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”

科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日至 2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -717,162.98 | 160,455.69 |
| 1. 利息收入 | | 14,042.31 | 15,215.96 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 14,042.31 | 15,215.96 |
| 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 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -833,184.10 | 2,461,695.27 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -936,647.19 | 2,338,929.36 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 44,080.91 | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | 71,440.20 |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 59,382.18 | 51,325.71 |
| 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） | 6.4.7.16 | 101,772.11 | -2,317,054.60 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 206.70 | 599.06 |
| 减：二、营业总支出 | | 70,145.67 | 331,385.51 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 47,338.59 | 98,076.15 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 7,889.81 | 16,346.06 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 40.42 | 202.13 |
| 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 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 0.46 | 643.19 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 14,876.39 | 216,117.98 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -787,308.65 | -170,929.82 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -787,308.65 | -170,929.82 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -787,308.65 | -170,929.82 |

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与

“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
|---|-------------------------------|------------|-------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收 益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 6,734,760.15 | - | 2,712,919.76 | 9,447,679.91 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 (基金净值) | 6,734,760.15 | - | 2,712,919.76 | 9,447,679.91 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列) | -723,324.77 | - | -1,042,071.4 4 | -1,765,396.2 1 |
| (一)、综合收益总 额 | - | - | -787,308.65 | -787,308.65 |
| (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) | -723,324.77 | - | -254,762.79 | -978,087.56 |
| 其中：1. 基金申购款 | 95,704.44 | - | 25,915.58 | 121,620.02 |
| 2. 基金赎回 款 | -819,029.21 | - | -280,678.37 | -1,099,707.5 8 |
| (三)、本期向基金 份额持有人分配利 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------------------------------|------------------------------------|--------|---------------|---------------|
| 润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 6,011,435.38 | - | 1,670,848.32 | 7,682,283.70 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 12,631,214.31 | - | 7,137,349.19 | 19,768,563.50 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 12,631,214.31 | - | 7,137,349.19 | 19,768,563.50 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -3,172,590.88 | - | -2,086,676.99 | -5,259,267.87 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -170,929.82 | -170,929.82 |
| （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） | -3,172,590.88 | - | -1,915,747.17 | -5,088,338.05 |
| 其中：1. 基金申购款 | 273,575.85 | - | 164,998.73 | 438,574.58 |
| 2. 基金赎回款 | -3,446,166.73 | - | -2,080,745.90 | -5,526,912.63 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------------------|--------------|---|--------------|---------------|
| 润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 9,458,623.43 | - | 5,050,672.20 | 14,509,295.63 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

徐进

陈祎杰

侯欣竞

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

国融融君灵活配置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”）《关于准予国融融君灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1122号）批准，由国融基金管理有限公司（以下简称“国融基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《国融融君灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发售，基金合同于2018年9月12日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为281,613,189.42份基金份额。本基金的基金管理人为国融基金，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）。

根据经中国证监会备案的基金合同和《国融融君灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，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 / 申购基金份额时收取认购 / 申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类基金份额基金资产中计提销售服务费，并不收取认购 / 申购费用的基金份额，称为C类基金份额。相关费率及费率水平在本基金招募说明书或相关公告中列示。本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购 / 申购基金份额时可自行选择认购 / 申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国融融君灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于依法发行上市的股

票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为0% - 95%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×30% + 上证国债指数收益率×70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于本报告期内，本基金出现连续超60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况、2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

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

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.4 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

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

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号—金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号—套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号—金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和2022年中国证监会发布的修订的《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>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《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》和《企业会计准则第24号—套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号—金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)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(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来,而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险,因此在新金融工具准则下,本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即2022年1月1日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下:

以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息、应收申购款,对应的账面价值分别为人民币1,166,542.31元、14,430.25元、470.85元、537.64元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币1,167,013.16元、14,430.25元、537.64元和0元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币8,477,393.00元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币8,477,393.00元。

以摊余成本计量的金融负债

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币586.63元、9,515.35元、1,585.91元、6.25元和200,000.00元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币586.63元、9,515.35元、1,585.91元、6.25元和200,000.00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、买入返售金融资产和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，本基金按照新金融工具准则，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、买入返售金融资产和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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

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〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会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〔2015〕101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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》、上证交字〔2008〕16号《上海证券交易所关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《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〕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》、财税〔2017〕2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)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（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款 | 579,646.52 |
| 等于：本金 | 579,365.94 |
| 加：应计利息 | 280.58 |
| 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 | 1,269,062.55 |
| 等于：本金 | 1,268,563.62 |
| 加：应计利息 | 498.93 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 1,848,709.07 |

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | | |
|---------------|--------------------|------|--------------|------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 5,887,577.73 | - | 6,015,192.00 | 127,614.27 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 5,887,577.73 | - | 6,015,192.00 | 127,614.27 |

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

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费用 | 14,876.39 |
| 预提信息披露费 | 170,000.00 |
| 合计 | 184,876.39 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 国融融君混合A

金额单位：人民币元

| 项目 (国融融君混合A) | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-----------------|-------------------------------|------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| | | |

| | | |
|---------------|--------------|--------------|
| 上年度末 | 6,702,744.39 | 6,702,744.39 |
| 本期申购 | 66,353.98 | 66,353.98 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -792,072.53 | -792,072.53 |
| 本期末 | 5,977,025.84 | 5,977,025.84 |

6.4.7.7.2 国融融君混合C

金额单位：人民币元

| 项目 (国融融君混合C) | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-----------------|-------------------------------|------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 32,015.76 | 32,015.76 |
| 本期申购 | 29,350.46 | 29,350.46 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -26,956.68 | -26,956.68 |
| 本期末 | 34,409.54 | 34,409.54 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 国融融君混合A

单位：人民币元

| 项目 (国融融君混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|--------------|---------------|--------------|
| 本期期初 | 4,600,510.35 | -1,899,916.77 | 2,700,593.58 |
| 本期利润 | -883,690.39 | 100,413.81 | -783,276.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -475,218.31 | 219,787.47 | -255,430.84 |
| 其中：基金申购款 | 40,513.53 | -21,813.49 | 18,700.04 |
| 基金赎回款 | -515,731.84 | 241,600.96 | -274,130.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,241,601.65 | -1,579,715.49 | 1,661,886.16 |

6.4.7.8.2 国融融君混合C

单位：人民币元

| 项目 (国融融君混合C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|------------|-----------|-----------|
| 本期期初 | 21,325.10 | -8,998.92 | 12,326.18 |
| 本期利润 | -5,390.37 | 1,358.30 | -4,032.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,050.38 | -1,382.33 | 668.05 |
| 其中：基金申购款 | 17,162.81 | -9,947.27 | 7,215.54 |
| 基金赎回款 | -15,112.43 | 8,564.94 | -6,547.49 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 17,985.11 | -9,022.95 | 8,962.16 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 5,133.99 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 8,908.32 |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 14,042.31 |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 30,467,621.65 |
| 减：卖出股票成本总额 | 31,314,581.78 |
| 减：交易费用 | 89,687.06 |
| 买卖股票差价收入 | -936,647.19 |

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01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 127.41 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 43,953.50 |
| 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 | 44,080.91 |

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01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,746,725.98 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,700,164.16 |
| 减：应计利息总额 | 2,552.43 |
| 减：交易费用 | 55.89 |
| 买卖债券差价收入 | 43,953.50 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 59,382.18 |
| 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 | 59,382.18 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 101,772.11 |
| ——股票投资 | 101,772.11 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 101,772.11 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

| | |
|---------|--------|
| 基金赎回费收入 | 206.70 |
| 合计 | 206.70 |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 14,876.39 |

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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 |
|----------------|---------------------|
| 国融证券股份有限公司 | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 上海谷若投资中心（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 国融基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|----------------------|-------------------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|
| | 成交金额 | 占当期 股票成 交总额 的比例 | 成交金额 | 占当期 股票成 交总额 的比例 |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | 59,218,230.32 | 100.00% | 132,350,530.87 | 100.00% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|----------------------|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| | 成交金额 | 占当期 债券买 卖成交 总额的 比例 | 成交金额 | 占当期 债券买 卖成交 总额的 比例 |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | 3,449,311.26 | 100.00% | - | - |

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金于本报告期及上年度可比期间没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

6.4.10.1.6 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01月01日至2022年06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 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 54,143.22 | 100.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额 |

| | | | | |
|----------------------|------------|---------------------|---|-------------|
| | | 例 | | 的 比 例 |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | 120,613.15 | 10 0. 0 0% | - | - |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至202 2年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日 |
|-----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 47,338.59 | 98,076.15 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16,599.17 | 34,035.71 |

注：支付基金管理人国融基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/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01月01日至2022 年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,889.81 | 16,346.06 |

注：支付基金托管人国泰君安证券的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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01月01日至2022年06月30日 | | |
|----------------|------------------------------------|---------|--------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国融融君混合A | 国融融君混合C | 合计 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 0.00 | 3.74 | 3.74 |
| 合计 | 0.00 | 3.74 | 3.74 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国融融君混合A | 国融融君混合C | 合计 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 0.00 | 201.07 | 201.07 |
| 合计 | 0.00 | 201.07 | 201.07 |

注：本基金A类份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：
国融融君混合C日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末未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

本基金在本报告期末未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间未持有过本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有过本基金。

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01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|--------------|-------------------------------|----------|------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 579,646.52 | 5,133.99 | 1,010,316.23 | 10,207.91 |

注：本基金通过托管人国泰君安证券转存于交通银行上海交银大厦支行的银行存款，于2022年6月30日的相关余额为人民币579,646.52元，本报告期内产生的利息收入为人民币5,133.99元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

于2022年6月30日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2022年6月30日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截止2022年6月30日，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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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、合规风控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在董事会下设立审计合规委员会，负责对公司经营的合法合规性进行监督检查，对经营活动进行审计；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由合规风控部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险管理人员负责投资风险管理及绩效评估。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年0 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 | 1,848,709.07 | - | - | - | - | 1,848,709.07 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | 14,430.25 | 14,430.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 6,015,192.00 | 6,015,192.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 1,264.72 | 1,264.72 |
| 资产总计 | 1,848,709.07 | - | - | - | 6,030,886.97 | 7,879,596.04 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 3,657.06 | 3,657.06 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 7,519.08 | 7,519.08 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 1,253.19 | 1,253.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 6.60 | 6.60 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 0.02 | 0.02 |
| 预提费用 | - | - | - | - | 184,876.39 | 184,876.39 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 197,312.34 | 197,312.34 |
| 利率敏感度缺口 | 1,848,709.07 | - | - | - | 5,833,574.63 | 7,682,283.70 |
| 上年度末 2021年1 2月31 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 | 1,166,542.31 | - | - | - | - | 1,166,542.31 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | 14,430.25 | 14,430.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 8,477,393.00 | 8,477,393.00 |
| 应收利 | - | - | - | - | 470.85 | 470.85 |

| | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|--------------|--------------|
| 息 | | | | | | |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 537.64 | 537.64 |
| 资产总计 | 1,166,542.31 | - | - | - | 8,492,831.74 | 9,659,374.05 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 586.63 | 586.63 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 9,515.35 | 9,515.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 1,585.91 | 1,585.91 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 6.25 | 6.25 |
| 预提费用 | - | - | - | - | 200,000.00 | 200,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 211,694.14 | 211,694.14 |
| 利率敏感度缺口 | 1,166,542.31 | - | - | - | 8,281,137.60 | 9,447,679.91 |

注：表中按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年6月30日及2021年12月31日，本基金未持有对利率敏感的交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 6,015,192.00 | 78.30 | 8,477,393.00 | 89.73 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 6,015,192.00 | 78.30 | 8,477,393.00 | 89.73 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 813,836.88 | 1,025,286.07 |
| | 业绩比较基准下降5% | -813,836.88 | -1,025,286.07 |

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 6,015,192.00 | 8,477,393.00 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 6,015,192.00 | 8,477,393.00 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2021年12月31日：无）。

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工具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之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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 | 6,015,192.00 | 76.34 |
| | 其中：股票 | 6,015,192.00 | 76.34 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 1,863,139.32 | 23.65 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,264.72 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 7,879,596.04 | 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 | 72,386.00 | 0.94 |
| B | 采矿业 | 294,496.00 | 3.83 |
| C | 制造业 | 3,084,924.00 | 40.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 377,842.00 | 4.92 |
| E | 建筑业 | 230,888.00 | 3.01 |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|-------|
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 462,149.00 | 6.02 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 159,785.00 | 2.08 |
| J | 金融业 | 494,649.00 | 6.44 |
| K | 房地产业 | 502,382.00 | 6.54 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 185,151.00 | 2.41 |
| 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 | 74,640.00 | 0.97 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 75,900.00 | 0.99 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,015,192.00 | 78.30 |

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 | 600036 | 招商银行 | 5,500 | 232,100.00 | 3.02 |
| 2 | 601668 | 中国建筑 | 43,400 | 230,888.00 | 3.01 |
| 3 | 600886 | 国投电力 | 21,500 | 225,750.00 | 2.94 |
| 4 | 601156 | 东航物流 | 9,700 | 192,060.00 | 2.50 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 4,100 | 191,429.00 | 2.49 |
| 6 | 300760 | 迈瑞医疗 | 600 | 187,920.00 | 2.45 |
| 7 | 000002 | 万科A | 8,900 | 182,450.00 | 2.37 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 8 | 600223 | 鲁商发展 | 16,200 | 169,776.00 | 2.21 |
| 9 | 603658 | 安图生物 | 3,200 | 156,448.00 | 2.04 |
| 10 | 002832 | 比音勒芬 | 6,200 | 156,240.00 | 2.03 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 4,300 | 155,660.00 | 2.03 |
| 12 | 601006 | 大秦铁路 | 23,200 | 152,888.00 | 1.99 |
| 13 | 600461 | 洪城环境 | 18,800 | 152,092.00 | 1.98 |
| 14 | 600585 | 海螺水泥 | 4,300 | 151,704.00 | 1.97 |
| 15 | 000333 | 美的集团 | 2,500 | 150,975.00 | 1.97 |
| 16 | 601138 | 工业富联 | 15,300 | 150,552.00 | 1.96 |
| 17 | 600048 | 保利发展 | 8,600 | 150,156.00 | 1.95 |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 36,700 | 149,736.00 | 1.95 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 3,800 | 148,010.00 | 1.93 |
| 20 | 002223 | 鱼跃医疗 | 5,700 | 146,262.00 | 1.90 |
| 21 | 600123 | 兰花科创 | 8,800 | 144,760.00 | 1.88 |
| 22 | 688169 | 石头科技 | 200 | 123,340.00 | 1.61 |
| 23 | 002352 | 顺丰控股 | 2,100 | 117,201.00 | 1.53 |
| 24 | 603259 | 药明康德 | 900 | 93,591.00 | 1.22 |
| 25 | 300347 | 泰格医药 | 800 | 91,560.00 | 1.19 |
| 26 | 603678 | 火炬电子 | 1,900 | 88,939.00 | 1.16 |
| 27 | 300122 | 智飞生物 | 800 | 88,808.00 | 1.16 |
| 28 | 000792 | 盐湖股份 | 2,900 | 86,884.00 | 1.13 |
| 29 | 603712 | 七一二 | 2,700 | 85,050.00 | 1.11 |
| 30 | 600111 | 北方稀土 | 2,400 | 84,384.00 | 1.10 |
| 31 | 600031 | 三一重工 | 4,400 | 83,864.00 | 1.09 |
| 32 | 300737 | 科顺股份 | 6,200 | 81,716.00 | 1.06 |
| 33 | 000858 | 五粮液 | 400 | 80,772.00 | 1.05 |
| 34 | 600150 | 中国船舶 | 4,200 | 79,716.00 | 1.04 |
| 35 | 002555 | 三七互娱 | 3,700 | 78,551.00 | 1.02 |
| 36 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,600 | 78,546.00 | 1.02 |
| 37 | 600079 | 人福医药 | 4,900 | 78,400.00 | 1.02 |
| 38 | 300502 | 新易盛 | 2,900 | 75,980.00 | 0.99 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 39 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,600 | 75,920.00 | 0.99 |
| 40 | 600977 | 中国电影 | 6,600 | 75,900.00 | 0.99 |
| 41 | 600507 | 方大特钢 | 10,700 | 74,793.00 | 0.97 |
| 42 | 300244 | 迪安诊断 | 2,400 | 74,640.00 | 0.97 |
| 43 | 300470 | 中密控股 | 2,100 | 74,109.00 | 0.96 |
| 44 | 002241 | 歌尔股份 | 2,200 | 73,920.00 | 0.96 |
| 45 | 002236 | 大华股份 | 4,500 | 73,890.00 | 0.96 |
| 46 | 002677 | 浙江美大 | 5,000 | 73,350.00 | 0.95 |
| 47 | 300498 | 温氏股份 | 3,400 | 72,386.00 | 0.94 |
| 48 | 300059 | 东方财富 | 2,800 | 71,120.00 | 0.93 |
| 49 | 002230 | 科大讯飞 | 1,700 | 70,074.00 | 0.91 |
| 50 | 600741 | 华域汽车 | 2,200 | 50,600.00 | 0.66 |
| 51 | 601677 | 明泰铝业 | 1,700 | 40,460.00 | 0.53 |
| 52 | 002371 | 北方华创 | 100 | 27,712.00 | 0.36 |
| 53 | 688561 | 奇安信 | 200 | 11,160.00 | 0.15 |

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 | 600036 | 招商银行 | 930,881.00 | 9.85 |
| 2 | 601138 | 工业富联 | 727,765.00 | 7.70 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 629,010.00 | 6.66 |
| 4 | 601615 | 明阳智能 | 623,398.00 | 6.60 |
| 5 | 688188 | 柏楚电子 | 556,642.63 | 5.89 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 499,102.00 | 5.28 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 461,991.00 | 4.89 |
| 8 | 000002 | 万科A | 461,595.00 | 4.89 |
| 9 | 002555 | 三七互娱 | 460,986.80 | 4.88 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 445,325.00 | 4.71 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 11 | 600438 | 通威股份 | 443,955.00 | 4.70 |
| 12 | 002352 | 顺丰控股 | 443,186.00 | 4.69 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 416,618.00 | 4.41 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 403,535.00 | 4.27 |
| 15 | 600111 | 北方稀土 | 391,528.00 | 4.14 |
| 16 | 002236 | 大华股份 | 380,924.00 | 4.03 |
| 17 | 000012 | 南玻A | 372,607.00 | 3.94 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 371,648.00 | 3.93 |
| 19 | 002677 | 浙江美大 | 370,221.00 | 3.92 |
| 20 | 601156 | 东航物流 | 358,546.00 | 3.80 |
| 21 | 600519 | 贵州茅台 | 342,726.00 | 3.63 |
| 22 | 600585 | 海螺水泥 | 338,727.00 | 3.59 |
| 23 | 300502 | 新易盛 | 332,413.00 | 3.52 |
| 24 | 601012 | 隆基绿能 | 326,090.00 | 3.45 |
| 25 | 300750 | 宁德时代 | 319,951.00 | 3.39 |
| 26 | 300408 | 三环集团 | 317,228.00 | 3.36 |
| 27 | 300737 | 科顺股份 | 307,689.00 | 3.26 |
| 28 | 600461 | 洪城环境 | 307,614.00 | 3.26 |
| 29 | 600150 | 中国船舶 | 303,655.00 | 3.21 |
| 30 | 002223 | 鱼跃医疗 | 303,414.00 | 3.21 |
| 31 | 300498 | 温氏股份 | 300,182.00 | 3.18 |
| 32 | 601398 | 工商银行 | 300,020.00 | 3.18 |
| 33 | 000858 | 五粮液 | 295,633.00 | 3.13 |
| 34 | 002415 | 海康威视 | 288,932.00 | 3.06 |
| 35 | 002371 | 北方华创 | 285,509.00 | 3.02 |
| 36 | 601677 | 明泰铝业 | 279,981.00 | 2.96 |
| 37 | 603712 | 七一二 | 279,462.00 | 2.96 |
| 38 | 688561 | 奇安信 | 275,567.79 | 2.92 |
| 39 | 688696 | 极米科技 | 269,176.00 | 2.85 |
| 40 | 600012 | 皖通高速 | 267,483.00 | 2.83 |
| 41 | 600977 | 中国电影 | 266,264.00 | 2.82 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 42 | 688187 | 时代电气 | 259,547.11 | 2.75 |
| 43 | 600350 | 山东高速 | 259,223.00 | 2.74 |
| 44 | 002460 | 赣锋锂业 | 258,850.00 | 2.74 |
| 45 | 601225 | 陕西煤业 | 253,881.00 | 2.69 |
| 46 | 600031 | 三一重工 | 245,090.00 | 2.59 |
| 47 | 600079 | 人福医药 | 244,414.00 | 2.59 |
| 48 | 002384 | 东山精密 | 243,787.00 | 2.58 |
| 49 | 000063 | 中兴通讯 | 239,145.00 | 2.53 |
| 50 | 300699 | 光威复材 | 237,768.00 | 2.52 |
| 51 | 002028 | 思源电气 | 230,455.72 | 2.44 |
| 52 | 300146 | 汤臣倍健 | 229,259.00 | 2.43 |
| 53 | 603658 | 安图生物 | 227,395.00 | 2.41 |
| 54 | 002832 | 比音勒芬 | 227,151.00 | 2.40 |
| 55 | 000937 | 冀中能源 | 225,894.15 | 2.39 |
| 56 | 600123 | 兰花科创 | 223,388.00 | 2.36 |
| 57 | 002230 | 科大讯飞 | 220,822.00 | 2.34 |
| 58 | 600887 | 伊利股份 | 219,843.00 | 2.33 |
| 59 | 300760 | 迈瑞医疗 | 218,105.00 | 2.31 |
| 60 | 600886 | 国投电力 | 217,235.00 | 2.30 |
| 61 | 300244 | 迪安诊断 | 211,466.00 | 2.24 |
| 62 | 300751 | 迈为股份 | 209,241.00 | 2.21 |
| 63 | 601390 | 中国中铁 | 207,045.00 | 2.19 |
| 64 | 600276 | 恒瑞医药 | 204,610.00 | 2.17 |
| 65 | 603877 | 太平鸟 | 203,209.00 | 2.15 |
| 66 | 002466 | 天齐锂业 | 200,745.00 | 2.12 |
| 67 | 000963 | 华东医药 | 200,470.00 | 2.12 |
| 68 | 000423 | 东阿阿胶 | 195,394.00 | 2.07 |

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 | 600036 | 招商银行 | 992,999.00 | 10.51 |
| 2 | 601615 | 明阳智能 | 756,408.00 | 8.01 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 660,039.00 | 6.99 |
| 4 | 002555 | 三七互娱 | 632,813.00 | 6.70 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 598,971.00 | 6.34 |
| 6 | 002677 | 浙江美大 | 577,215.08 | 6.11 |
| 7 | 688188 | 柏楚电子 | 552,694.20 | 5.85 |
| 8 | 601138 | 工业富联 | 549,967.00 | 5.82 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 486,732.00 | 5.15 |
| 10 | 002236 | 大华股份 | 460,760.00 | 4.88 |
| 11 | 300502 | 新易盛 | 435,683.00 | 4.61 |
| 12 | 002594 | 比亚迪 | 395,615.00 | 4.19 |
| 13 | 600461 | 洪城环境 | 382,980.00 | 4.05 |
| 14 | 300408 | 三环集团 | 376,726.00 | 3.99 |
| 15 | 688561 | 奇安信 | 373,590.86 | 3.95 |
| 16 | 600111 | 北方稀土 | 365,584.00 | 3.87 |
| 17 | 688111 | 金山办公 | 364,103.60 | 3.85 |
| 18 | 002027 | 分众传媒 | 359,439.00 | 3.80 |
| 19 | 601888 | 中国中免 | 357,764.00 | 3.79 |
| 20 | 600519 | 贵州茅台 | 350,701.00 | 3.71 |
| 21 | 000858 | 五粮液 | 344,893.00 | 3.65 |
| 22 | 300146 | 汤臣倍健 | 343,633.00 | 3.64 |
| 23 | 002384 | 东山精密 | 341,145.00 | 3.61 |
| 24 | 000012 | 南玻 A | 335,897.00 | 3.56 |
| 25 | 300244 | 迪安诊断 | 335,079.00 | 3.55 |
| 26 | 601677 | 明泰铝业 | 333,886.00 | 3.53 |
| 27 | 601225 | 陕西煤业 | 326,614.00 | 3.46 |
| 28 | 300144 | 宋城演艺 | 325,474.00 | 3.45 |
| 29 | 601012 | 隆基绿能 | 323,108.20 | 3.42 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 30 | 300750 | 宁德时代 | 320,011.00 | 3.39 |
| 31 | 002352 | 顺丰控股 | 315,499.00 | 3.34 |
| 32 | 601398 | 工商银行 | 303,849.00 | 3.22 |
| 33 | 600028 | 中国石化 | 303,072.00 | 3.21 |
| 34 | 603712 | 七一二 | 299,534.00 | 3.17 |
| 35 | 002415 | 海康威视 | 298,466.00 | 3.16 |
| 36 | 002345 | 潮宏基 | 295,984.00 | 3.13 |
| 37 | 601233 | 桐昆股份 | 294,955.00 | 3.12 |
| 38 | 000002 | 万科A | 294,710.00 | 3.12 |
| 39 | 300033 | 同花顺 | 288,834.00 | 3.06 |
| 40 | 601006 | 大秦铁路 | 277,667.00 | 2.94 |
| 41 | 603259 | 药明康德 | 277,236.00 | 2.93 |
| 42 | 600012 | 皖通高速 | 276,179.00 | 2.92 |
| 43 | 000333 | 美的集团 | 275,489.00 | 2.92 |
| 44 | 603658 | 安图生物 | 274,248.00 | 2.90 |
| 45 | 002832 | 比音勒芬 | 272,769.00 | 2.89 |
| 46 | 002460 | 赣锋锂业 | 269,144.00 | 2.85 |
| 47 | 002508 | 老板电器 | 267,341.00 | 2.83 |
| 48 | 600887 | 伊利股份 | 264,961.56 | 2.80 |
| 49 | 688696 | 极米科技 | 263,422.60 | 2.79 |
| 50 | 600031 | 三一重工 | 262,743.00 | 2.78 |
| 51 | 300498 | 温氏股份 | 259,960.00 | 2.75 |
| 52 | 688187 | 时代电气 | 254,937.55 | 2.70 |
| 53 | 600060 | 海信视像 | 254,423.00 | 2.69 |
| 54 | 600350 | 山东高速 | 253,068.00 | 2.68 |
| 55 | 002371 | 北方华创 | 250,854.00 | 2.66 |
| 56 | 000932 | 华菱钢铁 | 247,925.00 | 2.62 |
| 57 | 002230 | 科大讯飞 | 241,203.00 | 2.55 |
| 58 | 603877 | 太平鸟 | 237,921.00 | 2.52 |
| 59 | 000063 | 中兴通讯 | 236,190.00 | 2.50 |
| 60 | 300699 | 光威复材 | 232,198.00 | 2.46 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 61 | 600150 | 中国船舶 | 230,389.00 | 2.44 |
| 62 | 300737 | 科顺股份 | 228,764.00 | 2.42 |
| 63 | 000937 | 冀中能源 | 226,936.00 | 2.40 |
| 64 | 600803 | 新奥股份 | 221,233.00 | 2.34 |
| 65 | 603882 | 金域医学 | 216,127.00 | 2.29 |
| 66 | 000963 | 华东医药 | 211,945.00 | 2.24 |
| 67 | 601899 | 紫金矿业 | 209,950.00 | 2.22 |
| 68 | 002876 | 三利谱 | 208,826.00 | 2.21 |
| 69 | 300751 | 迈为股份 | 207,856.00 | 2.20 |
| 70 | 600276 | 恒瑞医药 | 206,979.00 | 2.19 |
| 71 | 002925 | 盈趣科技 | 203,891.00 | 2.16 |
| 72 | 002466 | 天齐锂业 | 201,647.00 | 2.13 |
| 73 | 601390 | 中国中铁 | 199,324.00 | 2.11 |
| 74 | 002293 | 罗莱生活 | 198,168.00 | 2.10 |
| 75 | 000786 | 北新建材 | 192,045.00 | 2.03 |
| 76 | 002028 | 思源电气 | 191,097.00 | 2.02 |
| 77 | 600977 | 中国电影 | 190,984.00 | 2.02 |

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 | 28,750,608.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 30,467,621.65 |

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除安图生物（证券代码：603658.SH）和比音勒芬（证券代码：002832.SZ）外其他证券的发行主体未发现有被监管部门立案调查，未发现报告编制日以前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、根据2022年5月13日发布的相关公告，安图生物因存在以下问题被上海证券交易所予以监管警示：

2022年4月7日，郑州安图生物工程股份有限公司（以下简称安图生物或公司）披露公告称，因业务发展需要，公司全资子公司郑州安图科技发展有限公司（以下简称安图科技）向招商银行股份有限公司郑州分行（以下简称招商银行）申请开立金额为8,000万元的国内信用证，用于支付公司货款。安图科技于2022年3月31日完成本次融资。公司对上述融资承担连带保证责任。经核实，公司提供担保时，担保对象安图科技资产负债率已超过70%，本次对外担保达到股东大会审议标准。但公司此前仅以董事会、监事会审议方式对安图科技作出年度担保授权，未就本次担保事项履行股东大会决策程序并及时履行信息披露义务。2022年4月21日，公司披露公告称，截至2022年4月8日，安图科技提前归还上述招商银行融资，公司的担保已实质性解除。公司对外担保未按规定履行股东大会决策程序及信息披露义务。

2、根据2022年4月6日发布的相关公告，比音勒芬因存在以下问题被深圳证券交易所出具监管函：

根据公司于2022年3月10日披露的《关于前期会计差错更正的公告》，公司为执行新收入准则，对联营方式收入确认由“净额法”改为“总额法”核算，对2020年度的财

务数据进行追溯调整及对2021年度财务数据进行更正。从而，调增2020年一季度末、上半年末、三季度末、年度末应收账款12,231.95万元、12,231.95万元、12,231.95万元、14,818.43万元；调增2020年一季度、上半年、前三季度、年度营业收入5,297.96万元、12,767.24万元、19,686.67万元、36,572.77万元；调增2021年一季度末、上半年末、三季度末应收账款14,818.43万元、14,818.43万元、14,818.43万元；调增2021年一季度、上半年、前三季度营业收入9,074.83万元、18,792.41万元、25,394.68万元。违规类型为信息披露虚假或严重误导性陈述。

基金管理人判断以上行政处罚不影响公司的正常稳健经营，不影响其长期投资价值，因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

7.12.2 本报告期内，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

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,264.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,264.72 |

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，各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 |
| 国融融君混合A | 3,596 | 1,662.13 | 1,474.81 | 0.02% | 5,975,551.03 | 99.98% |
| 国融融君混合C | 38 | 905.51 | 0.00 | 0.00% | 34,409.54 | 100.00% |
| 合计 | 3,634 | 1,654.22 | 1,474.81 | 0.02% | 6,009,960.57 | 99.98% |

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

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国融融君混合A | 国融融君混合C |
|----------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2018年09月12日)基金份额总额 | 258,610,003.32 | 23,003,186.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 6,702,744.39 | 32,015.76 |

| | | |
|---------------|--------------|-----------|
| 本报告期基金总申购份额 | 66,353.98 | 29,350.46 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 792,072.53 | 26,956.68 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,977,025.84 | 34,409.54 |

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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，根据公司第二届董事会第三十次会议决议自2022年4月26日起聘任陈祎杰女士担任公司副总经理职务。根据公司第二届董事会第三十一次会议决议自2022年5月16日起同意王占祥先生因健康原因辞任公司副总经理兼首席信息官职务。根据公司总经理办公会决议，副总经理陈祎杰女士自2022年5月17日起代管运营支持业务板块。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人诉讼事项。

报告期内未发生涉及托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰君安 | 3 | 59,218,230.32 | 100.00% | 54,143.22 | 100.00% | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 3,449,311.26 | 100.00% | - | - | - | - | - | - |

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；
- (2) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告。

2、本公司使用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公司总办会审批，同意后与被选择的证券经营机构签订相关协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订协议时，要明确签定协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

3、报告期内使用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增交易单元情况：无；
- (2) 本基金报告期内停止使用交易单元情况：无。

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 | 国融基金管理有限公司关于旗下开放式基金2021年年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-01-04 |
| 2 | 国融基金管理有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-01-24 |
| 3 | 国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-01-24 |
| 4 | 国融基金管理有限公司关于注册资本变更的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-01-29 |
| 5 | 国融基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-02-24 |
| 6 | 国融基金管理有限公司关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-03-17 |
| 7 | 国融基金管理有限公司关于增加北京中植基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-03-25 |
| 8 | 国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-03-31 |
| 9 | 国融融君灵活配置混合型证券投资基金2022年第一季度报告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-04-22 |

| | | | |
|----|---|------------|------------|
| 10 | 国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-04-28 |
| 11 | 国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-05-18 |
| 12 | 国融基金管理有限公司关于增加中邮证券有限责任公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-05-20 |
| 13 | 国融基金管理有限公司关于增加华金证券股份有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-06-17 |
| 14 | 国融基金管理有限公司关于注册资本变更的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2022-06-25 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予国融融君灵活配置混合型证券投资基金募集的批复文件；
- (2) 《国融融君灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《国融融君灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《国融融君灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内国融融君灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

国融基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日