

凯石沣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:凯石基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行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。

本报告期自2022年01月01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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
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	58
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
7.11 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	59
§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	61

§9 开放式基金份额变动.....	61
§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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 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.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	凯石沅混合型证券投资基金	
基金简称	凯石沅混合	
基金主代码	007257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月23日	
基金管理人	凯石基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,930,686.65份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	凯石沅混合A	凯石沅混合C
下属分级基金的交易代码	007257	007258
报告期末下属分级基金的份额总额	9,005,315.38份	3,925,371.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估灵活调整各类资产在基金投资组合中的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高

	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		凯石基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段卓立	郭明
	联系电话	021-60431122	010-66105799
	电子邮箱	callcenter@vstonefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-60431122	95588
传真		021-80365001	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区延安东路1号2层	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		上海市黄浦区延安东路1号2层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		200002	100140
法定代表人		陈继武	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.vstonefund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区延安东路1号2层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	凯石基金管理有限公司	上海市黄浦区延安东路1号2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)	
	凯石沔混合A	凯石沔混合C
本期已实现收益	-1,480,707.82	-644,136.90
本期利润	-1,174,705.69	-603,828.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1166	-0.0756
本期加权平均净值利润率	-10.32%	-6.93%
本期基金份额净值增长率	-8.25%	-8.60%
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	1,345,426.80	487,433.90
期末可供分配基金份额利润	0.1494	0.1242
期末基金资产净值	10,350,742.18	4,412,805.17
期末基金份额净值	1.1494	1.1242
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	14.94%	12.42%

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

2、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。

3、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，例如基金的认购、申购、赎回费等，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

凯石沔混合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	9.58%	1.68%	5.58%	0.64%	4.00%	1.04%
过去三个月	2.04%	1.51%	3.84%	0.86%	-1.80%	0.65%
过去六个月	-8.25%	1.27%	-5.46%	0.87%	-2.79%	0.40%
过去一年	-13.24%	1.33%	-7.69%	0.75%	-5.55%	0.58%
自基金合同生效起至今	14.94%	1.29%	10.81%	0.77%	4.13%	0.52%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%。

凯石沔混合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	9.51%	1.68%	5.58%	0.64%	3.93%	1.04%
过去三个月	1.87%	1.51%	3.84%	0.86%	-1.97%	0.65%
过去六个月	-8.60%	1.27%	-5.46%	0.87%	-3.14%	0.40%
过去一年	-13.91%	1.33%	-7.69%	0.75%	-6.22%	0.58%
自基金合同生效起至今	12.42%	1.29%	10.81%	0.77%	1.61%	0.52%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%。

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



§ 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

凯石基金管理有限公司（简称“凯石基金”）是全国首家全自然人持股的“私转公”公募基金管理公司，于2017年5月10日正式成立。公司经营范围为公募基金管理，涉及基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。注册资本金1.5亿元人民币，总部设于上海外滩。

凯石基金传承私募基金优秀的合伙人创业文化，公司股东均来自国内基金行业及其他金融机构，平均金融从业经历超过16年，兼有丰富的金融及公募基金的管理经验，共同打造有利于公募基金稳定发展的公司治理平台。

凯石基金从资产管理业务的本质出发，忠诚履行受托职责，以实现投资人利益为最高目标，将自身利益置于投资人利益之下。秉承“时间见证诚信、专业创造价值”的理念，把凯石基金塑造成有责任、有能力、有追求、敢担当、受投资者尊重和信赖的资产管理机构。

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		
付柏瑞	总经理助理、基金经理	2021-03-04	-	18	中国国籍，硕士，历任华宝兴业基金管理有限公司研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、基金经理，前海开源基金管理有限公司联席投资总监、投资经理等职。
张俊	基金经理	2022-06-16	-	12	中国国籍，硕士，历任湘财证券有限责任公司研究员、平安证券有限责任公司研究员、中泰证券有限责任公司研究员、上海鼎峰明德资产管理有限公司研究总监、

					任国盛证券有限责任公司研究员等。
纪 忆	基金经理助理	2021-08-16	-	2	中国国籍，硕士，历任上海胤胜资产管理有限公司研究员、上海井秀投资管理有限公司研究员、上海创芮企业管理合伙企业（有限合伙）行业研究员、凯石基金管理有限公司研究员，现任公司基金经理助理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《凯石基金管理有限公司公平交易管理办法》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场同一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以严格的行为监控、分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年权益市场呈现“V型”走势，上证综指、深证成指及沪深300指数涨跌幅分别为-6.63%、-13.20%、-9.22%。此外，创业板指涨跌幅为-15.41%。各申万一级行业指数中，表现相对较好的五个行业中，煤炭行业变化幅度为31.38%，交通运输行业变化幅度为-0.71%，综合行业变化幅度为-1.46%，美容护理行业变化幅度为-1.81%，房地产行业变化幅度为-2.32%。表现相对较差的五个行业中，电子行业幅度为-24.46%，计算机行业变化幅度为-23.64%，传媒行业变化幅度为-22.25%，国防军工行业变化幅度-20.05%，环保行业变化幅度为-16.42%。

经济方面：2022年上半年疫情得到有效控制，经济企稳回升。

1-6月，社会消费品零售总额210432亿元，同比下降0.7%。6月社零同比增长3.1%，在疫情趋缓、免征购置税政策等的共同作用下，汽车增速回升30个百分点。

1-6月，全国规模以上工业增加值同比增长3.4%。6月份，规模以上工业增加值同比增长3.9%，环比增长0.84%。

1-6月，全国固定资产投资（不含农户）271430亿元，同比增长6.1%。6月份固定资产投资（不含农户）同比增长5.6%，环比增长0.95%。

从上半年的行业表现来看，先价值、后成长，原因在于：一季度在通胀环境加之疫情导致停工停产和消费场景缺失的情况下，低估值的煤炭、银行、地产等防守板块有所表现。二季度疫情趋缓之下复工复产得到积极推动；国内宏观流动性维持宽松；美债这一压制新能源、半导体、军工等行业的因素迎来缓解；新能源、半导体、军工等行业的拥挤度和估值在4月降至低位，估值压力明显消化，其中光伏、新能源汽车、特高压和储能等行业依然拥有较高的景气度。

投资策略：本基金在一季度选择房地产等行业方向防守，在4月底则成功优选光伏、新能源汽车和储能等景气较强的行业和子行业，配置其中具有核心竞争优势的公司，获取了较好的稳健基础上的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末凯石沔混合A基金份额净值为1.1494元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为-5.46%；截至报告期末凯石沔混合C

基金份额净值为1.1242元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.60%，同期业绩比较基准收益率为-5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，疫情对经济的冲击或将可控，国内宏观流动性或将继续维持宽松，美债这一压制因素或趋向缓和，科技成长风格有望继续受益。长期看A股表现更多会来自基本面业绩驱动，在“双碳”目标的指引和相关政策的刺激下，新能源等科技成长板块的景气度有望持续，随着疫情得到有效控制、经济逐渐企稳，消费板块亦将有所复苏。

本基金继续坚持追求稳健基础上超额收益的稳健配置策略，遵守契约规定的仓位限制要求，股、债平衡配置，选择一批高景气赛道下高成长的上市公司作为配置重点，注重优中选优，选择宏观格局景气(M)好、核心竞争优势(ROE优选)强、增长(G)可持续的好公司。结合经济基本面、市场风险偏好环境、细分子行业估值的综合分析，做好子行业或者公司之间动态轮动配置，做好股、债仓位适度灵活配置，获取稳健收益基础上的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、投资总监、运营总监、基金会计主管、监察稽核人员等成员组成，同时，督察长、相关基金经理、总经理指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；公司总经理、基金会计主管等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、监察稽核人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自2022年01月04日起至2022年02月10日连续23个工作日及自2022年02月18日至2022年05月16日连续56个工作日出现基金资产净值低于五千万元，2022年5月24日起至2022年6月30日连续27个工作日出现基金资产净值低于五千万元。

§ 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，工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：凯石泮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	1,453,986.43	2,672,694.01
结算备付金		3,000,000.00	5,000,000.00

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	10,459,122.45	13,410,916.27
其中：股票投资		10,397,114.00	13,365,417.27
基金投资		-	-
债券投资		62,008.45	45,499.00
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		3,844.44	1,637.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	3,300.41
资产总计		14,916,953.32	21,088,548.08
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		45,914.70	1,432.73
应付管理人报酬		18,118.31	26,974.66
应付托管费		3,019.72	4,495.83
应付销售服务费		2,987.21	4,649.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	83,366.03	165,141.22
负债合计		153,405.97	202,694.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,930,686.65	16,771,276.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,832,860.70	4,114,577.07
净资产合计		14,763,547.35	20,885,853.65
负债和净资产总计		14,916,953.32	21,088,548.08

注：1、报告截止日2022年6月30日，A类基金份额净值1.1494元，C类基金份额净值1.1242元；A类基金份额9,005,315.38份，C类基金份额3,925,371.27份，基金份额总额12,930,686.65份。

6.2 利润表

会计主体：凯石泮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		-1,523,104.10	-1,224,103.23
1. 利息收入		19,590.43	33,801.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,590.43	18,641.77
债券利息收入		-	15,159.48

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）		-2,249,852.39	-368,986.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,279,965.37	280,653.73
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-2,636.87	-707,086.14
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	32,749.85	57,445.80
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）	6.4.7.17	346,310.12	-972,663.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	360,847.74	83,745.64
减：二、营业总支出		255,430.50	1,044,108.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	148,016.58	325,842.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,669.39	54,307.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.	33,562.35	49,390.81

	3		
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		-	-
7. 税金及附加		0.16	5.30
8. 其他费用	6.4.7.20	49,182.02	614,562.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,778,534.60	-2,268,211.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,778,534.60	-2,268,211.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,778,534.60	-2,268,211.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：凯石泮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）	16,771,276.58	-	4,114,577.07	20,885,853.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,771,276.5	-	4,114,577.07	20,885,853.6

(基金净值)	8			5
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-3,840,589.93	-	-2,281,716.37	-6,122,306.30
(一)、综合收益总额	-	-	-1,778,534.60	-1,778,534.60
(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)	-3,840,589.93	-	-503,181.77	-4,343,771.70
其中: 1. 基金申购款	67,291,023.54	-	4,833,657.58	72,124,681.12
2. 基金赎回款	-71,131,613.47	-	-5,336,839.35	-76,468,452.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	12,930,686.65	-	1,832,860.70	14,763,547.35
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)	42,383,043.39	-	16,781,268.04	59,164,311.43
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)	42,383,043.3 9	-	16,781,268.0 4	59,164,311.4 3
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-15,639,084. 13	-	-8,223,892.6 9	-23,862,976. 82
(一)、综合收益总 额	-	-	-2,268,211.4 6	-2,268,211.4 6
(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)	-15,639,084. 13	-	-5,955,681.2 3	-21,594,765. 36
其中: 1. 基金申购款	10,882,377.9 2	-	2,884,757.00	13,767,134.9 2
2. 基金赎回 款	-26,521,462. 05	-	-8,840,438.2 3	-35,361,900. 28
(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)	26,743,959.2 6	-	8,557,375.35	35,301,334.6 1

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署:

李琛

韩璐

卢珊

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

凯石沣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[2019]415号《关于准予凯石沣混合型证券投资基金注册的批复》核准,由凯石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《凯石沣混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币484,581,064.49元,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1900473号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《凯石沣混合型证券投资基金基金合同》于2019年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为484,680,493.72份基金份额,其中认购资金利息折合99,429.23份基金份额。本基金的基金管理人为凯石基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认/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/申购时收取认/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,且不收取认/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《凯石沣混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为30%-75%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 60%+中债总全价指数收益率 \times 40%。

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》、《凯石沔混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表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1月1日至2022年6月30日止期间的 财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2022年6月30日的财务状况以及 2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净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

除下述变更的会计政策外, 本基金本报告期内所采用其他会计政策、会计估计与近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的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[根据投资范围]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。本基金将对其没有控制、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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的[根据投资范围]股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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。除衍生工具

所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的[根据投资范围]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金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的[根据投资范围]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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的[根据投资范围]股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券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利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除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。

6.4.4.10 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确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为

基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

本报告期末未发生外币交易。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别[根据投资范围]股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证

券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市(可转换债券除外)或挂牌转让的固定收益品种,按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

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、应收利息和应收申购款,金额分别为 2,672,694.01 元、5,000,000.00 元、3,300.41 元和 1,637.39 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、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为 2,673,553.10 元、5,000,000.00 元、0.00 元和 3,887.39 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 13,410,916.27 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 13,411,107.59 元。

原金融工具准则下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、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 1,432.73 元、26,974.66 元、4,495.83 元、4,649.64 元、80,140.14 元和 1.08 元。新金融工具准则下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、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,432.73元、26,974.66元、4,495.83元、4,649.64元、80,140.14元和1.08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。

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[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]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。

(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。

(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06月30日
活期存款	54,898.67
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	1,399,087.76
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,453,986.43

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		9,651,276.39	-	10,397,114.00	745,837.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	63,873.01	-	62,008.45	-2,010.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	63,873.01	-	62,008.45	-2,010.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,715,149.40	-	10,459,122.45	-

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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	34,535.35
其中：交易所市场	34,535.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	24,795.19
其他应付	1,720.00
合计	83,366.03

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 凯石沅混合A**

金额单位：人民币元

项目 (凯石沅混合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	11,250,073.73	11,250,073.73
本期申购	52,223.93	52,223.93
本期赎回(以“-”号填列)	-2,296,982.28	-2,296,982.28
本期末	9,005,315.38	9,005,315.38

6.4.7.7.2 凯石洋混合C

金额单位：人民币元

项目 (凯石洋混合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	5,521,202.85	5,521,202.85
本期申购	67,238,799.61	67,238,799.61
本期赎回(以“-”号填列)	-68,834,631.19	-68,834,631.19
本期末	3,925,371.27	3,925,371.27

注：1. 申购含红利再投、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 凯石洋混合A

单位：人民币元

项目 (凯石洋混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,909,577.89	-1,065,005.93	2,844,571.96
本期利润	-1,480,707.82	306,002.13	-1,174,705.69
本期基金份额交易产生的变动数	-527,975.04	203,535.57	-324,439.47
其中：基金申购款	13,491.68	-5,598.55	7,893.13
基金赎回款	-541,466.72	209,134.12	-332,332.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,900,895.03	-555,468.23	1,345,426.80

6.4.7.8.2 凯石洋混合C

单位：人民币元

项目 (凯石洋混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,785,927.86	-515,922.75	1,270,005.11
本期利润	-644,136.90	40,307.99	-603,828.91

本期基金份额交易产生的变动数	-413,733.84	234,991.54	-178,742.30
其中：基金申购款	12,527,923.31	-7,702,158.86	4,825,764.45
基金赎回款	-12,941,657.15	7,937,150.40	-5,004,506.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	728,057.12	-240,623.22	487,433.90

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	5,946.30	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	7,346.36	
结算备付金利息收入	-	
其他	6,297.77	
合计	19,590.43	

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	62,410,895.11	
减：卖出股票成本总额	64,503,854.82	
减：交易费用	187,005.66	
买卖股票差价收入	-2,279,965.37	

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	143.10
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,779.97
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	-2,636.87

6.4.7.12.2 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	21,405.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	24,180.78
减：应计利息总额	-
减：交易费用	4.96
买卖债券差价收入	-2,779.97

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益项目。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 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	32,749.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,749.85

6.4.7.17 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	346,310.12
——股票投资	344,517.18
——债券投资	1,792.94
——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	346,310.12

6.4.7.18 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	360,845.96
转换费收入	1.78
合计	360,847.74

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

6.4.7.20 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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,071.34
信息披露费	24,795.19
审计费用	22,315.49
合计	49,182.02

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

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
凯石基金管理有限公司(“凯石基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海凯石财富基金销售有限公司(“凯石财富”)	受基金管理人的股东控制的公司、基金销售机构
陈继武	基金管理人的股东
李琛	基金管理人的股东
陈敏	基金管理人的股东
王振	基金管理人的股东
兰俊	基金管理人的股东
袁渊	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年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管理费	148,016.58	325,842.83
其中：支付销售机构的客户维护费	60,409.61	158,875.13

注：支付基金管理人凯石基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/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	24,669.39	54,307.17

注：支付基金托管人中国工商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×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		
	凯石沅混合A	凯石沅混合C	合计
凯石基金管理有限公司	0.00	13,458.72	13,458.72
中国工商银行股份有限公司	0.00	2,864.70	2,864.70
合计	0.00	16,323.42	16,323.42

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		
	凯石泮混合A	凯石泮混合C	合计
中国工商银行	0.00	8,291.46	8,291.46
上海凯石财富基金销售有限公司	0.00	0.00	0.00
凯石基金管理有限公司	0.00	1,856.54	1,856.54
合计	0.00	10,148.00	10,148.00
合计	0.00	20,296.00	20,296.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给凯石基金，再由凯石基金计算并支付给各基金销售机构。本基金A类基金份额不计提销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2022年01月01日至2022年06月30日		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
中国工商银行股份有限公司	54,898.67	5,946.30	11,026,805.29	1,981.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常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“预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金”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控制委员会，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；监察稽核部同时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督和风险评估，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、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，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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构中信证券股份有限公司的证券账户内，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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	10,599.88	10,565.00
AAA以下	51,408.57	34,934.00
未评级	-	-
合计	62,008.45	45,499.00

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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，本基金所承担的全部金融负债的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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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%。于2022年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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。于2022年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为11916861.80元，超过经确认的当日净赎回金额。

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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,453,986.43	-	-	-	-	-	1,453,986.43
结算备付金	-	-	-	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
交易性金融资产	-	-	10,599.88	12,708.62	38,699.95	10,397,114.00	10,459,122.45
应收申购款	-	-	-	-	-	3,844.44	3,844.44
资产总计	1,453,986.43	-	10,599.88	12,708.62	38,699.95	13,400,958.44	14,916,953.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,914.70	45,914.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,118.31	18,118.31
应付托管费	-	-	-	-	-	3,019.72	3,019.72
应付销	-	-	-	-	-	2,987.21	2,987.21

售服务费							
其他负债	-	-	-	-	-	83,366.03	83,366.03
负债总计	-	-	-	-	-	153,405.97	153,405.97
利率敏感度缺口	1,453,986.43	-	10,599.88	12,708.62	38,699.95	13,247,552.47	14,763,547.35
上年度末 2021年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,672,694.01	-	-	-	-	-	2,672,694.01
结算备付金	-	-	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
交易性金融资产	10,620.00	-	10,565.00	24,314.00	-	13,365,417.27	13,410,916.27
应收利息	-	-	-	-	-	3,300.41	3,300.41
应收申购款	-	-	-	-	-	1,637.39	1,637.39
资产总计	2,683,314.01	-	10,565.00	24,314.00	-	18,370,355.07	21,088,548.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,432.73	1,432.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,974.66	26,974.66
应付托管费	-	-	-	-	-	4,495.83	4,495.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,649.64	4,649.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	80,140.14	80,140.14
应交税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	-	-	85,001.08	85,001.08
负债总计	-	-	-	-	-	202,694.43	202,694.43
利率敏感度缺口	2,683,314.01	-	10,565.00	24,314.00	-	18,167,660.64	20,885,853.65

注：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

于2022年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.42%(2021年12月31日：0.22%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

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。

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投资比例为基金总资产的30-75%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。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	10,397,114.00	70.42	13,365,417.27	63.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	62,008.45	0.42	45,499.00	0.22
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	10,459,122.45	70.84	13,410,916.27	64.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数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
	1. 沪深300指数上升5%	-	664,049.78
	2. 沪深300指数下降5%	-	-664,049.78

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

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	10,459,122.45	13,400,296.27
第二层次	-	10,620.00
第三层次	-	-
合计	10,459,122.45	13,410,916.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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6月30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	10,397,114.00	69.70

	其中：股票	10,397,114.00	69.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,008.45	0.42
	其中：债券	62,008.45	0.42
	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	4,453,986.43	29.86
8	其他各项资产	3,844.44	0.03
9	合计	14,916,953.32	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,242,286.80	69.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	144,177.00	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,650.20	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,397,114.00	70.42

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沪港通股票。

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	300751	迈为股份	1,500	736,350.00	4.99
2	300750	宁德时代	1,200	640,800.00	4.34
3	688116	天奈科技	3,000	508,440.00	3.44
4	002805	丰元股份	8,100	501,390.00	3.40
5	688556	高测股份	6,075	490,252.50	3.32
6	300432	富临精工	20,600	453,200.00	3.07
7	603659	璞泰来	5,200	438,880.00	2.97
8	002594	比亚迪	1,300	433,537.00	2.94
9	300919	中伟股份	2,900	359,310.00	2.43
10	002531	天顺风能	21,500	354,535.00	2.40
11	300573	兴齐眼药	2,300	352,636.00	2.39
12	300457	赢合科技	12,400	352,284.00	2.39
13	002850	科达利	2,100	333,900.00	2.26
14	688187	时代电气	5,099	331,384.01	2.24
15	688063	派能科技	1,019	318,131.80	2.15

16	000519	中兵红箭	10,300	300,245.00	2.03
17	300763	锦浪科技	1,400	298,200.00	2.02
18	300268	佳沃食品	10,000	297,500.00	2.02
19	688707	振华新材	3,910	295,869.70	2.00
20	002709	天赐材料	4,600	285,476.00	1.93
21	688499	利元亨	1,261	279,059.30	1.89
22	002371	北方华创	1,000	277,120.00	1.88
23	000657	中钨高新	18,300	274,500.00	1.86
24	300014	亿纬锂能	2,800	273,000.00	1.85
25	603985	恒润股份	7,600	213,864.00	1.45
26	300450	先导智能	2,400	151,632.00	1.03
27	300054	鼎龙股份	6,900	146,073.00	0.99
28	300873	海晨股份	5,100	144,177.00	0.98
29	688037	芯源微	988	143,230.36	0.97
30	301071	力量钻石	900	139,617.00	0.95
31	002623	亚玛顿	3,400	136,204.00	0.92
32	003009	中天火箭	623	29,150.17	0.20
33	003021	兆威机电	583	27,849.91	0.19
34	003016	欣贺股份	1,629	13,683.60	0.09
35	003002	壶化股份	921	12,986.10	0.09
36	002996	顺博合金	826	12,555.20	0.09
37	003005	竞业达	412	10,650.20	0.07
38	003025	思进智能	471	9,744.99	0.07
39	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.06
40	003000	劲仔食品	684	6,087.60	0.04
41	003023	彩虹集团	308	5,297.60	0.04

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	600048	保利发展	2,264,612.00	10.84
2	000002	万科A	1,266,221.00	6.06
3	001914	招商积余	1,233,212.00	5.90
4	300750	宁德时代	1,199,291.00	5.74
5	688556	高测股份	1,168,787.96	5.60
6	002709	天赐材料	1,075,265.00	5.15
7	601666	平煤股份	975,904.00	4.67
8	002304	洋河股份	932,325.60	4.46
9	603363	傲农生物	918,813.00	4.40
10	300498	温氏股份	885,504.00	4.24
11	000858	五粮液	862,937.40	4.13
12	600141	兴发集团	803,228.00	3.85
13	000333	美的集团	800,723.00	3.83
14	600522	中天科技	740,795.00	3.55
15	300207	欣旺达	731,123.00	3.50
16	300724	捷佳伟创	725,470.00	3.47
17	002594	比亚迪	723,687.00	3.46
18	688233	神工股份	716,353.55	3.43
19	300769	德方纳米	707,987.00	3.39
20	300432	富临精工	707,368.50	3.39
21	603348	文灿股份	705,656.00	3.38
22	002906	华阳集团	705,537.00	3.38
23	600153	建发股份	696,423.00	3.33
24	002567	唐人神	695,719.00	3.33
25	603369	今世缘	691,265.00	3.31
26	603606	东方电缆	656,904.00	3.15
27	300751	迈为股份	648,525.00	3.11
28	603596	伯特利	643,448.00	3.08
29	300438	鹏辉能源	636,276.00	3.05
30	601155	新城控股	602,911.00	2.89

31	603657	春光科技	588,860.00	2.82
32	688408	中信博	570,689.21	2.73
33	000625	长安汽车	570,003.00	2.73
34	002487	大金重工	558,078.00	2.67
35	002714	牧原股份	553,700.00	2.65
36	600011	华能国际	540,899.00	2.59
37	603063	禾望电气	538,848.00	2.58
38	000707	双环科技	487,500.00	2.33
39	002805	丰元股份	473,319.00	2.27
40	600809	山西汾酒	460,554.00	2.21
41	300896	爱美客	455,286.70	2.18
42	688559	海目星	449,725.24	2.15
43	300861	美畅股份	443,760.00	2.12
44	000519	中兵红箭	436,712.00	2.09
45	688116	天奈科技	432,353.76	2.07
46	000887	中鼎股份	429,076.00	2.05
47	603659	璞泰来	428,102.00	2.05
48	300014	亿纬锂能	424,078.00	2.03

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	600048	保利发展	2,339,535.00	11.20
2	001914	招商积余	1,848,999.00	8.85
3	000002	万科A	1,647,231.00	7.89
4	000858	五粮液	1,451,167.00	6.95
5	601155	新城控股	1,317,260.00	6.31
6	002304	洋河股份	1,116,086.00	5.34

7	603369	今世缘	1,074,723.00	5.15
8	001979	招商蛇口	1,037,877.00	4.97
9	601666	平煤股份	937,687.00	4.49
10	600383	金地集团	906,664.00	4.34
11	002906	华阳集团	868,462.00	4.16
12	002291	星期六	856,570.00	4.10
13	603348	文灿股份	800,348.00	3.83
14	000069	华侨城 A	795,790.00	3.81
15	002709	天赐材料	785,654.00	3.76
16	600519	贵州茅台	764,741.00	3.66
17	000333	美的集团	759,633.00	3.64
18	300498	温氏股份	752,336.00	3.60
19	600141	兴发集团	734,897.00	3.52
20	688556	高测股份	733,215.44	3.51
21	603466	风语筑	728,121.82	3.49
22	000776	广发证券	710,653.00	3.40
23	300724	捷佳伟创	694,459.00	3.33
24	603363	傲农生物	686,417.00	3.29
25	000625	长安汽车	669,304.00	3.20
26	600153	建发股份	651,050.00	3.12
27	688408	中信博	644,062.66	3.08
28	688233	神工股份	632,238.20	3.03
29	600702	舍得酒业	617,414.00	2.96
30	300207	欣旺达	613,667.00	2.94
31	300769	德方纳米	605,759.00	2.90
32	000707	双环科技	595,000.00	2.85
33	300438	鹏辉能源	592,702.00	2.84
34	000514	渝开发	585,493.00	2.80
35	600011	华能国际	580,028.00	2.78
36	002487	大金重工	577,882.00	2.77
37	600522	中天科技	570,888.00	2.73

38	300750	宁德时代	560,810.00	2.69
39	603596	伯特利	548,929.00	2.63
40	002567	唐人神	529,807.00	2.54
41	603657	春光科技	529,169.00	2.53
42	002714	牧原股份	514,179.00	2.46
43	603606	东方电缆	510,464.00	2.44
44	688319	欧林生物	487,588.69	2.33
45	002866	传艺科技	485,709.00	2.33
46	603063	禾望电气	474,714.00	2.27
47	300133	华策影视	459,193.00	2.20
48	300896	爱美客	457,523.00	2.19
49	688559	海目星	454,158.12	2.17
50	000887	中鼎股份	453,005.00	2.17
51	300413	芒果超媒	451,625.00	2.16
52	300861	美畅股份	445,556.00	2.13
53	600809	山西汾酒	437,124.00	2.09
54	600188	兖矿能源	425,430.00	2.04

注：本项的“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	61,191,034.37
卖出股票收入（成交）总额	62,410,895.11

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	62,008.45	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,008.45	0.42

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	127045	牧原转债	300	38,699.95	0.26
2	127022	恒逸转债	100	12,708.62	0.09
3	110059	浦发转债	100	10,599.88	0.07

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,844.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,844.44

7.12.4 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	127045	牧原转债	38,699.95	0.26
2	127022	恒逸转债	12,708.62	0.09
3	110059	浦发转债	10,599.88	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末未存在流通受限股票。

§ 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		基金管理人所有从业人员持有本基金	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
凯石沔混合A	313	28,770.98	0.00	0.00%	9,005,315.38	100.00%	-	-
凯石沔混合C	280	14,019.18	0.00	0.00%	3,925,371.27	100.00%	-	-
合计	593	21,805.54	0.00	0.00%	12,930,686.65	100.00%	8.42	-

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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	凯石沔混合A	8.42	0.00%
	凯石沔混合C	0.00	0.00%
	合计	8.42	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	凯石沔混合A	0~10
	凯石沔混合C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基 金	凯石沔混合A	-
	凯石沔混合C	-
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	凯石沔混合A	凯石沔混合C
基金合同生效日(2019年09月23日)基金份额总额	325,838,171.16	158,842,322.56
本报告期期初基金份额总额	11,250,073.73	5,521,202.85
本报告期基金总申购份额	52,223.93	67,238,799.61
减：本报告期基金总赎回份额	2,296,982.28	68,834,631.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,005,315.38	3,925,371.27

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额。
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自2019年起为本基金提供审计服务至今。

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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
中信建投证券	2	50,531,842.07	40.88%	46,637.23	40.87%	-
中信证券（山东）	2	73,070,087.41	59.12%	67,478.15	59.13%	-

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
中信建投证券	38,793.00	78.16%	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	10,837.20	21.84%	-	-	-	-	-	-

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	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-40天	证券日报、公司官网	2022-01-13
2	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-50天	证券日报、公司官网	2022-01-27
3	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-55天	证券日报、公司官网	2022-02-10
4	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-40天	证券日报、公司官网	2022-04-20
5	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-50天	证券日报、公司官网	2022-05-06
6	关于凯石沅混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告-55天	证券日报、公司官网	2022-05-13

7	凯石泮混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、公司官网	2022-06-17
8	凯石泮混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网	2022-06-21
9	凯石泮混合型证券投资基金招募说明书(2022年第1次更新)	公司官网	2022-06-21
10	凯石基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、公司官网	2022-06-24

§ 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	20220211-20220221	-	16,921,905.41	16,921,905.41	-	0.00%
	2	20220517-20220524	-	25,380,710.66	25,380,710.66	-	0.00%
产品特有风险							
<p>1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立凯石泮混合型证券投资基金的文件
- 2、《凯石泮混合型证券投资基金基金合同》

- 3、《凯石沅混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《凯石沅混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、凯石基金管理有限公司的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内凯石沅混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区延安东路1号2层

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人营业时间免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60431122，公司网址：www.vstonefund.com。

凯石基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日