

中加心享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:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29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01月01日起至2022年06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	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	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
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	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§7 投资组合报告	60
7.1 期末基金资产组合情况	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	74
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	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	76

§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加心享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中加心享混合	
基金主代码	002027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月02日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	771,618,843.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加心享混合A	中加心享混合C
下属分级基金的交易代码	002027	002533
报告期末下属分级基金的份额总额	742,233,015.56份	29,385,828.37份

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上，运用灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，发现并精选能够分享中国经济发展方式调整中的上市公司构建投资组合。在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	$30\% \times \text{沪深300指数收益率} + 70\% \times \text{中债总全价指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平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	中加基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌
	联系电话	400-00-95526
	电子邮箱	service@bobbs.com
客户服务电话	400-00-95526	95595
传真	010-83197627	010-63639132
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100050	100033
法定代表人	夏英	李晓鹏

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.bobbs.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§ 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)	
	中加心享混合A	中加心享混合C
本期已实现收益	-3,848,285.88	-285,669.81
本期利润	6,666,891.96	9,474.35
加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0002
本期加权平均净值利润率	0.71%	0.01%
本期基金份额净值增长率	0.85%	0.81%
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	170,217,114.38	6,972,694.12
期末可供分配基金份额利润	0.2293	0.2373
期末基金资产净值	929,275,450.06	36,780,664.09
期末基金份额净值	1.2520	1.2516
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	40.28%	60.27%

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、对期末可供分配利润，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，不是当期发生额）。

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

中加心享混合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	2.20%	0.23%	2.62%	0.32%	-0.42%	-0.09%

过去三个月	2.42%	0.34%	1.96%	0.43%	0.46%	-0.09%
过去六个月	0.85%	0.34%	-2.80%	0.44%	3.65%	-0.10%
过去一年	2.70%	0.28%	-2.93%	0.38%	5.63%	-0.10%
过去三年	23.06%	0.22%	8.70%	0.37%	14.36%	-0.15%
自基金合同生效起至今	40.28%	0.16%	13.21%	0.37%	27.07%	-0.21%

中加心享混合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	2.18%	0.23%	2.62%	0.32%	-0.44%	-0.09%
过去三个月	2.39%	0.34%	1.96%	0.43%	0.43%	-0.09%
过去六个月	0.81%	0.34%	-2.80%	0.44%	3.61%	-0.10%
过去一年	2.60%	0.28%	-2.93%	0.38%	5.53%	-0.10%
过去三年	22.86%	0.22%	8.70%	0.37%	14.16%	-0.15%
自基金合同生效起至今	60.27%	0.39%	15.64%	0.35%	44.63%	0.04%

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

中加心享混合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
(2015年12月02日-2022年06月30日)



中加心享混合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
(2016年03月29日-2022年06月30日)



§ 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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十二只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金（A/C）、中加中证500指数增强型证券投资基金（A/C）、中加科享混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年国开行债券指数证

券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加消费优选混合型证券投资基金（A/C）、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加龙头精选混合型证券投资基金（A/C）、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加量化研选混合型证券投资基金（A/C）、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
闫沛贤	总经理助理兼固定收益部总监、本基金基金经理	2015-12-28	-	14	闫沛贤先生，英国帝国理工大学金融学硕士。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部，担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司，曾任中加丰泽纯债债券型证券投资基金（2016年12月19日至2018年6月22日）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金（2018年12月13日至2019年12月30日）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（2018年11月27日至2020年11月23日）、中加货币

					<p>市场基金（2013年10月21日至2021年1月29日）、中加颐合纯债债券型证券投资基金（2018年9月13日至2021年11月15日）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（2018年11月8日至2021年11月15日）的基金经理，现任总经理助理兼固定收益部总监、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（2014年3月24日至今）、中加纯债债券型证券投资基金（2014年12月17日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2015年12月28日至今）、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（2019年5月29日至今）、中加科盈混合型证券投资基金（2019年11月29日至今）、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（2022年1月4日至今）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金（2022年4月29日至今）、中加聚享增盈债券型证券投资基金（2022年5月5日至今）、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（2022年6月13日至今）的基金经理。</p>
王梁	本基金基金经理	2019-	-	13	王梁先生，北京交通大学

		10-23			<p>产业经济学硕士。2008年至2015年曾历任山西证券、英大证券研究部、方正证券自营部汽车、机械行业研究员。2015年加入中加基金管理有限公司，担任公司汽车机械行业和主题策略研究员，拥有近10年行业研究经验。2017年起担任中加基金专户投资经理。曾任中加科享混合型证券投资基金（2020年11月4日至2022年4月22日）的基金经理，现任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金（2018年8月14日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2019年10月23日至今）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（2020年04月24日至今）、中加科鑫混合型证券投资基金（2021年5月26日至今）的基金经理。</p>
钟伟	本基金基金经理	2021-08-13	-	12	<p>钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混</p>

				<p>合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（2021年8月13日至今）、中加量化研选混合型证券投资基金（2022年4月11日至今）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（2022年4月22日至今）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4、本基金无基金经理助理。

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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

上半年，债市收益率曲线整体陡峭化，其中1年和10年期国债分别较去年末下行和上行了29BP和4BP，分别至1.95%和2.82%。流动性整体宽松，尤其进入二季度，DR007一改此前围绕7天逆回购利率波动的态势，月均值从2.1%附近降至1.6%-1.8%。主要源于4、5月份多地因疫情被局部封锁，信贷投放节奏放缓；财政减收增支对冲经济压力，央行加快结存利润上缴等因素。虽然资金面保持宽松，但市场对稳增长政策存在担忧，而且在海外输入型通胀压力加大、紧缩周期开启的背景下，国内货币政策继年初超预期降息10BP后，再无更多增量放松空间，叠加有2020年疫后经济复苏、货币政策收紧导致利率大幅上行的前车之鉴，债市整体震荡，短端表现优于长端。

报告期内，债券方面，我们保持仓位和久期的灵活性，一方面，享有一定的票息收益。操作上，在严格甄别信用风险的前提下，买入久期适当票息相对较高的中高信用等级信用债。另一方面，积极把握交易性机会。比如，5月份，在多地疫情管控趋严、资金面宽松的背景下，我们择机参与高流动性利率债波动操作，博弈利率下行带来的资本利得。转债方面，我们选择获利了结，降低仓位，有效控制产品波动。

今年上半年A股市场先抑后扬，波动很大。先后受美国通胀抬升引发的美联储加息、俄乌战争爆发引发的大宗商品价格暴涨、国内新冠疫情反复等不利因素的影响，A股在今年前4个月经历了三波较大幅度的下跌。5月份以来，受国内疫情形势好转和稳增长政策的支持，经济基本面边际得到改善，市场也逐步走出低谷，开启了一轮波澜壮阔的反弹行情。

在报告期内，沪深300、上证50和创业板指的涨跌幅分别为-9.22%、-6.6%和-15.4%，中证500的涨跌幅为-12.3%。

随着市场涨跌趋势的变化，市场的风格也发生明显变化。在4月份之前的下跌过程中，低估的价值风格表现突出，5月份以来的市场反弹中，市场风格又切换为高成长的

风格。前期超跌板块本轮反弹涨幅最大，电力设备、汽车、国防军工、有色金属等板块领涨市场，从底部以来的反弹幅度超过35%。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。报告期内，在市场的下跌过程中，我们适当的进行了仓位调整，但整体仓位变化幅度不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加心享混合A基金份额净值为1.2520元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.85%，同期业绩比较基准收益率为-2.80%；截至报告期末中加心享混合C基金份额净值为1.2516元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.81%，同期业绩比较基准收益率为-2.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体看，债市风险与机会并存，总体维持震荡。一方面，三季度财政缺口补充方式仍不确定，难以支撑基建持续发力。房住不炒、隐债不增等仍制约经济修复的斜率。而且稳增长压力下，货币政策仍需保驾护航，以稳为主，债市上有顶。但另一方面，防疫政策边际调整，存量稳增长政策落地及新增政策酝酿，复工复产稳步推进；加上美联储开启加息周期，抑制货币政策空间，债市下行也有阻力。

在4月经济数据见底之后，5、6月份的规模以上工业增加值同比数据已经连续2个月转正，经济基本面正处于弱复苏的状态。7月份PMI数据又重返枯荣线以下，经济的复苏依然面临较大的压力，虽然海外持续加息，但国内的货币政策短期内不太会发生动摇。国内市场流动性有望继续保持较为宽松的状态。

在投资管理上，我们会坚持采用量化策略进行股票投资管理，力求在较小的回撤幅度下获得稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

5、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、自2022年1月1日至2022年6月30日止，本基金未进行利润分配。

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

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中加心享灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任

何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中加心享灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：中加心享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	12,646,426.04	2,892,611.65
结算备付金		5,328,747.04	6,197,302.38
存出保证金		37,826.69	28,962.79
交易性金融资产	6.4.7.2	1,219,159,458.85	1,094,156,670.61
其中：股票投资		188,652,682.08	181,716,494.87
基金投资		-	-
债券投资		1,030,506,776.77	912,440,175.74

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	-	31,011,335.51
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		-	53,067.93
应收股利		-	-
应收申购款		99,530.05	914,418.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	18,798,681.77
资产总计		1,237,271,988.67	1,154,053,050.81
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		269,001,761.03	77,699,770.00
应付清算款		6,595.57	3,050.81
应付赎回款		363,032.22	257,428.07
应付管理人报酬		472,520.60	678,896.85
应付托管费		157,506.88	226,298.98
应付销售服务费		3,248.87	12,634.88

应付投资顾问费		-	-
应交税费		118,076.57	94,604.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,093,132.78	783,404.80
负债合计		271,215,874.52	79,756,089.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	771,618,843.93	865,358,370.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	194,437,270.22	208,938,591.22
净资产合计		966,056,114.15	1,074,296,961.51
负债和净资产总计		1,237,271,988.67	1,154,053,050.81

注：报告截止日2022年06月30日，A类基金份额净值为1.2520元，A类基金份额总额742,233,015.56份；C类基金份额净值为1.2516元，C类基金份额总额29,385,828.37份，总份额合计771,618,843.93份。

6.2 利润表

会计主体：中加心享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		12,670,874.86	62,572,191.95
1. 利息收入		183,995.36	36,988,784.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	88,618.16	87,412.49
债券利息收入		-	36,741,482.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		95,377.20	159,890.30
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		799,071.68	10,683,981.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,077,494.13	10,650,770.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	22,755,752.29	-1,320,324.41
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	2,120,813.52	1,353,535.14
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）	6.4.7.15	10,810,322.00	14,868,834.38
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	877,485.82	30,591.05
减：二、营业总支出		5,994,508.55	9,614,072.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	3,004,693.02	4,064,721.55
2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,001,564.37	1,354,907.22
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	36,055.42	8,199.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,772,565.02	3,769,136.44
其中：卖出回购金融资产 支出		1,772,565.02	3,769,136.44

6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		57,162.37	101,024.85
8. 其他费用	6.4.7.18	122,468.35	316,082.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,676,366.31	52,958,119.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,676,366.31	52,958,119.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,676,366.31	52,958,119.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中加心享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）	865,358,370.29	-	208,938,591.22	1,074,296,961.51
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）	865,358,370.29	-	208,938,591.22	1,074,296,961.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,739,526.36	-	-14,501,321.00	-108,240,847.36
（一）、综合收益总	-	-	6,676,366.31	6,676,366.31

额				
(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)	-93,739,526.36	-	-21,177,687.31	-114,917,213.67
其中: 1. 基金申购款	343,970,580.43	-	72,833,176.29	416,803,756.72
2. 基金赎回款	-437,710,106.79	-	-94,010,863.60	-531,720,970.39
(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)	771,618,843.93	-	194,437,270.22	966,056,114.15
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)	1,254,646,073.62	-	211,579,639.72	1,466,225,713.34
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)	1,254,646,073.62	-	211,579,639.72	1,466,225,713.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-235,604,548.47	-	11,685,325.75	-223,919,222.72

(一)、综合收益总额	-	-	52,958,119.86	52,958,119.86
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-235,604,548.47	-	-41,272,794.11	-276,877,342.58
其中: 1. 基金申购款	15,424,517.60	-	3,133,039.96	18,557,557.56
2. 基金赎回款	-251,029,066.07	-	-44,405,834.07	-295,434,900.14
(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)	1,019,041,525.15	-	223,264,965.47	1,242,306,490.62

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:

夏英

陈昕

陈昕

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

中加心享灵活配置混合型证券投资基金已经中国证券监督管理委员会2015年7月10日证监许可[2015]1598号《关于准予中加心享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准募集,由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加心享灵活配置混合型证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)。

本基金通过中加基金及北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）的代销网点公开发售，募集期为2015年11月23日至2015年11月27日。本基金于2015年12月2日成立，成立之日基金实收份额为2,772,993,297.72份（含利息转份额人民币48,368.47元），发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

本基金根据申购费、销售服务费的收取方式不同，将基金份额分为不同的类别。申购时收取申购费，不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；申购时不收取申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择申购的基金份额类别。两类份额之间不能转换。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、权证等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款，货币市场工具等）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）。

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。

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06月30日和2021年6月30日的财务状况、2022年中期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

除下文6.4.5.1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 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2022年01月01日至2022年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(一) 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、基金投资及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：

1. 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；
2. 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。

(二) 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。

1. 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。

2. 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(一) 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。

(二) 金融工具的后续计量

1. 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。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

(三) 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：

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；
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：

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 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）。

(四) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备，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间为企业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：

1. 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

2. 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

1. 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
2. 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

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〉》。

(一)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：

1. 金融工具的分类影响

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2,892,611.65元、结算备付金6,197,302.38元、存出保证金28,962.79元、买入返售金融资产31,011,335.51元、应收证券清算款50,017.12元、应收利息18,798,681.77元、应收申购款914,418.17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2,908,940.68元、结算备付金6,200,370.06元、存出保证金28,977.09元、买入返售金融资产31,013,375.68元、应收证券清算款50,017.12元、应收申购款925,209.81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账面价值为1,094,156,670.61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账面价值为1,112,923,109.56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卖出回购金融资产款77,699,770.00元、应付赎回款257,428.07元、应付管理人报酬678,896.85元、应付托管费226,298.98元、应付销售服务费12,634.88元、应付交易费用578,283.67元、应交税费94,604.91元、应付利息-14,514.28元和其他负债219,600.00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卖出回购金融资产款77,685,255.72元、应付赎回款257,428.07元、应付管理人报酬678,896.85元、应付托管费226,298.98元、应付销售服务费12,634.88元、应交税费94,604.91元和其他负债797,883.67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。

(二) 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

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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》、[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务规定，本基金适用的主要税项列示如下：

1. 印花税

(1) 自2008年9月19日起，证券（股票）交易印花税征收方式调整为单边征税，即对出让方按1‰的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

(2) 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东（本基金）支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 企业所得税

(1) 自2014年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

(1) 自2008年10月9日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(2) 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东(本基金)支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东(本基金)应缴纳的个人所得税。

(3) 自2015年9月8日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。对证券投资基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息红利, 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. 增值税

(1) 经国务院批准, 自2016年5月1日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点, 金融业全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。本基金适用不征增值税项目: 存款利息收入。本基金适用免征增值税项目: ①国债、地方政府债利息收入; ②证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的金融商品转让收入; ③金融同业往来利息收入。

(2) 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。

(3) 自2018年1月1日起, 资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务), 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税, 管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外; 管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(4) 增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加, 以实际缴纳的增值税税额为计税依据, 分别按5%、3%和2%的比例缴纳。

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	
等于：本金		12,643,407.71
加：应计利息		3,018.33
减：坏账准备		-
定期存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
其中：存款期限1个月以内		-
存款期限1-3个月		-
存款期限3个月以上		-
其他存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计		12,646,426.04

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	180,287,190.70	-	188,652,682.08	8,365,491.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	1,238,958.57	143,919,938.99	7,681,590.60
	银行间市	12,497,237.78	886,586,837.7	-11,173,254.2

	场	7		8	7
	合计	1,020,262,24 4.09	13,736,196.35	1,030,506,77 6.77	-3,491,663.67
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,200,549,43 4.79	13,736,196.35	1,219,159,45 8.85	4,873,827.71

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

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产（其他应收款和待摊费用）。

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	979,994.43
其中：交易所市场	950,976.53
银行间市场	29,017.90

应付利息	-
预提费用	113,138.35
合计	1,093,132.78

注：预提费用包括预提信息披露费、预提审计费和预提账户维护费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中加心享混合A

金额单位：人民币元

项目 (中加心享混合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	737,911,438.07	737,911,438.07
本期申购	328,458,367.80	328,458,367.80
本期赎回(以“-”号填列)	-324,136,790.31	-324,136,790.31
本期末	742,233,015.56	742,233,015.56

6.4.7.7.2 中加心享混合C

金额单位：人民币元

项目 (中加心享混合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	127,446,932.22	127,446,932.22
本期申购	15,512,212.63	15,512,212.63
本期赎回(以“-”号填列)	-113,573,316.48	-113,573,316.48
本期末	29,385,828.37	29,385,828.37

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中加心享混合A

单位：人民币元

项目 (中加心享混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	171,922,017.74	6,221,538.32	178,143,556.06
本期利润	-3,848,285.88	10,515,177.84	6,666,891.96
本期基金份额交易产生的变动数	2,143,382.52	88,603.96	2,231,986.48
其中：基金申购款	72,089,733.75	-2,868,974.58	69,220,759.17
基金赎回款	-69,946,351.23	2,957,578.54	-66,988,772.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	170,217,114.38	16,825,320.12	187,042,434.50

6.4.7.8.2 中加心享混合C

单位：人民币元

项目 (中加心享混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,779,837.08	15,198.08	30,795,035.16
本期利润	-285,669.81	295,144.16	9,474.35
本期基金份额交易产生的变动数	-23,521,473.15	111,799.36	-23,409,673.79
其中：基金申购款	3,676,860.34	-64,443.22	3,612,417.12
基金赎回款	-27,198,333.49	176,242.58	-27,022,090.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,972,694.12	422,141.60	7,394,835.72

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	36,667.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	50,750.65
其他	1,200.08
合计	88,618.16

注：其他包含存出保证金利息收入和申购款利息收入。

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	958,716,086.94
减：卖出股票成本总额	980,787,562.67
减：交易费用	2,006,018.40
买卖股票差价收入	-24,077,494.13

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	22,480,942.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	274,809.64
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	22,755,752.29

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	2,111,128,256.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,085,944,220.99

减：应计利息总额	24,885,618.57
减：交易费用	23,607.35
买卖债券差价收入	274,809.64

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.14 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	2,120,813.52
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	2,120,813.52

6.4.7.15 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	10,810,322.00
——股票投资	8,275,554.35
——债券投资	2,534,767.65
——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	10,810,322.00

6.4.7.16 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	877,485.82
合计	877,485.82

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所账户维护费	8,730.00
中债登账户维护费	9,000.00
上清所查询费	600.00
合计	122,468.35

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

本报告期不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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在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

本基金在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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在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 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生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	3,004,693.02	4,064,721.55
其中：支付销售机构的客户维护费	298,386.23	45,045.52

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%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*0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,001,564.37	1,354,907.22

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司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		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计
中加基金管理有限公司	0.00	10.86	10.86
北京银行股份有限公司	0.00	850.97	850.97
合计	-	861.83	861.83
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		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计

中加基金 管理有限 公司	0.00	14.82	14.82
北京银行 股份有限 公司	0.00	4,995.82	4,995.82
合计	-	5,010.64	5,010.64

注：本基金仅针对C类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金日基金销售服务费=C类基金前一日基金资产净值*0.10%/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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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自有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

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

报告期末除基金管理人之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
中国光大 银行股份 有限公司	12,646,426.04	36,667.43	3,868,949.55	45,794.06

注：本基金的活期存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688197	首药控股	2022-03-16	6个月以上	首次公开发行带锁定期	39.90	23.20	24,261	968,013.90	562,855.20	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1个月内（含）	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内（含）	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内（含）	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内（含）	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
301233	盛帮股份	2022-06-	1个月内（含）	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.3	58,875.3	-

		24						6	6	
3012 36	软通 动力	2022 -03- 08	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	48.5 9	31.3 8	1,110	53,9 31.2 0	34,8 31.8 0	-
3012 00	大族 数控	2022 -02- 18	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	76.5 6	51.9 2	629	48,1 56.2 4	32,6 57.6 8	-
3012 07	华兰 疫苗	2022 -02- 10	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	56.8 8	56.4 2	569	32,3 64.7 2	32,1 02.9 8	-
3011 50	中一 科技	2022 -04- 14	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	109. 04	82.7 6	378	41,2 17.1 2	31,2 83.2 8	-
3012 06	三元 生物	2022 -01- 26	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	72.8 1	45.6 9	617	44,9 22.3 0	28,1 90.7 3	-
3012 16	万凯 新材	2022 -03- 21	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	35.6 8	29.8 4	896	31,9 69.2 8	26,7 36.6 4	-
3012 19	腾远 钴业	2022 -03- 10	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	96.6 6	87.8 2	288	27,8 36.8 0	25,2 92.1 6	-
3011 39	元道 通信	2022 -06- 30	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	38.4 6	38.4 6	566	21,7 68.3 6	21,7 68.3 6	-
3012	泰恩	2022	6个月以	首次公	19.9	31.3	682	13,5	21,4	-

63	康	-03-22	上	开发行带锁定期	3	8		92.26	01.16	
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	55.57	30.03	618	34,342.26	18,558.54	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-

				期						
3011 23	奕东 电子	2022 -01- 14	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	37.2 3	25.3 9	656	24,4 22.8 8	16,6 55.8 4	-
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	32.6 9	32.0 2	507	16,5 75.0 0	16,2 34.1 4	-
3011 20	新特 电气	2022 -04- 11	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	13.7 3	15.4 9	1,032	14,1 69.3 6	15,9 85.6 8	-
3012 35	华康 医疗	2022 -01- 21	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	39.3 0	37.9 3	418	16,4 27.4 0	15,8 54.7 4	-
3011 17	佳缘 科技	2022 -01- 07	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	46.8 0	54.4 4	262	12,2 61.6 0	14,2 63.2 8	-
3012 48	杰创 智能	2022 -04- 13	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	39.0 7	29.8 7	472	18,4 41.0 4	14,0 98.6 4	-
3011 48	嘉戎 技术	2022 -04- 14	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	38.3 9	23.9 0	516	19,8 09.2 4	12,3 32.4 0	-
3012 58	富士 莱	2022 -03- 21	6个月以 上	首次公 开发行 带锁定 期	48.3 0	41.6 8	295	14,2 48.5 0	12,2 95.6 0	-
3012	和顺	2022	6个月以	首次公	56.6	41.8	261	14,7	10,9	-

37	科技	-03-16	上	开发行带锁定期	9	6		96.09	25.46	
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月以上	首次公开发发行带锁定期	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-

301158	德石股份	2022-01-07	6个月以上	首次公开发行业带锁定期	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月以上	首次公开发行业带锁定期	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月以上	首次公开发行业带锁定期	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月以上	首次公开发行业带锁定期	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

注：1. 根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2. 本基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数量中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2022年06月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金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223,101,761.03元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012105192	21昆明公租SCP002	2022-07-07	103.13	233,000	24,029,864.52
012281966	22云建投SCP005	2022-07-01	100.36	300,000	30,106,610.96
012281982	22云投SCP017	2022-07-01	100.39	300,000	30,116,038.36
012281997	22云建投SCP006	2022-07-01	100.34	200,000	20,067,391.78
012282006	22津城建SCP036	2022-07-01	100.24	279,000	27,968,221.23
101769016	17昆交产MTN001	2022-07-07	104.92	200,000	20,983,396.16
101782016	17威海国资MTN002	2022-07-07	104.85	200,000	20,969,523.29
101801034	18吉林高速MTN002	2022-07-07	107.75	100,000	10,774,764.38
101900044	19津地铁MTN001	2022-07-01	103.10	300,000	30,929,704.11
101900905	19乌经建MTN002	2022-07-07	104.28	300,000	31,282,896.99
合计				2,412,000	247,228,411.78

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额45,900,000.00元，于2022年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理方法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	322,184,425.20	180,219,000.00
合计	322,184,425.20	180,219,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期

融资券。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均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

本基金于本报告期末及上年度末均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	286,450,514.32	310,992,786.14
AAA以下	370,104,801.63	390,916,389.60
未评级	51,767,035.62	30,312,000.00
合计	708,322,351.57	732,221,175.74

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均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

本基金于本报告期末及上年度末均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。

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。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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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，除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(如有)外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，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	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	12,646,426.04	-	-	-	12,646,426.04
结算备付金	5,328,747.04	-	-	-	5,328,747.04
存出保证金	37,826.69	-	-	-	37,826.69
交易性金融资产	833,084,860.89	197,421,915.88	-	188,652,682.08	1,219,159,458.85
应收申购款	-	-	-	99,530.05	99,530.05
资产总计	851,097,860.66	197,421,915.88	-	188,752,212.13	1,237,271,988.67
负债					
卖出回购金融资产款	269,001,761.03	-	-	-	269,001,761.03
应付清算款	-	-	-	6,595.57	6,595.57
应付赎回款	-	-	-	363,032.22	363,032.22
应付管理人报酬	-	-	-	472,520.60	472,520.60
应付托管费	-	-	-	157,506.88	157,506.88
应付销售服务费	-	-	-	3,248.87	3,248.87
应交税费	-	-	-	118,076.57	118,076.57
其他负债	-	-	-	1,093,132.78	1,093,132.78
负债总计	269,001,761.03	-	-	2,214,113.49	271,215,874.52
利率敏感度缺口	582,096,099.63	197,421,915.88	-	186,538,098.64	966,056,114.15
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,892,611.65	-	-	-	2,892,611.65

款					
结算备付金	6,197,302.38	-	-	-	6,197,302.38
存出保证金	28,962.79	-	-	-	28,962.79
交易性金融资产	483,573,155.74	428,867,020.00	-	181,716,494.87	1,094,156,670.61
买入返售金融资产	31,011,335.51	-	-	-	31,011,335.51
应收清算款	-	-	-	53,067.93	53,067.93
其他资产	-	-	-	18,798,681.77	18,798,681.77
应收申购款	-	-	-	914,418.17	914,418.17
资产总计	523,703,368.07	428,867,020.00	-	201,482,662.74	1,154,053,050.81
负债					
卖出回购金融资产款	77,699,770.00	-	-	-	77,699,770.00
应付清算款	-	-	-	3,050.81	3,050.81
应付赎回款	-	-	-	257,428.07	257,428.07
应付管理人报酬	-	-	-	678,896.85	678,896.85
应付托管费	-	-	-	226,298.98	226,298.98
应付销售服务费	-	-	-	12,634.88	12,634.88
应交税费	-	-	-	94,604.91	94,604.91
其他负债	-	-	-	783,404.80	783,404.80
负债总计	77,699,770.00	-	-	2,056,319.30	79,756,089.30
利率敏感度缺口	446,003,598.07	428,867,020.00	-	199,426,343.44	1,074,296,961.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

假设	除市场利率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
	市场利率下降25个基点	1,742,612.63	1,984,557.38
	市场利率上升25个基点	-1,742,612.63	-1,984,557.38

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。本基金的其他价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外,本基金管理人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进行风险度量和分析,以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	188,652,682.08	19.53	181,716,494.87	16.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	1,030,506,776.77	106.67	912,440,175.74	84.93
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	1,219,159,458.85	126.20	1,094,156,670.61	101.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较标准以外的其他市场变量保持不变；Beta系数是根据成立以来的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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%	14,394,141.35	13,691,551.08
	业绩比较基准下降5%	-14,394,141.35	-13,691,551.08

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	239,516,781.19	243,577,698.49
第二层次	978,490,285.88	849,153,742.77
第三层次	1,152,391.78	1,425,229.35
合计	1,219,159,458.85	1,094,156,670.61

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06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、卖出回购金融资产和其他金融负债，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06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	188,652,682.08	15.25
	其中：股票	188,652,682.08	15.25
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,030,506,776.77	83.29
	其中：债券	1,030,506,776.77	83.29
	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	17,975,173.08	1.45
8	其他各项资产	137,356.74	0.01
9	合计	1,237,271,988.67	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	481,474.00	0.05
B	采矿业	10,064,246.00	1.04
C	制造业	105,442,671.39	10.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,118,224.00	0.53
E	建筑业	4,374,412.40	0.45
F	批发和零售业	10,312,294.74	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	12,206,020.06	1.26
H	住宿和餐饮业	57,040.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,619,493.66	0.89
J	金融业	14,765,550.00	1.53
K	房地产业	3,821,582.00	0.40
L	租赁和商务服务业	2,794,215.18	0.29
M	科学研究和技术服务业	1,151,447.56	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,094,263.40	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,862,450.69	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,503,820.00	0.26
S	综合	2,983,477.00	0.31
	合计	188,652,682.08	19.53

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	300037	新宙邦	139,740	7,344,734.40	0.76
2	002352	顺丰控股	99,626	5,560,127.06	0.58
3	601872	招商轮船	738,200	4,252,032.00	0.44
4	002748	世龙实业	272,100	4,024,359.00	0.42
5	600030	中信证券	150,500	3,259,830.00	0.34
6	002383	合众思壮	495,700	2,959,329.00	0.31
7	600486	扬农化工	21,900	2,918,832.00	0.30
8	600673	东阳光	323,000	2,903,770.00	0.30
9	000709	河钢股份	1,251,500	2,828,390.00	0.29
10	002756	永兴材料	17,900	2,724,559.00	0.28
11	603337	杰克股份	124,700	2,678,556.00	0.28
12	300244	迪安诊断	85,300	2,652,830.00	0.27
13	603198	迎驾贡酒	39,900	2,599,086.00	0.27
14	000738	航发控制	87,300	2,453,130.00	0.25
15	300475	香农芯创	121,600	2,450,240.00	0.25
16	002815	崇达技术	189,100	2,422,371.00	0.25
17	600572	康恩贝	545,100	2,414,793.00	0.25

18	603392	万泰生物	14,900	2,313,970.00	0.24
19	000553	安道麦A	191,000	2,313,010.00	0.24
20	600667	太极实业	302,900	2,235,402.00	0.23
21	601168	西部矿业	183,900	2,175,537.00	0.23
22	300630	普利制药	61,553	2,163,587.95	0.22
23	000034	神州数码	140,900	2,144,498.00	0.22
24	600350	山东高速	391,600	2,055,900.00	0.21
25	601077	渝农商行	521,700	1,930,290.00	0.20
26	000625	长安汽车	106,210	1,839,557.20	0.19
27	600499	科达制造	85,300	1,760,592.00	0.18
28	600649	城投控股	404,900	1,732,972.00	0.18
29	600188	兖矿能源	43,500	1,717,380.00	0.18
30	300661	圣邦股份	9,000	1,638,180.00	0.17
31	300533	冰川网络	58,600	1,541,180.00	0.16
32	002505	鹏都农牧	453,000	1,535,670.00	0.16
33	300268	佳沃食品	50,200	1,493,450.00	0.15
34	600985	淮北矿业	101,300	1,474,928.00	0.15
35	002831	裕同科技	49,200	1,453,860.00	0.15
36	601928	凤凰传媒	198,800	1,421,420.00	0.15
37	600325	华发股份	183,000	1,385,310.00	0.14
38	600873	梅花生物	115,900	1,307,352.00	0.14
39	600582	天地科技	273,100	1,305,418.00	0.14
40	002240	盛新锂能	21,500	1,297,740.00	0.13
41	000728	国元证券	207,100	1,288,162.00	0.13
42	600713	南京医药	254,300	1,238,441.00	0.13
43	000933	神火股份	94,100	1,230,828.00	0.13
44	601992	金隅集团	439,700	1,217,969.00	0.13
45	600039	四川路桥	110,480	1,163,354.40	0.12
46	300601	康泰生物	25,740	1,162,933.20	0.12
47	002466	天齐锂业	9,100	1,135,680.00	0.12
48	300012	华测检测	48,600	1,128,006.00	0.12

49	000970	中科三环	60,000	1,126,800.00	0.12
50	601933	永辉超市	259,900	1,112,372.00	0.12
51	600839	四川长虹	385,600	1,110,528.00	0.11
52	300009	安科生物	109,400	1,106,034.00	0.11
53	300769	德方纳米	2,700	1,103,436.00	0.11
54	600968	海油发展	426,100	1,099,338.00	0.11
55	300182	捷成股份	196,800	1,082,400.00	0.11
56	300482	万孚生物	26,500	1,078,815.00	0.11
57	000559	万向钱潮	175,200	1,040,688.00	0.11
58	603927	中科软	44,600	1,040,072.00	0.11
59	601916	浙商银行	311,800	1,035,176.00	0.11
60	600519	贵州茅台	500	1,022,500.00	0.11
61	600131	国网信通	72,600	976,470.00	0.10
62	600372	中航电子	49,800	965,622.00	0.10
63	002396	星网锐捷	42,300	957,672.00	0.10
64	600690	海尔智家	34,700	952,862.00	0.10
65	600141	兴发集团	21,515	946,444.85	0.10
66	601857	中国石油	177,600	941,280.00	0.10
67	000750	国海证券	249,800	906,774.00	0.09
68	000767	晋控电力	242,100	903,033.00	0.09
69	603177	德创环保	59,000	893,850.00	0.09
70	002797	第一创业	138,200	885,862.00	0.09
71	300308	中际旭创	28,500	884,925.00	0.09
72	603300	华铁应急	110,320	879,250.40	0.09
73	002624	完美世界	60,300	866,511.00	0.09
74	601555	东吴证券	123,300	854,469.00	0.09
75	002471	中超控股	333,300	843,249.00	0.09
76	600177	雅戈尔	126,100	836,043.00	0.09
77	601828	美凯龙	137,500	833,250.00	0.09
78	000729	燕京啤酒	85,900	829,794.00	0.09
79	600580	卧龙电驱	56,300	811,846.00	0.08

80	600449	宁夏建材	64,600	786,182.00	0.08
81	688009	中国通号	172,800	782,784.00	0.08
82	600917	重庆燃气	106,600	769,652.00	0.08
83	603659	璞泰来	9,100	768,040.00	0.08
84	000960	锡业股份	45,000	754,650.00	0.08
85	601108	财通证券	91,400	719,318.00	0.07
86	002212	天融信	70,100	711,515.00	0.07
87	600160	巨化股份	53,900	708,785.00	0.07
88	000887	中鼎股份	38,500	702,240.00	0.07
89	600648	外高桥	50,900	692,240.00	0.07
90	600970	中材国际	71,200	689,928.00	0.07
91	603267	鸿远电子	5,100	685,083.00	0.07
92	300504	天邑股份	38,500	683,760.00	0.07
93	600901	江苏租赁	133,200	683,316.00	0.07
94	600760	中航沈飞	11,300	683,085.00	0.07
95	600863	内蒙华电	185,900	678,535.00	0.07
96	002004	华邦健康	119,900	669,042.00	0.07
97	600362	江西铜业	37,400	666,842.00	0.07
98	000598	兴蓉环境	130,100	664,811.00	0.07
99	600547	山东黄金	35,500	658,880.00	0.07
100	600563	法拉电子	3,100	635,996.00	0.07
101	603658	安图生物	13,000	635,570.00	0.07
102	300957	贝泰妮	2,900	630,837.00	0.07
103	600064	南京高科	54,200	596,200.00	0.06
104	000937	冀中能源	79,400	592,324.00	0.06
105	002028	思源电气	16,600	591,956.00	0.06
106	600765	中航重机	17,740	570,873.20	0.06
107	688197	首药控股	24,261	562,855.20	0.06
108	002985	北摩高科	9,550	559,439.00	0.06
109	600166	福田汽车	195,700	553,831.00	0.06
110	600507	方大特钢	77,100	538,929.00	0.06

111	688390	固德威	1,680	525,856.80	0.05
112	002368	太极股份	26,900	516,749.00	0.05
113	601615	明阳智能	15,000	507,000.00	0.05
114	601998	中信银行	105,500	501,125.00	0.05
115	300888	稳健医疗	7,500	498,750.00	0.05
116	601162	天风证券	156,500	497,670.00	0.05
117	600415	小商品城	89,100	496,287.00	0.05
118	000050	深天马 A	49,500	493,515.00	0.05
119	600008	首创环保	167,200	484,880.00	0.05
120	300363	博腾股份	6,200	483,538.00	0.05
121	600536	中国软件	11,900	483,021.00	0.05
122	002841	视源股份	6,400	482,048.00	0.05
123	000998	隆平高科	28,900	481,474.00	0.05
124	300618	寒锐钴业	8,300	480,736.00	0.05
125	601016	节能风电	98,600	473,280.00	0.05
126	000519	中兵红箭	15,900	463,485.00	0.05
127	300463	迈克生物	22,400	458,976.00	0.05
128	601958	金钼股份	51,800	457,912.00	0.05
129	600389	江山股份	7,500	455,475.00	0.05
130	000948	南天信息	36,900	453,870.00	0.05
131	600718	东软集团	37,900	436,229.00	0.05
132	002416	爱施德	46,600	433,380.00	0.04
133	002191	劲嘉股份	40,100	429,872.00	0.04
134	603605	珀莱雅	2,600	429,468.00	0.04
135	600256	广汇能源	40,700	428,978.00	0.04
136	600578	京能电力	135,300	423,489.00	0.04
137	300390	天华超净	4,800	419,520.00	0.04
138	600909	华安证券	91,600	416,780.00	0.04
139	603003	龙宇燃油	56,000	416,640.00	0.04
140	002371	北方华创	1,500	415,680.00	0.04
141	002422	科伦药业	22,000	411,400.00	0.04

142	000932	华菱钢铁	80,800	411,272.00	0.04
143	002557	洽洽食品	7,000	398,510.00	0.04
144	600862	中航高科	13,900	390,590.00	0.04
145	000830	鲁西化工	22,400	387,296.00	0.04
146	601728	中国电信	94,600	352,858.00	0.04
147	600236	桂冠电力	57,900	352,611.00	0.04
148	000027	深圳能源	53,900	345,499.00	0.04
149	002399	海普瑞	18,700	328,746.00	0.03
150	688099	晶晨股份	3,160	319,160.00	0.03
151	600171	上海贝岭	12,500	312,875.00	0.03
152	600867	通化东宝	29,400	303,996.00	0.03
153	000021	深科技	25,700	299,148.00	0.03
154	603786	科博达	4,800	295,536.00	0.03
155	603899	晨光股份	5,200	291,616.00	0.03
156	000415	渤海租赁	133,400	289,478.00	0.03
157	600390	五矿资本	58,600	286,554.00	0.03
158	688185	康希诺	1,400	278,712.00	0.03
159	601696	中银证券	20,800	276,640.00	0.03
160	002878	元隆雅图	14,300	275,990.00	0.03
161	002128	电投能源	19,200	274,944.00	0.03
162	000686	东北证券	39,300	274,707.00	0.03
163	601718	际华集团	88,300	273,730.00	0.03
164	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.03
165	600535	天士力	24,600	258,546.00	0.03
166	002948	青岛银行	70,500	255,210.00	0.03
167	002094	青岛金王	67,500	245,025.00	0.03
168	600820	隧道股份	39,300	240,516.00	0.02
169	600782	新钢股份	47,200	237,888.00	0.02
170	002792	通宇通讯	19,400	233,964.00	0.02
171	002030	达安基因	13,300	228,627.00	0.02
172	002532	天山铝业	33,400	218,102.00	0.02

173	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
174	002195	二三四五	92,900	209,025.00	0.02
175	002690	美亚光电	9,500	205,960.00	0.02
176	600885	宏发股份	4,900	205,065.00	0.02
177	002867	周大生	13,100	203,443.00	0.02
178	002281	光迅科技	11,500	202,170.00	0.02
179	600787	中储股份	34,800	198,012.00	0.02
180	600959	江苏有线	60,200	196,252.00	0.02
181	688006	杭可科技	2,800	196,168.00	0.02
182	000983	山西焦煤	14,500	194,155.00	0.02
183	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
184	300017	网宿科技	35,900	192,424.00	0.02
185	600095	湘财股份	25,000	192,250.00	0.02
186	600126	杭钢股份	37,300	190,976.00	0.02
187	300070	碧水源	36,100	188,081.00	0.02
188	601677	明泰铝业	7,900	188,020.00	0.02
189	600201	生物股份	20,200	185,032.00	0.02
190	000401	冀东水泥	17,500	184,100.00	0.02
191	601187	厦门银行	30,200	179,992.00	0.02
192	603355	莱克电气	7,100	179,133.00	0.02
193	002407	多氟多	3,500	171,185.00	0.02
194	600875	东方电气	10,000	164,500.00	0.02
195	000488	晨鸣纸业	27,700	156,228.00	0.02
196	600176	中国巨石	8,900	154,949.00	0.02
197	002048	宁波华翔	9,600	153,792.00	0.02
198	600089	特变电工	5,200	142,428.00	0.01
199	600928	西安银行	38,200	140,194.00	0.01
200	600717	天津港	34,900	139,949.00	0.01
201	000733	振华科技	1,000	135,970.00	0.01
202	600438	通威股份	2,200	131,692.00	0.01
203	600546	山煤国际	6,700	130,382.00	0.01

204	000028	国药一致	4,100	122,139.00	0.01
205	600811	东方集团	42,200	119,426.00	0.01
206	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
207	688819	天能股份	3,400	117,572.00	0.01
208	002249	大洋电机	18,100	111,134.00	0.01
209	000783	长江证券	18,300	108,519.00	0.01
210	000402	金融街	18,000	107,100.00	0.01
211	600299	安迪苏	11,100	106,338.00	0.01
212	000513	丽珠集团	2,900	105,009.00	0.01
213	000708	中信特钢	5,200	104,780.00	0.01
214	002595	豪迈科技	4,000	89,360.00	0.01
215	600805	悦达投资	16,300	79,707.00	0.01
216	000778	新兴铸管	16,300	78,566.00	0.01
217	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.01
218	002625	光启技术	4,100	70,807.00	0.01
219	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
220	002500	山西证券	10,000	57,400.00	0.01
221	600258	首旅酒店	2,300	57,040.00	0.01
222	300073	当升科技	600	54,204.00	0.01
223	600528	中铁工业	6,300	50,715.00	0.01
224	001203	大中矿业	4,300	48,590.00	0.01
225	002925	盈趣科技	2,200	47,344.00	0.00
226	002081	金螳螂	8,900	45,212.00	0.00
227	002180	纳思达	800	40,496.00	0.00
228	000930	中粮科技	4,400	39,776.00	0.00
229	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
230	301236	软通动力	1,110	34,831.80	0.00
231	002465	海格通信	3,700	33,633.00	0.00
232	301200	大族数控	629	32,657.68	0.00
233	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
234	301150	中一科技	378	31,283.28	0.00

235	002779	中坚科技	1,200	30,408.00	0.00
236	301206	三元生物	617	28,190.73	0.00
237	301216	万凯新材	896	26,736.64	0.00
238	301219	腾远钴业	288	25,292.16	0.00
239	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
240	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
241	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
242	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
243	601139	深圳燃气	2,700	18,738.00	0.00
244	300834	星辉环材	618	18,558.54	0.00
245	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
246	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
247	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
248	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
249	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
250	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
251	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
252	002736	国信证券	1,600	15,312.00	0.00
253	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
254	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
255	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
256	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
257	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
258	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
259	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
260	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
261	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
262	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
263	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
264	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
265	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00

266	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
267	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
268	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
269	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
270	300257	开山股份	400	5,984.00	0.00
271	600956	新天绿能	300	3,696.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	600718	东软集团	12,243,929.00	1.14
2	600141	兴发集团	12,169,471.85	1.13
3	000960	锡业股份	11,432,291.04	1.06
4	600765	中航重机	10,047,828.00	0.94
5	600673	东阳光	9,362,803.00	0.87
6	002180	纳思达	9,353,219.00	0.87
7	000997	新大陆	9,173,896.00	0.85
8	600348	华阳股份	8,572,853.00	0.80
9	300037	新宙邦	8,541,528.00	0.80
10	601555	东吴证券	8,047,539.78	0.75
11	600546	山煤国际	7,688,919.00	0.72
12	600885	宏发股份	7,587,707.50	0.71
13	002384	东山精密	7,140,691.00	0.66
14	603712	七一二	6,871,614.00	0.64
15	600438	通威股份	6,863,878.57	0.64
16	600486	扬农化工	6,298,375.00	0.59
17	000750	国海证券	6,296,692.00	0.59
18	000733	振华科技	6,249,416.00	0.58
19	601168	西部矿业	6,079,218.00	0.57

20	603228	景旺电子	5,707,706.00	0.53
----	--------	------	--------------	------

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	600141	兴发集团	13,600,820.00	1.27
2	600718	东软集团	12,010,866.00	1.12
3	000960	锡业股份	10,202,705.00	0.95
4	600348	华阳股份	9,433,395.00	0.88
5	600765	中航重机	9,066,103.00	0.84
6	002180	纳思达	8,514,438.00	0.79
7	600673	东阳光	8,454,466.00	0.79
8	600546	山煤国际	8,303,667.00	0.77
9	000997	新大陆	8,299,300.00	0.77
10	600438	通威股份	7,789,891.00	0.73
11	002384	东山精密	7,369,057.00	0.69
12	601555	东吴证券	7,215,016.20	0.67
13	600803	新奥股份	7,119,790.06	0.66
14	000733	振华科技	7,108,323.00	0.66
15	603712	七一二	6,954,125.00	0.65
16	300769	德方纳米	6,942,129.22	0.65
17	000039	中集集团	6,711,676.00	0.62
18	000090	天健集团	6,631,983.08	0.62
19	600885	宏发股份	6,459,422.00	0.60
20	000938	紫光股份	6,280,901.00	0.58

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	979,448,195.53
卖出股票收入（成交）总额	958,716,086.94

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	41,442,213.70	4.29
	其中：政策性金融债	41,442,213.70	4.29
4	企业债券	101,222,759.18	10.48
5	企业短期融资券	322,184,425.20	33.35
6	中期票据	512,781,102.99	53.08
7	可转债(可交换债)	52,876,275.70	5.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,030,506,776.77	106.67

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	152473	20西咸03	500,000	50,204,019.18	5.20
2	042200020	22开滦CP001	500,000	50,114,520.55	5.19
3	101800030	18陕西水务MT N001	400,000	41,990,575.34	4.35
4	012105192	21昆明公租SC P002	400,000	41,252,986.30	4.27
5	012281698	22津城建SCP0 33	400,000	40,442,049.32	4.19

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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，除民生银行受到银保监会处罚外，其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。本基金投资于上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规和基金合同的要求。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,826.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99,530.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	137,356.74
---	----	------------

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	123107	温氏转债	35,622,157.89	3.69
2	110064	建工转债	17,254,117.81	1.79

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
中加心享混合A	660	1,124,595.48	739,711,987.10	99.66%	2,521,028.46	0.34%
中加心享混合C	4,331	6,785.00	2,122,537.82	7.22%	27,263,290.55	92.78%
合计	4,991	154,602.05	741,834,524.92	96.14%	29,784,319.01	3.86%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中加心享混合A	14,924.09	0.00%
	中加心享混合C	9,904.26	0.03%
	合计	24,828.35	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

本公司高级管理人员、基金投资研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加心享混合A	中加心享混合C
基金合同生效日(2015年12月02日)基金份额总额	2,772,993,297.72	-
本报告期期初基金份额总额	737,911,438.07	127,446,932.22
本报告期基金总申购份额	328,458,367.80	15,512,212.63
减：本报告期基金总赎回份额	324,136,790.31	113,573,316.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	742,233,015.56	29,385,828.37

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

基金管理人本报告期内人事变动情况：无。

基金托管人本报告期内人事变动情况：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立之日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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未受监管部门稽查或处罚；基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受监管部门稽查或处罚等情况。

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	
东方财富证券	2	1,917,437,846.78	100.00%	826,999.31	100.00%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1. 公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

(3) 研究服务实力。

2. 券商及交易单元的选择流程如下：

(1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

(2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3. 投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

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
东方财富证券	8,844,564.89	40.86%	4,483,600.00	82.00%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	12,802,656.24	59.14%	984,100,000.00	18.00%	-	-	-	-

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	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	中加基金管理有限公司关于中加心享灵活配置混合型证券投资基金关联交易公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
3	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-30
4	中加心享灵活配置混合型证	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22

	券投资基金2022年第一季度报告		
5	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务、调整申购起点金额并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-12

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220424	242,501,818.77	0.00	242,501,818.77	0.00	0.00%
	2	20220211-20220630	170,163,682.04	0.00	0.00	170,163,682.04	22.05%
	3	20220425-20220630	0.00	245,764,696.11	0.00	245,764,696.11	31.85%
	4	20220101-20220630	242,501,818.77	0.00	0.00	242,501,818.77	31.43%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

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、中国证监会批准中加心享灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日