

---

# 国融融君灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:国融基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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。

本报告期自2021年1月1日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 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	61
8.7 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	61
8.8 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	61
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
9.3 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.....	65
§10 开放式基金份额变动.....	65
§11 重大事件揭示.....	65
11.1 基金份额持有人大会决议.....	65
11.2 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.....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8 其他重大事件.....	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
12.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§13 备查文件目录.....	70
13.1 备查文件目录.....	70
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国融融君灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国融融君混合	
基金主代码	006231	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年09月12日	
基金管理人	国融基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,734,760.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国融融君混合A	国融融君混合C
下属分级基金的交易代码	006231	006232
报告期末下属分级基金的份额总额	6,702,744.39份	32,015.76份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国融基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	毛灵俊	帅芳
	联系电话	010-68779177	021-38031815
	电子邮箱	maolingjun@gowinamc.com	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		4008190098	021-38917599-5
传真		010-88576097	021-38677819
注册地址		上海市虹口区东大名路687号 1幢4楼440室	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		北京海淀区西直门外大街168 号腾达大厦20层	上海市静安区新闸路669号博 华广场19楼
邮政编码		100044	200041
法定代表人		侯守法	贺青

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	国融基金管理有限公司	北京海淀区西直门外大街168号腾达大厦20层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021年	2020年	2019年
------------	-------	-------	-------

和指标	国融融 君混合A	国融融 君混合C	国融融 君混合A	国融融 君混合C	国融融 君混合A	国融融 君混合C
本期已实现收益	1,833,306.92	30,244.40	7,815,961.54	127,132.89	13,149,961.22	598,621.50
本期利润	-1,323,410.74	5,844.75	6,800,188.53	110,426.56	17,759,150.19	702,779.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1482	0.0864	0.3628	0.3596	0.2852	0.2389
本期加权平均净值利润率	-9.92%	5.57%	28.77%	28.51%	26.53%	22.60%
本期基金份额净值增长率	-10.37%	-10.85%	39.11%	38.83%	23.60%	23.14%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	2,700,593.58	12,326.18	6,625,431.21	103,201.30	5,907,498.46	64,106.84
期末可供分配基金份额利润	0.4029	0.3850	0.5329	0.5215	0.1497	0.1437
期末基金资产净值	9,403,337.97	44,341.94	19,461,102.99	307,460.51	46,281,871.89	520,743.92
期末基金份额净值	1.4029	1.3850	1.5652	1.5536	1.1730	1.1669
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	52.98%	51.10%	70.68%	69.49%	22.70%	22.08%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日；

4、本基金基金合同生效日为2018年9月12日，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国融融君混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.69%	0.59%	1.22%	0.24%	3.47%	0.35%
过去六个月	-8.55%	1.01%	0.20%	0.31%	-8.75%	0.70%
过去一年	-10.37%	1.20%	1.67%	0.35%	-12.04%	0.85%
过去三年	54.11%	1.08%	27.84%	0.38%	26.27%	0.70%
自基金合同生效起至今	52.98%	1.03%	27.20%	0.39%	25.78%	0.64%

国融融君混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.64%	0.59%	1.22%	0.24%	3.42%	0.35%
过去六个月	-8.64%	1.01%	0.20%	0.31%	-8.84%	0.70%
过去一年	-10.85%	1.20%	1.67%	0.35%	-12.52%	0.85%
过去三年	52.41%	1.08%	27.84%	0.38%	24.57%	0.70%
自基金合同生效起至今	51.10%	1.03%	27.20%	0.39%	23.90%	0.64%

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



国融融君混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年09月12日-2021年12月31日)

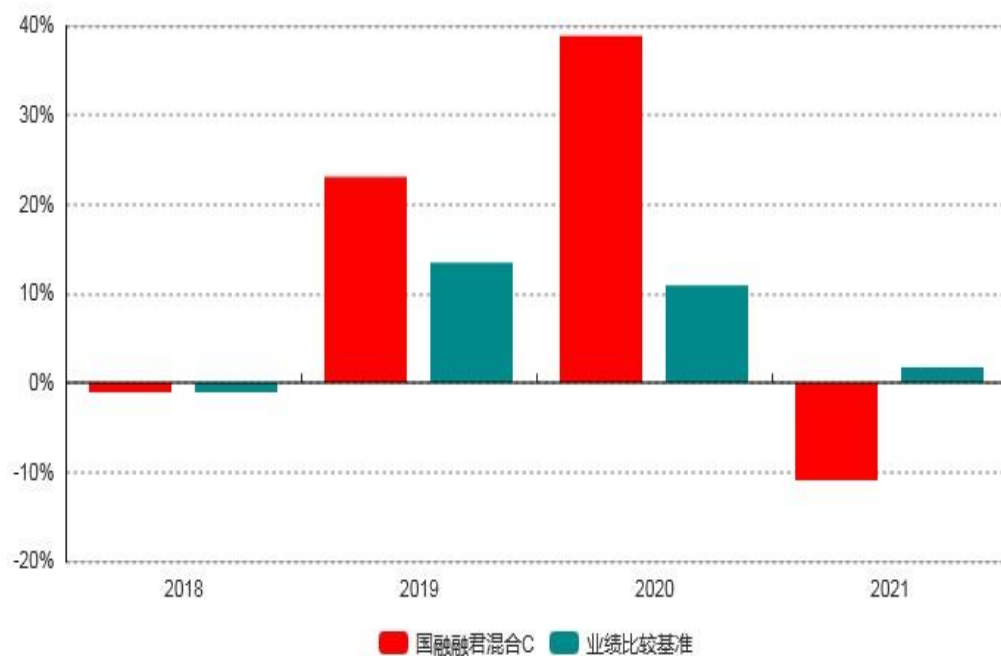
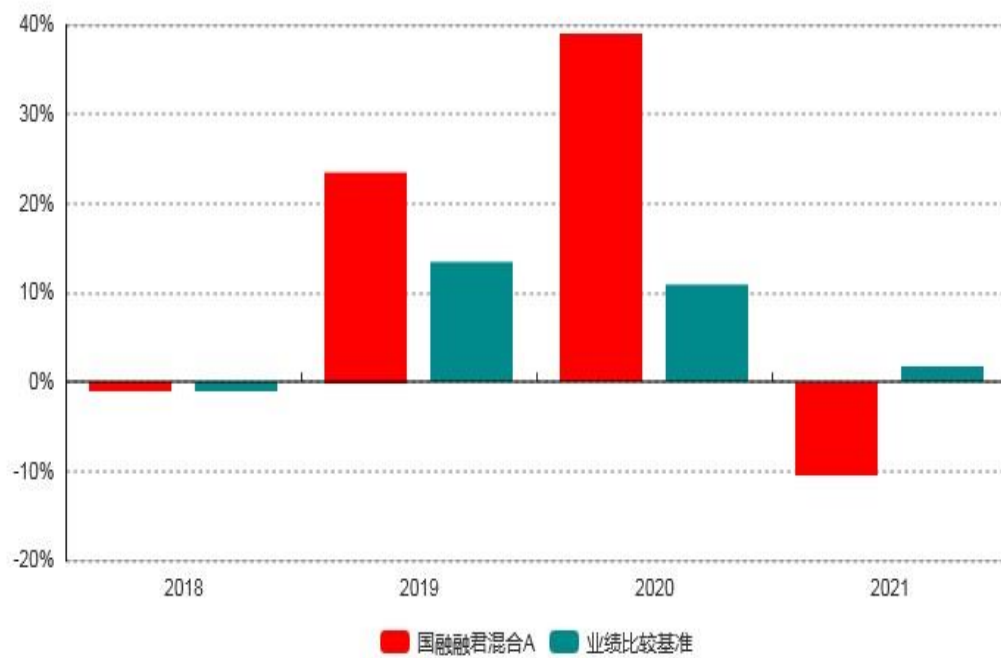


国融融君混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年09月12日-2021年12月31日)



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

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2018年9月12日生效，基金成立当年净值收益率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

国融融君混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	0.500	695,761.81	175,102.97	870,864.78	-
2019年	0.500	2,966,193.56	202,412.80	3,168,606.36	-
合计	1.000	3,661,955.37	377,515.77	4,039,471.14	-

国融融君混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	0.500	14,195.19	144.84	14,340.03	-
2019年	0.500	259,497.76	-	259,497.76	-
合计	1.000	273,692.95	144.84	273,837.79	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止本报告期末（2021年12月31日），基金管理人共管理7只公开募集证券投资基金及5只特定客户资产管理计划。其中，公开募集证券投资基金规模为2.79亿元，特定客户资产管理计划规模合计15.50亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
冯贇	本基金的基金经理、权益投资部副总监	2020-07-07	-	9年	冯贇先生，美国密歇根大学应用经济学、金融工程双硕士。具备9年证券从业经验，历任德勤华永会计师事务所税务及商务咨询部咨询员、埃森哲（中国）有限公司资本市场部高级分析师、永诚财产保险股份有限公司资产管理中心中级研究员、国泰君安证券股份有限公司研究所宏观分析师、圆信永丰基金管理有限公司专户投资部投资经理。

注：1、基金经理任职日期是基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，制定了《国融基金管理有限公司公平交易制度》，公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，内容涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、

优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年全球经济在疫情冲击后逐步复苏，商品价格不断攀升，各国面临的通胀压力逐渐上升。国内在地产政策收紧和严控地方政府隐性债务的背景下，社融增速下降带动固定资产投资增速下降，同时消费受疫情影响恢复缓慢，国内经济增长有所放缓。但从四季度开始，地产政策开始边际放松，12月降准叠加调降LPR利率，宽信用推动社融增速开始回升，稳增长不断加码，中国进入宽松周期。另外，受益于国内疫情的有效控制、全球经济刺激政策的出台，出口方面仍旧表现强劲。股市方面，消费医药板块受疫情影

响叠加估值较高，出现明显调整，中小市值板块表现较好，高景气的新能源、半导体板块表现优异。

本基金以绝对收益为投资目标，坚持价值投资，在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择业绩增长安全边际高的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。在仓位方面，根据合同要求基金净值高于1.3时，股票资产不低于净资产的50%，我们维持股票仓位在50%以上。2021年我们将配置重心布局在供需结构合理且具备业绩支撑的消费、医药、电新和TMT等行业中的优质龙头，精选估值合理、有业绩支撑的“专精特新”公司和细分行业里的隐形冠军，同时攻守兼备的转债也是我们的配置方向。在报告期间产品净值总体稳定，产品的波动维持在相对较小的范围内。我们将继续坚持绝对收益的理念，以长期稳健的表现穿越不同市场周期，通过净值持续稳定的增长给投资者带来较好的投资体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国融融君混合A基金份额净值为1.4029元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.37%，同期业绩比较基准收益率为1.67%；截至报告期末国融融君混合C基金份额净值为1.3850元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.85%，同期业绩比较基准收益率为1.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，由于新冠疫情爆发后欧美各国激进的财政和货币政策刺激政策导致通胀数据持续走高，21年12月美联储议息会议宣布将每月缩减购债的规模翻倍，22年1月宣布3月开始加息，标志着美联储开始加快收紧流动性。国内方面，从四季度开始，地产政策开始边际放松，12月降准叠加调降LPR利率，宽信用推动社融增速逐渐回升，稳增长政策不断加码，加之22年疫情将逐步消退，社零、服务业将逐步从疫情中恢复，我们预期明年经济仍能保持5%以上的增长，经济发展更加注重调结构和高质量增长。

在国内经济面临下行压力，美联储开始加息的背景下，我们预期2022年市场整体震幅变大，需要更多关注市场的结构性机会，我们选股时会特别考虑公司的增长潜力和估值水平的匹配。配置方面关注两条主线，一是估值在低位，行业出现拐点的稳增长板块，二是行业景气度高，年初以来大幅调整后估值趋于合理的高增长公司，另外疫情后复苏的社服板块也值得关注。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人有序进行监察稽核工作，主要采取了如下监察稽核措施：定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照

监管机构下发的各项通知，开展有针对性的专项稽核工作。持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易分析投资人员的投资行为，防范出现违规行为。关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人由运营支持部负责人、基金运营部负责人、合规风控部负责人、投资研究部负责人、固定收益部负责人、基金经理等组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术的应用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2021年12月31日，国融融君A期末未分配利润为2,700,593.58元（其中：国融融君A的未分配利润已实现部分为4,600,510.35元，未分配利润未实现部分为-1,899,916.77元）；国融融君C期末未分配利润为12,326.18元（其中：国融融君C的未分配利润已实现部分为21,325.10元，未分配利润未实现部分为-8,998.92元）。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

2、本基金自2019年9月12日至2021年12月31日出现连续超六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人前期已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

### § 6 审计报告



## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2203448号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国融融君灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的国融融君灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“国融融君混合基金”）财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表、2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了国融融君混合基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国融融君混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	国融融君混合基金管理人国融基金管理有限公司

	<p>司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括国融融君混合基金2021年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注7.4.2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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国融融君混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非国融融君混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督国融融君混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用</p>

	<p>职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国融融君混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国融融君混合基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	管祎铭	贾君宇
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2022-03-23	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,166,542.31	2,877,424.94
结算备付金		14,430.25	562,391.07
存出保证金		-	153,014.40
交易性金融资产	7.4.7.2	8,477,393.00	16,394,243.76
其中：股票投资		8,477,393.00	16,394,243.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	470.85	4,438.45
应收股利		-	-
应收申购款		537.64	442.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,659,374.05	19,991,955.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		586.63	-
应付管理人报酬		9,515.35	19,549.01
应付托管费		1,585.91	3,258.21
应付销售服务费		6.25	59.82
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	524.55
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,000.00	200,000.00
负债合计		211,694.14	223,391.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	6,734,760.15	12,631,214.31
未分配利润	7.4.7.10	2,712,919.76	7,137,349.19
所有者权益合计		9,447,679.91	19,768,563.50
负债和所有者权益总计		9,659,374.05	19,991,955.09

注：报告截止日2021年12月31日，A类基金净值人民币1.4029元，基金份额总额6,702,744.39份，C类基金净值人民币1.3850元，基金份额总额32,015.76份，总份额合计6,734,760.15份。

## 7.2 利润表

会计主体：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		-815,544.97	7,572,212.23

1. 利息收入		28,101.44	71,073.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,101.44	54,463.31
债券利息收入		-	16,124.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	485.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,336,324.12	8,529,792.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,191,013.76	6,989,926.87
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	1,410,614.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	71,440.20	-52,080.00
股利收益	7.4.7.17	73,870.16	181,331.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-3,181,117.31	-1,032,479.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,146.78	3,825.12
<b>减：二、费用</b>		502,021.02	661,597.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	162,466.06	290,024.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	27,077.75	48,337.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	219.50	779.43
4. 交易费用	7.4.7.20	281,214.52	231,925.41
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		643.19	30.63
7. 其他费用	7.4.7.21	30,400.00	90,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,317,565.99	6,910,615.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,317,565.99	6,910,615.09

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国融融君灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,631,214.31	7,137,349.19	19,768,563.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,317,565.99	-1,317,565.99
三、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)	-5,896,454.16	-3,106,863.44	-9,003,317.60
其中：1. 基金申购款	445,853.53	236,663.86	682,517.39
2. 基金赎回款	-6,342,307.69	-3,343,527.30	-9,685,834.99
四、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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	6,734,760.15	2,712,919.76	9,447,679.91
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	39,901,959.35	6,900,656.46	46,802,615.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,910,615.09	6,910,615.09
三、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)	-27,270,745.04	-5,788,717.55	-33,059,462.59
其中：1. 基金申购款	1,277,257.41	326,886.11	1,604,143.52
2. 基金赎回款	-28,548,002.45	-6,115,603.66	-34,663,606.11
四、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)	-	-885,204.81	-885,204.81
五、期末所有者权益(基金净值)	12,631,214.31	7,137,349.19	19,768,563.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

徐进

王占祥

侯欣竞



基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2021年内,本基金出现连续超60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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7.4.2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的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况、2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。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。

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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；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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 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公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量；
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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：

- 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；
- 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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。

#### 7.4.4.9 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。

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。

债券利息收入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，在债券实际持有期内逐日计提。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，逐日计提利息收入。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收入。

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。

#### 7.4.4.10 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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类

基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的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。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 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》（以下简称“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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税 [2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16号《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》、财税 [2008] 1号文《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 [2016] 36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

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

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其

股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	680,311.73	1,399,262.38
定期存款	-	-
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	486,230.58	1,478,162.56
合计	1,166,542.31	2,877,424.94

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元



项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,451,550.84	8,477,393.00	25,842.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,451,550.84	8,477,393.00	25,842.16
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		13,254,919.74	16,394,243.76	3,139,324.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		13,254,919.74	16,394,243.76	3,139,324.02

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,024,800.00	-	-	-
--股指期货	1,024,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,024,800.00	-	-	-

注：1、本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

2、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则--金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具--股指期货投资”与“证券清算款--股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具--股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

3、本基金于上年度末持有IH2101买入合约1手，合约市值1,092,960.00元，公允价值变动金额68,160.00元。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

##### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	340.11	756.10
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	130.74	379.24
应收结算备付金利息	-	3,303.11
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	470.85	4,438.45

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金于本报告期末及上年度末均无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	-	-
应付审计费用	30,000.00	30,000.00
应付信息披露费	170,000.00	170,000.00
合计	200,000.00	200,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 国融融君混合A

金额单位：人民币元

项目 (国融融君混合A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	12,433,312.81	12,433,312.81
本期申购	391,203.66	391,203.66
本期赎回(以“-”号填列)	-6,121,772.08	-6,121,772.08
本期末	6,702,744.39	6,702,744.39

## 7.4.7.9.2 国融融君混合C

金额单位：人民币元

项目 (国融融君混合C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	197,901.50	197,901.50
本期申购	54,649.87	54,649.87
本期赎回(以“-”号填列)	-220,535.61	-220,535.61
本期末	32,015.76	32,015.76

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 国融融君混合A

单位：人民币元

项目 (国融融君混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,625,431.21	402,358.97	7,027,790.18
本期利润	1,833,306.92	-3,156,717.66	-1,323,410.74
本期基金份额交易产生的变动数	-3,858,227.78	854,441.92	-3,003,785.86
其中：基金申购款	261,930.86	-46,018.70	215,912.16
基金赎回款	-4,120,158.64	900,460.62	-3,219,698.02

本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,600,510.35	-1,899,916.77	2,700,593.58

## 7.4.7.10.2 国融融君混合C

单位：人民币元

项目 (国融融君混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,201.30	6,357.71	109,559.01
本期利润	30,244.40	-24,399.65	5,844.75
本期基金份额交易产生的变动数	-112,120.60	9,043.02	-103,077.58
其中：基金申购款	36,893.89	-16,142.19	20,751.70
基金赎回款	-149,014.49	25,185.21	-123,829.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,325.10	-8,998.92	12,326.18

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	17,258.75	33,781.83
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	10,138.78	17,378.37
结算备付金利息收入	703.91	3,303.11
其他	-	-
合计	28,101.44	54,463.31

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	95,854,671.85	84,200,164.51
减：卖出股票成本总额	93,663,658.09	77,210,237.64
买卖股票差价收入	2,191,013.76	6,989,926.87

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期及上年度均无股票出借差价收入。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期及上年度均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	1,410,614.20
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	-	1,410,614.20

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转	-	27,423,295.28

股及债券到期兑 付) 成交总额		
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	-	25,966,524.09
减: 应收利息总额	-	46,156.99
买卖债券差价收入	-	1,410,614.20

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期及上年度均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期及上年度均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金在本报告期及上年度均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
期货投资	71,440.20	-52,080.00

#### 7.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021 年12月31日	2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	73,870.16	181,331.39
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	73,870.16	181,331.39

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12 月31日	2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-3,113,481.86	-1,100,114.79
——股票投资	-3,113,481.86	106,758.58
——债券投资	-	-1,206,873.37
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-68,160.00	68,160.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-68,160.00	68,160.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-524.55	524.55
合计	-3,181,117.31	-1,032,479.34

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日



基金赎回费收入	1,146.78	3,825.12
合计	1,146.78	3,825.12

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	280,572.08	231,250.88
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	642.44	674.53
合计	281,214.52	231,925.41

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	400.00	-
账户维护费	-	10,500.00
合计	30,400.00	90,500.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国融证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
上海谷若投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
国融基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国泰君安 证券股份 有限公司	184,714,961.04	100.00%	146,833,684.73	100.00%

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例

国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	37,630,172.66	100.00%
----------------------	---	---	---------------	---------

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	6,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰君安 证券股份 有限公司	168,330.67	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
国泰君安 证券股份 有限公司	133,627.57	100.00%	-	-

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	162,466.06	290,024.25
其中：支付销售机构的客户维护费	56,500.96	96,179.90

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	27,077.75	48,337.42

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

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2021年01月01日至2021年12月31日
--------------	-------------------------------

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国融融君混合A	国融融君混合C	合计
国融基金管理有限公司	0.00	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	0.00	204.82	204.82
合计	0.00	204.82	204.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国融融君混合A	国融融君混合C	合计
国融基金管理有限公司	0.00	0.01	0.01
国泰君安证券股份有限公司	0.00	766.69	766.69
合计	0.00	766.70	766.70

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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：

C类基金日基金销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.20%/当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期及上年度均未与关联方进行过转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期及上年度均未持有过本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有过本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	680,311.73	17,258.75	1,399,262.38	33,781.83

本基金通过托管人国泰君安证券转存于中国交通银行股份有限公司上海交银大厦支行的银行存款，于2021年12月31日的相关余额为人民币680,311.73元（2020年12月31日：人民币1,399,262.38元），2021年产生的利息收入为人民币17,258.75元（2020年12月31日：人民币33,781.83元）。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2021年12月31日，本基金未持有流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年12月31日，本基金未持有流通受限证券。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金均未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金均未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金均未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金

的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%。

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理



人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,166,542.31	-	-	-	-	1,166,542.31
结算备付金	14,430.25	-	-	-	-	14,430.25
交易性金融资产	-	-	-	-	8,477,393.00	8,477,393.00
应收利息	-	-	-	-	470.85	470.85
应收申购款	-	-	-	-	537.64	537.64
资产总计	1,180,972.56	-	-	-	8,478,401.49	9,659,374.05
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	586.63	586.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	9,515.35	9,515.35
应付托管费	-	-	-	-	1,585.91	1,585.91
应付销售服务费	-	-	-	-	6.25	6.25

其他负债	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	211,694.14	211,694.14
利率敏感度缺口	1,180,972.56	-	-	-	8,266,707.35	9,447,679.91
上年度末 2020年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,877,424.94	-	-	-	-	2,877,424.94
结算备付金	-	-	-	-	562,391.07	562,391.07
存出保证金	-	-	-	-	153,014.40	153,014.40
交易性金融资产	-	-	-	-	16,394,243.76	16,394,243.76
应收利息	-	-	-	-	4,438.45	4,438.45
应收申购款	-	-	-	-	442.47	442.47
资产总计	2,877,424.94	-	-	-	17,114,530.15	19,991,955.09
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	19,549.01	19,549.01
应付托管费	-	-	-	-	3,258.21	3,258.21
应付销售服务费	-	-	-	-	59.82	59.82
应交税费	-	-	-	-	524.55	524.55
其他负债	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	223,391.59	223,391.59
利率敏感度缺口	2,877,424.94	-	-	-	16,891,138.56	19,768,563.50

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金均未持有对利率敏感的交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	8,477,393.00	89.73	16,394,243.76	82.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,477,393.00	89.73	16,394,243.76	82.93

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2021年12月31日	2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,025,286.07	1,885,374.47
	业绩比较基准下降5%	-1,025,286.07	-1,885,374.47

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

以下主要阐述本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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。

于2021年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币8,477,393.00元，均属于第一层次的交易性金融资产，均为股票投资。

于2020年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币16,394,243.76元，均属于第一层次的交易性金融资产，均为股票投资。

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。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。

##### (a) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2020年12月31日：无）。

##### 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	8,477,393.00	87.76
	其中：股票	8,477,393.00	87.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,180,972.56	12.23
8	其他各项资产	1,008.49	0.01
9	合计	9,659,374.05	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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	160,470.00	1.70
C	制造业	5,243,108.00	55.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	448,708.00	4.75
E	建筑业	91,000.00	0.96
F	批发和零售业	96,853.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	733,124.00	7.76
J	金融业	762,185.00	8.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	447,911.00	4.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	305,010.00	3.23
R	文化、体育和娱乐业	189,024.00	2.00
S	综合	-	-
	合计	8,477,393.00	89.73

### 8.2.2 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投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600036	招商银行	5,800	282,518.00	2.99
2	601318	中国平安	5,500	277,255.00	2.93
3	002677	浙江美大	15,800	274,130.00	2.90
4	002345	潮宏基	49,300	271,643.00	2.88
5	002925	盈趣科技	7,100	241,613.00	2.56
6	600461	洪城环境	29,600	241,240.00	2.55
7	002236	大华股份	10,200	239,496.00	2.53
8	688111	金山办公	900	238,500.00	2.52
9	002415	海康威视	4,500	235,440.00	2.49
10	002027	分众传媒	27,900	228,501.00	2.42
11	002555	三七互娱	8,300	224,266.00	2.37

12	601888	中国中免	1,000	219,410.00	2.32
13	600438	通威股份	4,800	215,808.00	2.28
14	002832	比音勒芬	8,200	208,690.00	2.21
15	600803	新奥股份	11,300	207,468.00	2.20
16	300244	迪安诊断	6,100	204,777.00	2.17
17	300033	同花顺	1,400	202,412.00	2.14
18	600060	海信视像	14,900	200,405.00	2.12
19	601233	桐昆股份	9,300	196,974.00	2.08
20	600887	伊利股份	4,700	194,862.00	2.06
21	600309	万华化学	1,900	191,900.00	2.03
22	002293	罗莱生活	13,200	189,156.00	2.00
23	300144	宋城演艺	13,200	189,024.00	2.00
24	300502	新易盛	4,800	188,064.00	1.99
25	603658	安图生物	3,400	187,204.00	1.98
26	000858	五粮液	800	178,128.00	1.89
27	688561	奇安信	2,000	175,840.00	1.86
28	000786	北新建材	4,200	150,486.00	1.59
29	002508	老板电器	4,000	144,080.00	1.53
30	002384	东山精密	5,100	138,210.00	1.46
31	600690	海尔智家	4,600	137,494.00	1.46
32	600031	三一重工	5,800	132,240.00	1.40
33	603712	七一二	2,900	125,570.00	1.33
34	300146	汤臣倍健	4,600	124,016.00	1.31
35	000932	华菱钢铁	24,200	123,662.00	1.31
36	603816	顾家家居	1,500	115,740.00	1.23
37	600426	华鲁恒升	3,400	106,420.00	1.13
38	603833	欧派家居	700	103,250.00	1.09
39	300408	三环集团	2,300	102,580.00	1.09
40	601615	明阳智能	3,900	101,790.00	1.08
41	603882	金域医学	900	100,233.00	1.06
42	603233	大参林	2,300	96,853.00	1.03

43	002250	联化科技	5,300	95,241.00	1.01
44	002230	科大讯飞	1,800	94,518.00	1.00
45	601677	明泰铝业	2,100	92,589.00	0.98
46	601899	紫金矿业	9,500	92,150.00	0.98
47	601668	中国建筑	18,200	91,000.00	0.96
48	601225	陕西煤业	5,600	68,320.00	0.72
49	300558	贝达药业	800	63,864.00	0.68
50	002876	三利谱	1,000	62,480.00	0.66
51	600111	北方稀土	1,300	59,540.00	0.63
52	603877	太平鸟	1,600	44,608.00	0.47
53	836077	吉林碳谷	100	5,735.00	0.06

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600519	贵州茅台	4,088,455.90	20.68
2	601006	大秦铁路	3,177,470.00	16.07
3	600036	招商银行	3,172,064.00	16.05
4	603259	药明康德	3,069,206.00	15.53
5	601166	兴业银行	2,864,830.81	14.49
6	601318	中国平安	2,425,981.00	12.27
7	600377	宁沪高速	2,259,165.00	11.43
8	600276	恒瑞医药	2,213,327.70	11.20
9	601398	工商银行	2,164,161.00	10.95
10	000932	华菱钢铁	2,150,493.00	10.88
11	600309	万华化学	1,985,374.00	10.04
12	600585	海螺水泥	1,840,049.00	9.31
13	600176	中国巨石	1,745,111.00	8.83
14	600048	保利发展	1,649,781.00	8.35



15	601012	隆基股份	1,606,329.00	8.13
16	600170	上海建工	1,534,438.00	7.76
17	600373	中文传媒	1,525,017.00	7.71
18	000858	五粮液	1,523,226.00	7.71
19	002027	分众传媒	1,479,001.00	7.48
20	600741	华域汽车	1,417,659.00	7.17
21	600977	中国电影	1,339,580.00	6.78
22	601888	中国中免	1,336,903.00	6.76
23	601158	重庆水务	1,336,271.00	6.76
24	000157	中联重科	1,279,110.00	6.47
25	600886	国投电力	1,218,307.97	6.16
26	601899	紫金矿业	1,203,154.00	6.09
27	002475	立讯精密	1,173,132.00	5.93
28	600438	通威股份	1,133,360.00	5.73
29	000333	美的集团	1,113,693.00	5.63
30	300760	迈瑞医疗	1,013,319.00	5.13
31	688111	金山办公	914,715.28	4.63
32	688561	奇安信	874,087.26	4.42
33	600660	福耀玻璃	866,982.00	4.39
34	600486	扬农化工	841,374.00	4.26
35	002078	太阳纸业	752,745.00	3.81
36	300750	宁德时代	750,090.00	3.79
37	002271	东方雨虹	701,358.00	3.55
38	002353	杰瑞股份	635,110.00	3.21
39	600426	华鲁恒升	629,488.00	3.18
40	300408	三环集团	627,372.00	3.17
41	000661	长春高新	612,076.50	3.10
42	600031	三一重工	595,651.00	3.01
43	002415	海康威视	555,793.00	2.81
44	300699	光威复材	555,661.00	2.81
45	000568	泸州老窖	551,393.00	2.79

46	300498	温氏股份	540,552.00	2.73
47	002624	完美世界	527,903.00	2.67
48	603658	安图生物	517,653.00	2.62
49	002345	潮宏基	504,861.00	2.55
50	300244	迪安诊断	492,600.00	2.49
51	600887	伊利股份	491,190.00	2.48
52	600350	山东高速	474,538.00	2.40
53	300347	泰格医药	471,943.00	2.39
54	002594	比亚迪	469,951.00	2.38
55	002832	比音勒芬	465,468.00	2.35
56	688169	石头科技	462,802.00	2.34
57	603877	太平鸟	462,064.00	2.34
58	603501	韦尔股份	420,017.00	2.12
59	601689	拓普集团	411,767.00	2.08
60	002230	科大讯飞	411,263.93	2.08
61	300014	亿纬锂能	408,272.00	2.07

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

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	5,280,934.00	26.71
2	600036	招商银行	3,968,914.04	20.08
3	603259	药明康德	3,260,255.40	16.49
4	601006	大秦铁路	3,188,711.00	16.13
5	600276	恒瑞医药	3,005,453.08	15.20
6	601318	中国平安	2,798,465.00	14.16
7	601166	兴业银行	2,736,995.00	13.85
8	600309	万华化学	2,632,457.29	13.32
9	601012	隆基股份	2,625,222.03	13.28

10	600377	宁沪高速	2,290,927.00	11.59
11	601398	工商银行	2,140,223.00	10.83
12	000932	华菱钢铁	2,063,094.00	10.44
13	600741	华域汽车	1,855,787.00	9.39
14	000333	美的集团	1,834,997.25	9.28
15	600176	中国巨石	1,802,478.47	9.12
16	600585	海螺水泥	1,747,503.00	8.84
17	002027	分众传媒	1,637,445.00	8.28
18	000858	五粮液	1,618,734.00	8.19
19	002475	立讯精密	1,595,466.00	8.07
20	600373	中文传媒	1,560,666.12	7.89
21	600486	扬农化工	1,506,436.00	7.62
22	600048	保利发展	1,502,582.00	7.60
23	600170	上海建工	1,494,603.00	7.56
24	300760	迈瑞医疗	1,425,737.64	7.21
25	601158	重庆水务	1,384,994.74	7.01
26	601899	紫金矿业	1,338,999.00	6.77
27	600886	国投电力	1,325,644.00	6.71
28	600977	中国电影	1,310,095.00	6.63
29	688561	奇安信	1,294,895.88	6.55
30	000157	中联重科	1,254,567.00	6.35
31	600031	三一重工	1,180,804.00	5.97
32	600426	华鲁恒升	1,125,432.00	5.69
33	601888	中国中免	1,081,440.00	5.47
34	000338	潍柴动力	1,033,867.00	5.23
35	000002	万科A	1,026,407.00	5.19
36	300750	宁德时代	910,656.00	4.61
37	002142	宁波银行	895,092.00	4.53
38	600438	通威股份	863,570.00	4.37
39	688111	金山办公	816,141.24	4.13
40	600660	福耀玻璃	794,641.00	4.02

41	002353	杰瑞股份	719,656.00	3.64
42	002271	东方雨虹	680,464.00	3.44
43	002078	太阳纸业	656,673.00	3.32
44	002179	中航光电	596,301.00	3.02
45	002352	顺丰控股	596,279.00	3.02
46	300408	三环集团	595,570.00	3.01
47	000568	泸州老窖	590,701.00	2.99
48	000661	长春高新	590,474.00	2.99
49	002594	比亚迪	584,104.45	2.95
50	300699	光威复材	577,310.00	2.92
51	601100	恒立液压	528,563.00	2.67
52	300498	温氏股份	508,735.00	2.57
53	601689	拓普集团	502,284.55	2.54
54	002624	完美世界	501,799.00	2.54
55	600350	山东高速	461,854.90	2.34
56	002032	苏泊尔	461,083.00	2.33
57	300014	亿纬锂能	425,085.00	2.15
58	688169	石头科技	422,560.00	2.14
59	300450	先导智能	417,204.00	2.11
60	300347	泰格医药	410,838.00	2.08
61	300832	新产业	400,849.00	2.03
62	603501	韦尔股份	395,715.00	2.00

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。

#### 8.4.3 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	88,860,289.19
卖出股票收入（成交）总额	95,854,671.85

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					71,440.20
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-68,160.00

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行（证券代码：600036.SH）和洪城环境（证券代码：600461.SH）外其他证券的发行主体未发现有被监管部门立案调查，未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、招商银行（证券代码：600036.SH）

根据2021年5月21日发布的相关公告，招商银行因存在以下问题被中国银行保险监督管理委员会处罚7170万元：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。

#### 2、洪城环境（证券代码：600461.SH）

根据2021年6月18日发布的相关公告，洪城环境因存在以下问题被上海证券交易所予以监管警示：经查明，江西洪城环境股份有限公司（以下简称洪城环境或公司）于2021年1月29日公告披露了《发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易预案》（以下简称重组预案）。根据重组预案，上市公司拟以发行股份的方式购买江西鼎元生态环保有限公司（以下简称鼎元生态）、江西蓝天碧水环保工程有限责任公司（以下简称蓝天碧水环保）及安义县自来水有限责任公司（以下简称安义自来水）100%的股权。根据重组预案，重组标的鼎元生态截至2020年10月30日所有者权益为7.29亿元，相较于2019年期末数据4.75亿元，出现大幅增长。针对上述变化，监管部门向公司发出关于重组预案的信息披露问询函，要求公司补充披露鼎元生态所有者权益短期内发生大幅变动的原

因。2月25日，公司披露回复公告称，在计算披露标的资产财务数据时，误将蓝天碧水环保、安义自来水财务数据合并进入鼎元生态，导致重组预案披露的鼎元生态相关财务数据有误，公司据此对重组预案进行相应更正。更正后，截至2020年10月底，鼎元生态的主要财务数据分别为总资产25.42亿元、负债19.09亿元、所有者权益4.08亿元、2020年1至10月实现营业收入3.44亿元和归母净利润2785.33万元，分别较更正前披露金额下降19.93%、14.01%、44.12%、23.52%和49.04%。上市公司筹划重大资产重组，可能对公司股价和投资者决策产生较大影响。尤其是重组预案中披露的标的资产财务经营数据，是投资者获知本次重组信息、判断重组标的的质量的重要依据，市场关注度较高。上市公司应根据实际情况，对相关财务数据进行客观、谨慎地核算并披露。公司误将其他标的公司财务数据合并进入鼎元生态，导致重组预案披露的鼎元生态所有者权益、营业收入、净利润等财务数据不真实、不准确，可能对投资者决策造成误导。公司上述行为违反了《上市公司重大资产重组管理办法》第四条，《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第2.1条、第2.5条以及《上海证券交易所上市公司自律监管规则适用指引第1号—重大资产重组》第三条等有关规定。公司时任董事会秘书邓勋元（任期2016年5月20日至今）作为信息披露事务的负责人，未勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任，违反了《股票上市规则》第2.2条、第3.1.4条、第3.2.2条等有关规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。上海证券交易所给予江西洪城环境股份有限公司及时任董事会秘书邓勋元予以监管警示。

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	470.85
5	应收申购款	537.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,008.49
---	----	----------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
国融 融君 混合A	3,635	1,843.95	1,474.81	0.02%	6,701,269.58	99.98%
国融 融君 混合C	34	941.64	0.00	0.00%	32,015.76	100.00%
合计	3,669	1,835.58	1,474.81	0.02%	6,733,285.34	99.98%

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

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。



### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国融融君混合A	国融融君混合C
基金合同生效日(2018年09月12日)基金份额总额	258,610,003.32	23,003,186.10
本报告期期初基金份额总额	12,433,312.81	197,901.50
本报告期基金总申购份额	391,203.66	54,649.87
减：本报告期基金总赎回份额	6,121,772.08	220,535.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,702,744.39	32,015.76

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，根据公司第二届董事会第十一次会议决议自2021年1月6日起聘任王占祥先生担任公司总经理职务，自总经理任职之日起，董事长侯守法先生不再代为履行总经理职务；根据公司第二届董事会第十八次会议决议自2021年5月21日起聘任徐进先生担任公司常务副总经理职务。根据公司第二届董事会第二十一次会议决议自2021年8月6日期聘任徐进先生担任公司总经理职务，卸任常务副总经理职务；同时聘任王占祥先生担任公司副总经理兼首席信息官职务，卸任总经理职务。根据公司第二届第二十三次会议决议自2021年9月28日起聘任冯耀东先生担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未改变基金投资策略。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费为30,000.00元，该审计机构已连续4年为本基金提供审计服务。

#### 11.6 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	3	184,714,961.04	100.00%	168,330.67	100.00%	-

##### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

- 1、本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。
- 2、本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：
  - （1）券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；
  - （2）具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
  - （3）券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告。
- 3、本公司使用券商交易单元的程序

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

4、报告期内使用证券公司交易单元的变更情况：

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

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国融基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2020 年年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定的媒介	2021-01-01
2	国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2021-01-07
3	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定的媒介	2021-01-22
4	国融基金管理有限公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-01-28
5	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定的媒介	2021-03-31
6	国融基金管理有限公司关于增加众惠基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-04-22
7	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定的媒介	2021-04-22
8	国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2021-05-22

9	国融基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-06-21
10	国融基金管理有限公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-06-30
11	国融基金管理有限公司关于旗下开放式基金2021年半年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定的媒介	2021-07-01
12	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会指定的媒介	2021-07-21
13	国融基金管理有限公司关于增加玄元保险代理有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-07-23
14	国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2021-08-07
15	国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2021-08-07
16	国融基金管理有限公司关于增加上海中正达广基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-08-09
17	国融基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-08-25

18	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会指定的媒介	2021-08-31
19	国融基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-09-15
20	国融基金管理有限公司关于增加北京微动利基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-09-16
21	国融基金管理有限公司关于增加一路财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-09-16
22	国融基金管理有限公司北京分公司负责人变更的公告	中国证监会指定的媒介	2021-09-23
23	国融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2021-09-29
24	国融基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售股份有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-10-08
25	国融基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-10-13
26	国融融君灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会指定的媒介	2021-10-27
27	国融基金管理有限公司关于	中国证监会指定的媒介	2021-11-01

	增加上海爱建基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告		
28	国融融君灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	中国证监会指定的媒介	2021-11-24
29	国融融君灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	中国证监会指定的媒介	2021-11-24
30	国融融君灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定的媒介	2021-11-24
31	国融基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	中国证监会指定的媒介	2021-11-24
32	国融基金管理有限公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2021-12-11

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

国融基金管理有限公司  
二〇二二年三月三十一日