

中融匠心优选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:中融基金管理有限公司

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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，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25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§9 开放式基金份额变动	63

§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融匠心优选混合型证券投资基金	
基金简称	中融匠心优选混合	
基金主代码	013561	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年11月02日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
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	681,502,515.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融匠心优选混合A	中融匠心优选混合C
下属分级基金的交易代码	013561	013562
报告期末下属分级基金的份额总额	639,472,162.55份	42,030,352.74份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严控投资风险的前提下，优选基本面具有竞争力且估值水平具备相对优势的上市公司，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、可转换债券及可交换债券投资策略 6、衍生品投资策略 7、资产支持证券投资策略 8、参与融资业务投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率*20%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

	本基金如果投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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	中融基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	95588
传真	010-56517001	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100011	100140
法定代表人	王瑶	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	http://www.zrfunds.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机关	中融基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11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)	
	中融匠心优选混合 A	中融匠心优选混合 C
本期已实现收益	-96,034,773.79	-6,811,423.04
本期利润	-65,173,478.48	-5,157,599.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0967	-0.1092
本期加权平均净值利润率	-10.76%	-12.17%
本期基金份额净值增长率	-8.54%	-8.91%
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	-93,051,126.29	-6,299,380.86
期末可供分配基金份额利润	-0.1455	-0.1499
期末基金资产净值	599,715,278.30	39,210,921.44
期末基金份额净值	0.9378	0.9329
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	-6.22%	-6.71%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3、期末可供分配利润为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；

3.2 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

中融匠心优选混合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	9.33%	1.10%	6.10%	0.93%	3.23%	0.17%
过去三个月	6.01%	1.20%	3.79%	1.14%	2.22%	0.06%
过去六个月	-8.54%	1.22%	-6.47%	1.22%	-2.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	-6.22%	1.05%	-7.07%	1.09%	0.85%	-0.04%

中融匠心优选混合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	9.25%	1.10%	6.10%	0.93%	3.15%	0.17%
过去三个月	5.81%	1.20%	3.79%	1.14%	2.02%	0.06%
过去六个月	-8.91%	1.22%	-6.47%	1.22%	-2.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	-6.71%	1.05%	-7.07%	1.09%	0.36%	-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

中融匠心优选混合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
(2021年11月02日-2022年06月30日)



中融匠心优选混合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
(2021年11月02日-2022年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

§ 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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2022年6月30日，中融基金管理有限公司共管理78只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、

中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金、中融优势产业混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金、中融成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金。

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		
柯海东	中融竞争优势股票型证券投资基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金的基金经理、公司总裁助理。	2021-11-02	-	12	柯海东先生, 中国国籍, 毕业于中山大学财务与投资管理专业, 研究生、硕士学位, 取得基金业从业人员资格, 证券从业年限12年。2010年7月至2013年2月曾任中国中投证券研究总部分析师; 2013年2月至2015年8月曾任国泰君安证券研究所分析师; 2015年9月至2018年8月曾任前海开源基金管理有限公司投资部副总监。2018年9月加入中融基金管理有限公司, 现任公司总裁助理。

注：（1）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；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%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

尽管基金经理年初展望2022年A股市场充满挑战性，波动加剧及选股难度提升，但上半年的市场走势仍然远超此前预期，在通胀、地缘冲突、逆全球化、疫情等等多重宏观变量的影响下，市场波动显著放大，沪深300指数从年初单边下跌至4月末开始反弹，整体上半年跌幅仍达9.22%。

上半年基金的业绩表现欠佳，如何穿越变幻莫测的宏观迷雾，在方法论上行稳致远，进一步提升自己的投研能力以创造更好的长期回报，值得基金经理深刻反思：

第一，敬畏多变的、高度动态博弈的宏观变量，但在投资组合的整体构建上则要尽量减少判断宏观因素。如上半年在稳增长的政策、流动性，甚至疫情政策做诸多似是而非的判断，进而做投资决策并不明智；

第二，权益市场的主要投资风险之一，是来自于错过了时代进步赋予的投资机会。顺应了全球产业趋势变化，带来显著的社会进步的方向，更值得聚焦资源，捕捉其中的趋势变化带来的投资机会。比如能源革命和汽车行业的革命几乎是最近几年最大的产业革命，已经过了补贴驱动的增长阶段，中长期成长逻辑是清晰可见的，如果在年初过分纠结新能源估值过高而选择了整体减仓，则后续不容易把握住储能、海外光伏、海风，乃至新能源汽车产业的巨大变化，而这些产业的积极变化，除了在业绩上持续超预期外，市场可能更容易给出估值提升的回报；

第三，稳健的、久经市场检验的优秀商业模式值得长期坚守，但是投资并非一成不变，市场只会给顺应行业趋势，或者公司管理改善等因素带来的业绩改善给予超额回报。比如消费品，如果仅仅盯着不变的格局，而不观察行业景气度变化，消费趋势的变化，同样也可能难以获得超额收益；

第四，尽量回避难以持续增长，及ROE长期下行的博弈型行业。在这些行业及公司上过多倾注的投研资源，只会构成寻求更好投资机会的机会成本。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融匠心优选混合A基金份额净值为0.9378元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.54%，同期业绩比较基准收益率为-6.47%；截至报告期末中融匠心优选混合C基金份额净值为0.9329元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.91%，同期业绩比较基准收益率为-6.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金经理判断下半年宏观经济依然延续5月以来内强外弱的状态。

外部方面，原油价格尽管近期有所调整，但因过去长周期缺乏资本开支导致新增供给有限，在需求不出现大幅下行的情况下预计仍将维持高位，美国的经济韧性较强，仍处于加息通道，经济渐进式减弱预期仍在。

内部方面，二季度国内稳增长政策频出，因疫情反复、地产长周期下行的压力影响，效果未完全显现，基金经理判断三季度在稳增长政策逐步兑现的情况下，预计国内宏观经济将环比改善，但我们更倾向于认为在疫情扰动及克制的稳增长政策下，国内经济是弱复苏而非强复苏。

虽然4月末以来市场反弹，估值出现明显修复，但以沪深300指数PE（TTM）来看，只是回到了过去十年42%的分位值，估值仍或具有一定的性价比。宏观层面经济弱复苏、流动性宽裕的假设依然对应着有利于成长股的投资环境。

下半年投资将继续关注三大投资主线：

第一，能源革命当中的具有广阔成长机会的细分领域，尤其是可能量价齐升的细分环节及个股。在传统能源价格高企的背景下，预计全球范围内新能源依然能加速替代发展。受益于新能源汽车及储能的高速发展，上游锂矿扩产周期滞后于下游需求的快速增长有望产生投资机会，基金经理更关注其中能兑现量快速增长的个股；新能源发电侧的光伏、储能上半年主要体现了海外需求的强劲，风电则因疫情扰动上半年建设进度低于预期，但作为新基建的重要组成部分，预计下半年起至2023年国内的风电、光伏建设也有望加速，更值得重视的是，当新能源发电量占比提升后，为解决电网的消纳问题，也将在储能、发电侧管理、电网管理方面产生更多的投资机会。展望2023年，预计随着新能源汽车渗透率快速提升后，智能化也将成为汽车产业的核心竞争要素，值得重点关注。

第二，逆全球化背景下，自主可控带来的长期成长机会。基金经理重点关注下游景气度持续高企，上游国产化程度仍然较低的环节，如生命科学的上游，及半导体产业中部分材料、测试仪器仪表的环节。

第三，疫后复苏、消费趋势变化带来的投资机会。展望下半年，消费品行业普遍具有疫后需求环比复苏、成本改善的中短期逻辑，但基金经理更关注即使不考虑疫情影响，仍具有内生性成长的细分品类，如功能饮料、露营产业等；也关注处于产品升级周期的部分区域性白酒；以及重新回到顺政策周期的连锁药房等细分行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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与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。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大

利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

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，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人—中融基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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。

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

本托管人依法对中融基金管理有限公司编制和披露的本基金2022年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中融匠心优选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	16,941,527.71	393,562,718.77
结算备付金		11,403,941.01	11,048,570.78

存出保证金		162,437.60	17,080.71
交易性金融资产	6.4.7.2	606,668,089.62	441,602,100.70
其中：股票投资		563,213,365.49	394,027,174.68
基金投资		-	-
债券投资		43,454,724.13	47,574,926.02
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		6,149,333.99	-
应收股利		1,276,088.66	-
应收申购款		8,136.59	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	702,290.54
资产总计		642,609,555.18	846,932,761.50
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		15.58	66,946,450.72
应付赎回款		1,927,918.21	-
应付管理人报酬		758,668.88	983,338.25
应付托管费		126,444.81	163,889.73
应付销售服务费		25,216.34	36,463.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		64.51	133.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	845,027.11	357,905.11
负债合计		3,683,355.44	68,488,181.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	681,502,515.29	759,216,192.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-42,576,315.55	19,228,387.27
净资产合计		638,926,199.74	778,444,580.26
负债和净资产总计		642,609,555.18	846,932,761.50

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额681,502,515.29份，其中A类基金份额的份额总额为639,472,162.55份，份额净值0.9378元；C类基金份额的份额总额为42,030,352.74份，份额净值0.9329元。

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：中融匠心优选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
一、营业总收入		-64,432,055.16
1. 利息收入		402,287.54
其中：存款利息收入	6.4.7.8	402,287.54
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-97,481,358.99
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-103,446,117.17
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	378,869.15
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.11	5,585,889.03
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）	6.4.7.12	32,515,118.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	131,897.40
减：二、营业总支出		5,899,022.78
1. 管理人报酬		4,839,013.37
2. 托管费		806,502.25
3. 销售服务费		169,237.51
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		38.11
8. 其他费用	6.4.7.14	84,231.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-70,331,077.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-70,331,077.94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-70,331,077.94

注：本基金基金合同于2021年11月02日生效，无可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中融匠心优选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）	759,216,192.99	-	19,228,387.27	778,444,580.26
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）	759,216,192.99	-	19,228,387.27	778,444,580.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,713,677.70	-	-61,804,702.82	-139,518,380.52
（一）、综合收益总	-	-	-70,331,077.	-70,331,077.

额			94	94
(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)	-77,713,677.70	-	8,526,375.12	-69,187,302.58
其中: 1. 基金申购款	1,024,929.58	-	-119,164.86	905,764.72
2. 基金赎回款	-78,738,607.28	-	8,645,539.98	-70,093,067.30
(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)	681,502,515.29	-	-42,576,315.55	638,926,199.74

注: 本基金基金合同于2021年11月02日生效, 无可比期间。

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:

王瑶

曹健

李克

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

中融匠心优选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[2021] 2787号文《关于准予中融匠心优选混合型证券投资基金注册的批复》批准, 由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融匠心优选混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起, 于2021年11月2日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为自2021年10月18日至2021年10月29日, 本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定, 本基金共募集有效净认购资金759,087,923.35元, 折合

759,087,923.35份中融匠心优选混合基金份额(其中:A类基金份额为706,263,825.90份;C类基金份额为52,824,097.45份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币128,269.64元,折合128,269.64份中融匠心优选混合基金份额(其中:A类基金份额为119,317.69份;C类基金份额为8,951.95份),以上收到的实收基金共计人民币759,216,192.99元,折合759,216,192.99份中融匠心优选混合基金份额(其中:A类基金份额为706,383,143.59份;C类基金份额为52,833,049.40份),有效认购户数为6,366户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定,本基金的投资对象是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(包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 60%+恒生指数收益率 \times 20%+中债综合指数收益率 \times 20%。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

① 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：

a) 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。

b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 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。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

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处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其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；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金C类基金份额的销售服务费按《基金合同》约定的方法进行计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管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。其他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

(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) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而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,本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4) 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

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,本基金确定以下股票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,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)》,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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)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或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),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央国债登记结算有限责任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

根据《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》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

（1）以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币393,562,718.77元，自应收利息转入的重分类金额为人民币45,649.66元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币393,608,368.43元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币11,048,570.78元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,311.20元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币11,049,881.98元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币17,080.71元，自应收利息转入的重分类金额为人民币8.47元，重新计量预期信用损失

准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币17,089.18元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币702,290.54元，转出至银行存款的重分类金额为人民币45,649.66元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币1,311.20元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币8.47元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币655,321.21元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币441,602,100.70元，自应收利息转入的重分类金额为人民币655,321.21元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币442,257,421.91元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《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

增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	16,941,527.71
等于：本金	16,939,700.36
加：应计利息	1,827.35
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	16,941,527.71

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		510,605,167.30	-	563,213,365.49	52,608,198.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,374,608.32	434,948.67	43,454,724.13	645,167.14
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	42,374,608.32	434,948.67	43,454,724.13	645,167.14

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	552,979,775.62	434,948.67	606,668,089.62	53,253,365.33

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

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 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	6,272.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	756,931.70
其中：交易所市场	756,931.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	845,027.11

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 中融匠心优选混合A

金额单位：人民币元

项目 (中融匠心优选混合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	706,383,143.59	706,383,143.59
本期申购	687,642.78	687,642.78
本期赎回（以“-”号填列）	-67,598,623.82	-67,598,623.82
本期末	639,472,162.55	639,472,162.55

6.4.7.6.2 中融匠心优选混合C

金额单位：人民币元

项目 (中融匠心优选混合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	52,833,049.40	52,833,049.40
本期申购	337,286.80	337,286.80
本期赎回（以“-”号填列）	-11,139,983.46	-11,139,983.46
本期末	42,030,352.74	42,030,352.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 中融匠心优选混合A

单位：人民币元

项目 (中融匠心优选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,340,664.26	19,296,082.14	17,955,417.88
本期利润	-96,034,773.79	30,861,295.31	-65,173,478.48
本期基金份额交易产生的变动数	4,324,311.76	3,136,864.59	7,461,176.35
其中：基金申购款	-45,923.72	-28,701.58	-74,625.30
基金赎回款	4,370,235.48	3,165,566.17	7,535,801.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-93,051,126.29	53,294,242.04	-39,756,884.25

6.4.7.7.2 中融匠心优选混合C

单位：人民币元

项目 (中融匠心优选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-169,194.91	1,442,164.30	1,272,969.39
本期利润	-6,811,423.04	1,653,823.58	-5,157,599.46
本期基金份额交易产生的变动数	681,237.09	383,961.68	1,065,198.77
其中：基金申购款	-24,156.92	-20,382.64	-44,539.56
基金赎回款	705,394.01	404,344.32	1,109,738.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,299,380.86	3,479,949.56	-2,819,431.30

6.4.7.8 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	326,891.36
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	74,091.77
其他	1,304.41
合计	402,287.54

6.4.7.9 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	650,718,942.41
减：卖出股票成本总额	752,163,034.64
减：交易费用	2,002,024.94
买卖股票差价收入	-103,446,117.17

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 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	410,470.19
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-31,601.04
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	378,869.15

6.4.7.10.2 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	40,388,185.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,488,565.60
减：应计利息总额	931,185.20
减：交易费用	35.44
买卖债券差价收入	-31,601.04

6.4.7.11 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	5,585,889.03
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	5,585,889.03

6.4.7.12 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	32,515,118.89
——股票投资	32,717,128.85
——债券投资	-202,009.96
——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	32,515,118.89

6.4.7.13 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	131,897.40
合计	131,897.40

6.4.7.14 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,408.68
合计	84,231.54

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：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

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

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,839,013.37
其中：支付销售机构的客户维护费	2,412,797.81

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，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 \times 1.50%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

③本基金基金合同于2021年11月02日生效，无可比期间。

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
当期发生的基金应支付的托管费	806,502.25

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，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 \times 0.25%/当年天数。

②本基金基金合同于2021年11月02日生效，无可比期间。

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		
	中融匠心优选混合A	中融匠心优选混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	59,774.85	59,774.85
合计	-	59,774.85	59,774.85

注：①支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值 \times 0.80%/当年天数。

②本基金基金合同于2021年11月02日生效，无可比期间。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	16,941,527.71	326,891.36

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，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

注：无。

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

注：无。

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
688322	奥比中光	2022-06-30	6个月	首次公开发行限售	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未流通	21.93	21.93	10,082	221,098.26	221,098.26	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未流通	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688282	理工导航	2022-03-10	6个月	首次公开发行限售	65.21	45.37	3,185	207,693.85	144,503.45	-

688237	超卓航科	2022-06-24	5个交易日	新股未流通	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未流通	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	首次公开发行限售	48.59	31.38	768	37,314.56	24,099.84	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	首次公开发行限售	76.56	51.92	434	33,227.04	22,533.28	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	首次公开发行限售	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	首次公开发行限售	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	首次公开发行限售	35.68	29.84	691	24,654.88	20,619.44	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	首次公开发行限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	首次公开发行限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-

301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	首次公开发售	56.88	56.42	339	19,282.32	19,126.38	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	首次公开发售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	首次公开发售	96.94	87.82	201	19,485.76	17,651.82	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	首次公开发售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	首次公开发售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	首次公开发售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	首次公开发售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	首次公开发售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301237	和顺科技	2022-03-	6个月	首次公开	56.69	41.86	261	14,796.0	10,925.4	-

		16		发行 限售				9	6	
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个 月	首次 公开发 行 限售	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3012 88	清研 环境	2022 -04- 14	6个 月	首次 公开发 行 限售	19.0 9	19.9 8	452	8,62 8.68	9,03 0.96	-
3011 63	宏德 股份	2022 -04- 11	6个 月	首次 公开发 行 限售	26.2 7	32.3 3	277	7,27 6.79	8,95 5.41	-
3011 35	瑞德 智能	2022 -04- 01	6个 月	首次 公开发 行 限售	31.9 8	26.2 6	338	10,8 09.2 4	8,87 5.88	-
3012 79	金道 科技	2022 -04- 06	6个 月	首次 公开发 行 限售	31.2 0	22.8 1	296	9,23 5.20	6,75 1.76	-
3012 33	盛帮 股份	2022 -06- 24	6个 月	首次 公开发 行 限售	41.5 2	41.5 2	158	6,56 0.16	6,56 0.16	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，

通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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	7,884,670.64	8,106,088.92
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	7,884,670.64	8,106,088.92

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
---------------	------	------	------	-----	----

6 月 30 日					
资产					
银行存款	16,941,527.71	-	-	-	16,941,527.71
结算备付金	11,403,941.01	-	-	-	11,403,941.01
存出保证金	162,437.60	-	-	-	162,437.60
交易性金融资产	43,454,724.13	-	-	563,213,365.49	606,668,089.62
应收清算款	-	-	-	6,149,333.99	6,149,333.99
应收股利	-	-	-	1,276,088.66	1,276,088.66
应收申购款	-	-	-	8,136.59	8,136.59
资产总计	71,962,630.45	-	-	570,646,924.73	642,609,555.18
负债					
应付清算款	-	-	-	15.58	15.58
应付赎回款	-	-	-	1,927,918.21	1,927,918.21
应付管理人报酬	-	-	-	758,668.88	758,668.88
应付托管费	-	-	-	126,444.81	126,444.81
应付销售服务费	-	-	-	25,216.34	25,216.34
应交税费	-	-	-	64.51	64.51
其他负债	-	-	-	845,027.11	845,027.11
负债总计	-	-	-	3,683,355.44	3,683,355.44
利率敏感度缺口	71,962,630.45	-	-	566,963,569.29	638,926,199.74
上年度末 2021 年 1	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
银行存款	393,562,718.77	-	-	-	393,562,718.77
结算备付金	11,048,570.78	-	-	-	11,048,570.78
存出保证金	17,080.71	-	-	-	17,080.71
交易性金融资产	47,574,926.02	-	-	394,027,174.68	441,602,100.70
应收利息	-	-	-	702,290.54	702,290.54
资产总计	452,203,296.28	-	-	394,729,465.22	846,932,761.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	66,946,450.72	66,946,450.72
应付管理人报酬	-	-	-	983,338.25	983,338.25
应付托管费	-	-	-	163,889.73	163,889.73
应付销售服务费	-	-	-	36,463.71	36,463.71
应付交易费用	-	-	-	337,905.11	337,905.11
应交税费	-	-	-	133.72	133.72
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	68,488,181.24	68,488,181.24
利率敏感度缺口	452,203,296.28	-	-	326,241,283.98	778,444,580.26

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

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	73,460,470.37	-	73,460,470.37
应收股利	-	1,276,088.66	-	1,276,088.66
资产合计	-	74,736,559.03	-	74,736,559.03
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	74,736,559.03	-	74,736,559.03
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	98,149,675.0	-	98,149,675.0

		0		0
资产合计	-	98,149,675.0	-	98,149,675.0
		0		0
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	98,149,675.0	-	98,149,675.0
		0		0

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有港币均相对人民币升值5%	3,736,827.95	4,907,483.75
	所有港币均相对人民币贬值5%	-3,736,827.95	-4,907,483.75

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资	563,213,365.49	88.15	394,027,174.68	50.62

产—股票投资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	43,454,724.13	6.80	47,574,926.02	6.11
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	606,668,089.62	94.95	441,602,100.70	56.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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
	沪深300指数上升5%	22,102,490.08	9,664,489.68
	沪深300指数下降5%	-22,102,490.08	-9,664,489.68

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	569,760,155.73	401,860,430.47
第二层次	36,457,550.01	39,741,670.23
第三层次	450,383.88	-
合计	606,668,089.62	441,602,100.70

注：根据《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>》的要求，本基金期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本基金对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	563,213,365.49	87.64
	其中：股票	563,213,365.49	87.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,454,724.13	6.76
	其中：债券	43,454,724.13	6.76
	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	28,345,468.72	4.41
8	其他各项资产	7,595,996.84	1.18
9	合计	642,609,555.18	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为73,460,470.37元，占净值比例11.50%。

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	61,969,478.88	9.70
C	制造业	347,634,590.78	54.41

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	21,899,483.20	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	11,483,655.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,049,307.46	1.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,459,167.78	3.83
M	科学研究和技术服务业	15,245,166.00	2.39
N	水利、环境和公共设施管理业	12,046.02	0.00
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	489,752,895.12	76.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
能源	79,737.92	0.01
公用事业	28,598,152.23	4.48
地产业	44,782,580.22	7.01
合计	73,460,470.37	11.50

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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	601012	隆基绿能	514,960	34,311,784.80	5.37
2	06049	保利物业	776,800	33,215,579.60	5.20
3	02380	中国电力	6,715,000	28,598,152.23	4.48
4	600256	广汇能源	2,695,222	28,407,639.88	4.45
5	002594	比亚迪	74,600	24,878,354.00	3.89
6	603300	华铁应急	3,066,400	24,439,208.00	3.83
7	300438	鹏辉能源	369,000	22,675,050.00	3.55
8	603233	大参林	699,664	21,899,483.20	3.43
9	000596	古井贡酒	82,300	20,547,018.00	3.22
10	300014	亿纬锂能	195,300	19,041,750.00	2.98
11	002304	洋河股份	91,700	16,794,855.00	2.63
12	603218	日月股份	644,300	16,365,220.00	2.56
13	002192	融捷股份	105,500	16,215,350.00	2.54
14	603688	石英股份	120,900	16,032,549.00	2.51
15	605499	东鹏饮料	91,700	15,667,862.00	2.45
16	301096	百诚医药	185,700	14,670,300.00	2.30
17	002176	江特电机	567,092	14,199,983.68	2.22
18	06098	碧桂园服务	387,000	11,567,000.62	1.81
19	002025	航天电器	156,029	10,893,944.78	1.71
20	002126	银轮股份	861,200	9,860,740.00	1.54
21	002756	永兴材料	63,660	9,689,688.60	1.52
22	600188	兖矿能源	229,300	9,052,764.00	1.42
23	300095	华伍股份	631,200	8,281,344.00	1.30
24	688556	高测股份	101,749	8,211,144.30	1.29
25	601975	招商南油	1,958,100	7,891,143.00	1.24
26	603799	华友钴业	72,280	6,911,413.60	1.08
27	601001	晋控煤业	380,600	6,755,650.00	1.06

28	301162	国能日新	108,041	6,616,430.84	1.04
29	600141	兴发集团	138,800	6,105,812.00	0.96
30	301207	华兰疫苗	100,887	5,992,683.06	0.94
31	300627	华测导航	173,360	5,961,850.40	0.93
32	002531	天顺风能	360,600	5,946,294.00	0.93
33	300203	聚光科技	197,800	4,755,112.00	0.74
34	603606	东方电缆	58,000	4,442,800.00	0.70
35	000048	京基智农	235,860	4,379,920.20	0.69
36	600529	山东药玻	152,700	4,267,965.00	0.67
37	603908	牧高笛	43,900	4,177,085.00	0.65
38	300395	菲利华	92,100	4,144,500.00	0.65
39	000519	中兵红箭	142,000	4,139,300.00	0.65
40	000733	振华科技	28,800	3,915,936.00	0.61
41	601872	招商轮船	623,700	3,592,512.00	0.56
42	601567	三星医疗	245,000	3,253,600.00	0.51
43	688283	坤恒顺维	67,600	3,222,492.00	0.50
44	002101	广东鸿图	134,600	3,068,880.00	0.48
45	002046	国机精工	209,700	2,868,696.00	0.45
46	300911	亿田智能	34,500	2,651,325.00	0.41
47	688308	欧科亿	39,120	2,603,827.20	0.41
48	688559	海目星	34,723	2,524,362.10	0.40
49	600522	中天科技	100,100	2,312,310.00	0.36
50	603893	瑞芯微	24,700	2,246,218.00	0.35
51	603297	永新光学	18,000	2,010,780.00	0.31
52	688063	派能科技	4,928	1,538,521.60	0.24
53	000762	西藏矿业	27,500	1,538,075.00	0.24
54	300767	震安科技	21,200	1,233,416.00	0.19
55	300547	川环科技	73,100	1,187,144.00	0.19
56	002475	立讯精密	35,100	1,186,029.00	0.19
57	600557	康缘药业	49,100	721,279.00	0.11
58	688046	药康生物	19,620	574,866.00	0.09

59	603707	健友股份	17,609	496,573.80	0.08
60	600702	舍得酒业	1,500	305,985.00	0.05
61	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.04
62	688400	凌云光	10,082	221,098.26	0.03
63	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
64	688586	江航装备	7,345	195,450.45	0.03
65	688232	新点软件	4,714	177,340.68	0.03
66	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.02
67	600559	老白干酒	4,400	126,236.00	0.02
68	601677	明泰铝业	5,300	126,140.00	0.02
69	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
70	002241	歌尔股份	2,500	84,000.00	0.01
71	00883	中国海洋石油	9,000	79,737.92	0.01
72	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
73	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
74	301236	软通动力	768	24,099.84	0.00
75	301200	大族数控	434	22,533.28	0.00
76	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
77	301216	万凯新材	691	20,619.44	0.00
78	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
79	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
80	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
81	301219	腾远钴业	201	17,651.82	0.00
82	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
83	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
84	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
85	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
86	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
87	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
88	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
89	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00

90	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
91	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
92	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
93	301279	金道科技	296	6,751.76	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	601012	隆基绿能	31,356,958.24	4.03
2	603300	华铁应急	25,701,182.99	3.30
3	600256	广汇能源	24,889,513.34	3.20
4	601288	农业银行	23,183,264.00	2.98
5	601988	中国银行	23,133,969.00	2.97
6	601939	建设银行	22,658,912.00	2.91
7	688232	新点软件	22,056,094.77	2.83
8	000683	远兴能源	21,921,419.41	2.82
9	002555	三七互娱	21,047,169.51	2.70
10	300438	鹏辉能源	20,976,126.68	2.69
11	002594	比亚迪	20,521,577.69	2.64
12	603233	大参林	19,681,632.60	2.53
13	300014	亿纬锂能	19,275,291.68	2.48
14	000596	古井贡酒	18,528,233.00	2.38
15	600141	兴发集团	16,948,509.12	2.18
16	603985	恒润股份	16,808,237.80	2.16
17	603218	日月股份	15,621,630.99	2.01
18	06098	碧桂园服务	15,163,710.66	1.95
19	002304	洋河股份	14,729,014.00	1.89
20	605499	东鹏饮料	14,433,067.00	1.85

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000683	远兴能源	23,954,301.00	3.08
2	603693	江苏新能	22,913,811.00	2.94
3	601288	农业银行	22,530,222.00	2.89
4	688033	天宜上佳	22,467,249.19	2.89
5	601988	中国银行	22,375,370.00	2.87
6	603707	健友股份	22,251,885.36	2.86
7	601939	建设银行	21,864,396.00	2.81
8	002555	三七互娱	20,952,442.94	2.69
9	600702	舍得酒业	20,477,995.00	2.63
10	603688	石英股份	19,485,461.96	2.50
11	688232	新点软件	14,876,029.13	1.91
12	00836	华润电力	14,652,975.76	1.88
13	601567	三星医疗	13,904,174.70	1.79
14	600141	兴发集团	13,709,313.88	1.76
15	601668	中国建筑	12,400,409.40	1.59
16	002541	鸿路钢构	12,364,897.00	1.59
17	603363	傲农生物	12,000,531.79	1.54
18	601677	明泰铝业	11,544,254.40	1.48
19	600958	东方证券	10,436,328.00	1.34
20	00883	中国海洋 石油	10,149,778.52	1.30

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	888,632,096.60
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	650,718,942.41
--------------	----------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	35,570,053.49	5.57
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)	7,884,670.64	1.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,454,724.13	6.80

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	019666	22国债01	225,880	22,841,511.62	3.57
2	123107	温氏转债	60,054	7,884,670.64	1.23
3	019664	21国债16	68,520	6,964,798.94	1.09
4	019658	21国债10	56,560	5,763,742.93	0.90

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除保利物业(06049), 比亚迪(002594)外其他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。 联勤保障部队战勤部采购计划处2022年03月29日发布对保利物业服务股份有限公司的处罚, 深圳市公安局大鹏分局消防监督管理大队2022年05月06日发布对比亚迪股份有限公司的处罚(深公鹏消行罚决字2014第0010号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超过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	162,437.60
2	应收清算款	6,149,333.99
3	应收股利	1,276,088.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,136.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,595,996.84

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	7,884,670.64	1.23

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中融匠心优选混合A	4,791	133,473.63	345,922.71	0.05%	639,126,239.84	99.95%
中融匠心优选混合C	855	49,158.31	140,005.83	0.33%	41,890,346.91	99.67%
合计	5,646	120,705.37	485,928.54	0.07%	681,016,586.75	99.93%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	中融匠心优选混合A	988.68	0.00%
	中融匠心优选混合C	13,006.12	0.03%
	合计	13,994.80	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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融匠心优选混合A	中融匠心优选混合C
基金合同生效日(2021年11月02日)基金份额总额	706,383,143.59	52,833,049.40
本报告期期初基金份额总额	706,383,143.59	52,833,049.40
本报告期基金总申购份额	687,642.78	337,286.80
减：本报告期基金总赎回份额	67,598,623.82	11,139,983.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	639,472,162.55	42,030,352.74

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内基金管理人未有重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海	2	1,004,092,088.54	65.63%	734,285.22	66.03%	新增

证券						2 个交易单元。
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	333,938,419.83	21.83%	237,441.95	21.35%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	155,076,152.70	10.14%	113,406.37	10.20%	-
申万宏源	2	36,711,501.79	2.40%	26,847.99	2.41%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-

兴业证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
信达证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估
本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- ii 协议签署及通知托管人
本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	35,135,425.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于旗下基金执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
2	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-15
3	中融基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-17
4	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
5	中融匠心优选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-25
6	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
7	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-24

	等业务临时暂停服务的公告		
8	中融基金管理有限公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
9	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
10	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-30
11	中融基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-07

§ 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

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融匠心优选混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《中融匠心优选混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融匠心优选混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融匠心优选混合型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日