

国金惠诚债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.11 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金惠诚债券型证券投资基金	
基金简称	国金惠诚	
场内简称	-	
基金主代码	010249	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年4月14日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,822,112.90份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	国金惠诚 A	国金惠诚 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	010249	010250
报告期末下属分级基金的份额总额	5,897,139.46份	2,924,973.44份

注：无

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金在综合考虑基金组合的流动性需求及投资风险控制的基础上，根据对国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的分析和判断，在法律法规及基金合同规定的比例限制内，动态调整组合结构，追求较低风险下的较高组合收益。	
业绩比较基准	90%×中债-综合全价(总值)指数收益率+10%×沪深300指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
	国金惠诚 A	国金惠诚 C
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：无

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	国金基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽
	联系电话	010-88005632
		罗菲菲
		010-58560666

	电子邮箱	zhangli@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95568
传真		010-88005666	010-57093382
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100089	100031
法定代表人		邵海波	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 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

基金级别	国金惠诚 A	国金惠诚 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-159,201.83	-116,835.23
本期利润	-160,422.61	-119,615.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0258	-0.0345
本期加权平均净值利润率	-2.56%	-3.44%
本期基金份额净值增长率	-2.31%	-2.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	100,789.89	34,447.45
期末可供分配基金份额利润	0.0171	0.0118
期末基金资产净值	5,997,929.35	2,959,420.89
期末基金份额净值	1.0171	1.0118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.71%	1.18%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 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。

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

国金惠诚 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	1.79%	0.29%	0.72%	0.10%	1.07%	0.19%
过去三个月	1.64%	0.20%	0.93%	0.14%	0.71%	0.06%
过去六个月	-2.31%	0.18%	-0.51%	0.15%	-1.80%	0.03%
过去一年	1.84%	0.20%	0.28%	0.13%	1.56%	0.07%

自基金合同生效起至今	1.71%	0.19%	1.16%	0.13%	0.55%	0.06%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

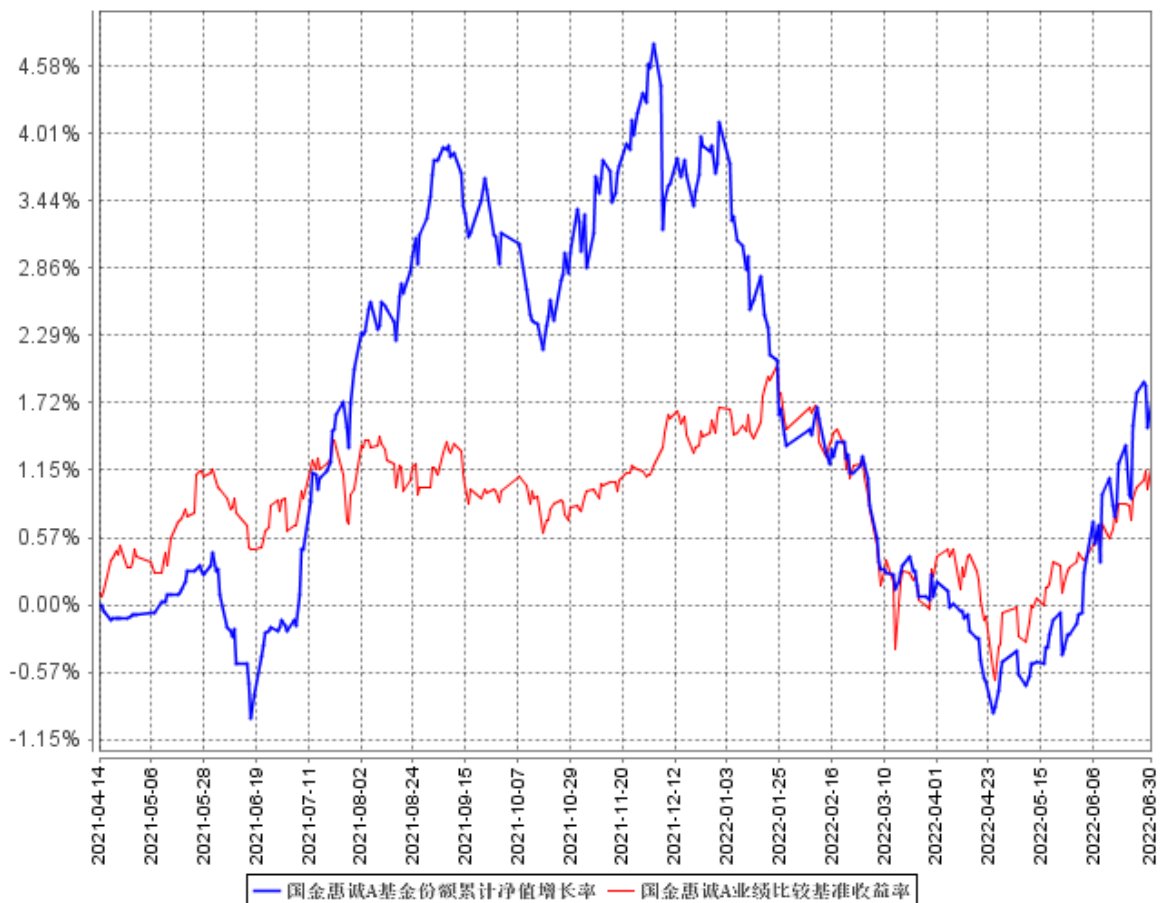
国金惠诚 C

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	1.76%	0.29%	0.72%	0.10%	1.04%	0.19%
过去三个月	1.54%	0.20%	0.93%	0.14%	0.61%	0.06%
过去六个月	-2.51%	0.18%	-0.51%	0.15%	-2.00%	0.03%
过去一年	1.41%	0.20%	0.28%	0.13%	1.13%	0.07%
自基金合同生效起至今	1.18%	0.19%	1.16%	0.13%	0.02%	0.06%

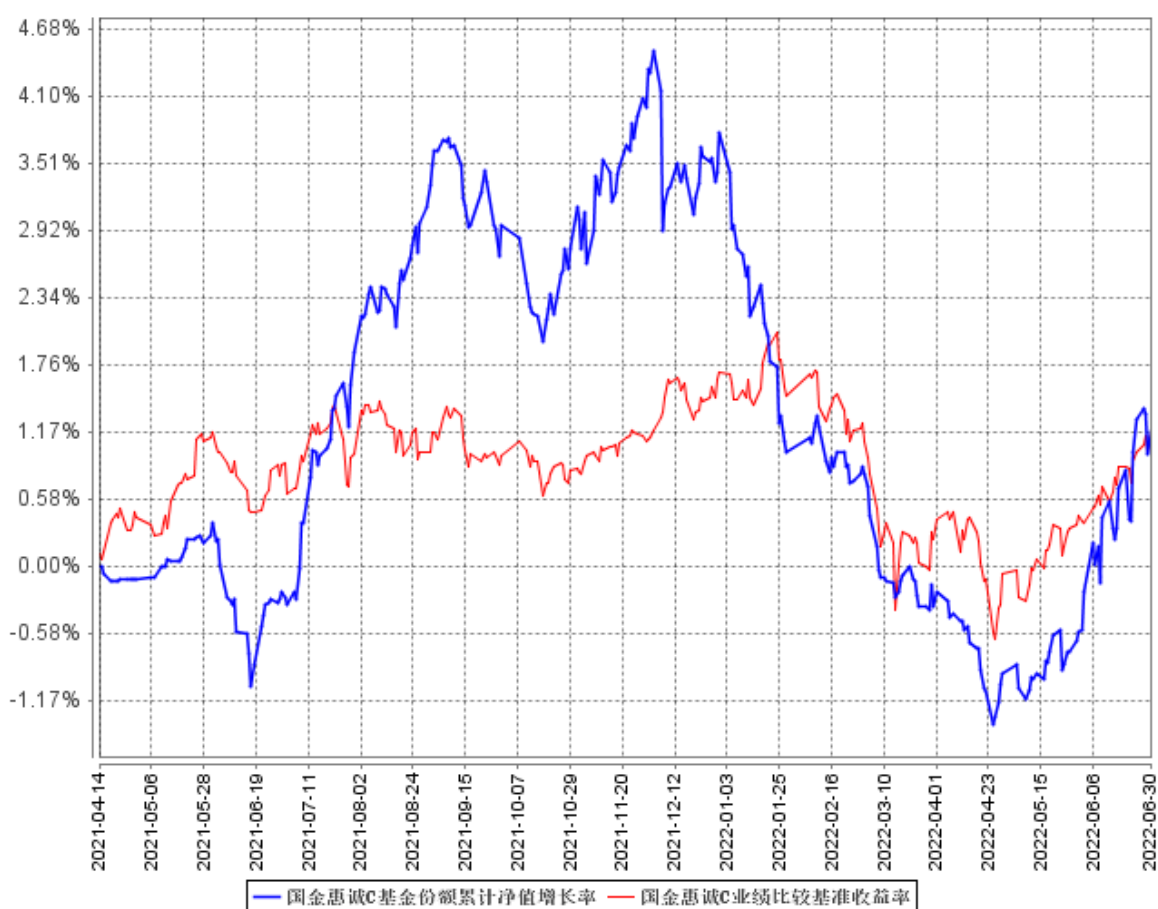
注：本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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

国金惠诚A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金惠诚C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2021 年 4 月 14 日，图示日期为 2021 年 4 月 14 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2021 年 4 月 14 日至 2021 年 10 月 13 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：无

§ 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.5%、1.9%和1.6%。截至2022年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金惠利纯债债券型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金。

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		
张航	本基金基金经理，国金国鑫发起、国金鑫悦经济新动能	2021年4月14日	-	16	张航先生，中央财经大学博士。2006年6月至2011年4月在长盛基金管理有限公司任研究部研究员，2011年4月至2016年4月先后历任新华资产管理有限公司首席策略研究

	能、国金自主创新、国金ESG持续增长、国金新兴价值基金经理，主动权益投资部总经理兼主动权益投资总监				员、消费行业研究组组长、股票投资经理，2016年4月至2016年8月在北京汇垠天然投资基金管理有限公司投资部任常务副总裁，2016年9月至2019年1月任北京忠诚志业资本管理有限公司研究部研究总监、副总经理。2019年2月加入国金基金管理有限公司，历任主动权益投资副总监；现任主动权益投资部总经理兼主动权益投资总监。
于涛	本基金基金经理，国金惠安利率债、国金惠盈纯债基金经理，公司副总经理兼固定收益投资总监	2021年4月14日	-	17	于涛先生，中国人民大学财务学博士。1994年7月至2018年7月先后历任中国农业银行山东省分行公司信贷部高级经理，大公国际评估有限公司工商企业评级部总经理，中债资信评估有限公司研究部副总经理，银河基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员，融通基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员、信用债研究主管，安信证券股份有限公司资产管理部高级债券投资经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级债券基金经理，富荣基金管理有限公司副总经理。2018年8月加入国金基金管理有限公司，历任总经理助理兼固定收益投资总监，现任公司副总经理兼固定收益投资总监。
尹海峰	本基金基金经理，国金惠丰39个月定	2021年11月19日	-	11	尹海峰先生，中央财经大学硕士。2011年7月至2016年6月历任中债资信评估有限责任公司信用评级部任研究员，泰康资产

	开、国金惠享一年定开、国金惠利纯债基金经理				管理有限责任公司信用评估部担任信用评估研究总监、信用评估研究高级经理。2016年6月6日加入国金基金管理有限公司，历任固定收益部信用研究主管、研究部总经理、研究部固收研究总监；现任固定收益投资部基金经理。
--	-----------------------	--	--	--	--

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（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：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《国金惠诚债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

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，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向

交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 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

固收方面，二季度债市总体看呈现窄幅震荡走势。国内疫情对经济造成较大的冲击，10 年期国债活跃券收益率在 3 月底至 4 月初一路下行至 2.74% 附近。4 月中旬美联储加速紧缩的预期升温，美债收益率飙升，中美利差倒挂，外资流出导致 10 年期国债收益率大幅攀升再度接近 2.85% 的年内高位。尽管央行受外部因素影响在总量上难以进一步放松，但经济下行压力增大的背景下，央行继续维持宽松的货币政策，二季度流动性始终保持在合理充裕略高水平，再叠加北京疫情防控升级、上海复工复产进度不及预期，推动 5 月国债收益率再度下行至 2.74%。而随着疫情明显好转，防疫政策有所放松，6 月中旬公布的 5 月经济各项数据出现明显改善，与此同时政府前期出台的一系列稳增长政策加速落地，市场风险偏好抬升，6 月债市收益率小幅上行至 2.80% 上方。

报告期内，为适应市场的走势和组合需要，本基金根据大类资产判断采取稳健操作，严格控制风险预算，在利率债、转债和股票品种上进行平衡配置。后期会重点跟进国内宽松政策落地节奏、疫情管控力度以及海外形势的变化，在控制回撤的情况下积极增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.0171 元，累计单位净值为 1.0171 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-2.31%，同期业绩比较基准增长率为-0.51%。

截至本报告期末，本基金 C 类份额单位净值为 1.0118 元，累计单位净值为 1.0118 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-2.51%，同期业绩比较基准增长率为-0.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着国内疫情形势好转，稳增长政策持续发力，经济环比预计将出现一定程度的改善。但本轮疫情的长尾效应以及疫情常态化防控下，市场主体活力不足，居民消费意愿低迷，融资需求仍然偏弱，经济修复动能不强。稳增长、稳就业的压力依然较大，货币政策仍有必要继续宽松，流动性预计将继续维持合理充裕水平，预计债市依然难以摆脱较窄的震荡格局。

股市方面，尽管疫情修复基础并不牢固，但国内复工复产方向相对确定，中国资产的高性价比吸引力下，外部流动性冲击相对可控；持续看好关注新能源、半导体高景气赛道的修复机会，关注居民补偿性消费及政策发力刺激的方向，以及通胀驱动的板块性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证

监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情况。截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，中国民生银行股份有限公司在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、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金惠诚债券型证券投资基金

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	44,925.72	744,569.16
结算备付金		27,965.13	231,170.97
存出保证金		6,112.20	3,507.30
交易性金融资产	6.4.7.2	9,564,368.35	9,943,093.30
其中：股票投资		1,051,099.50	1,083,883.00
基金投资		-	-
债券投资		8,513,268.85	8,859,210.30
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	410,000.00	790,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		276,114.39	21,015.05
应收股利		-	-
应收申购款		199.92	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	135,975.07
资产总计		10,329,685.71	11,869,330.85
负债和净资产			
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		1,000,000.00	-
应付清算款		318,864.86	755,470.55

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,175.73	6,537.08
应付托管费		1,109.11	1,400.79
应付销售服务费		987.58	2,429.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.37	29.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	46,191.82	139,932.80
负债合计		1,372,335.47	905,800.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	8,822,112.90	10,544,067.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	135,237.34	419,462.97
净资产合计		8,957,350.24	10,963,530.02
负债和净资产总计		10,329,685.71	11,869,330.85

注：报告截止日2022年6月30日，国金惠诚A基金份额净值1.0171元，基金份额总额5,897,139.46份；国金惠诚C基金份额净值1.0118元，基金份额总额2,924,973.44份。国金惠诚份额总额合计为8,822,112.90份。

6.2 利润表

会计主体：国金惠诚债券型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年4月14日(基金 合同生效日)至2021年6 月30日
一、营业总收入		-183,793.03	418,119.47
1.利息收入		7,659.01	993,305.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,528.70	74,574.61
债券利息收入		-	797,541.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,130.31	121,189.13
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-187,451.28	-604,001.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-212,831.16	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	19,707.45	-604,001.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,672.43	-
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）	6.4.7.20	-4,000.88	28,788.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	0.12	27.89
减：二、营业总支出		96,244.91	323,991.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,886.64	169,971.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,261.41	36,422.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,929.57	38,586.07
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,282.48	35,362.77
其中：卖出回购金融资产支出		3,282.48	35,362.77
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3.65	516.93
8. 其他费用	6.4.7.23	44,881.16	43,131.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-280,037.94	94,128.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-280,037.94	94,128.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-280,037.94	94,128.22

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国金惠诚债券型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年1月1日至2022年6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)	10,544,067.05	-	419,462.97	10,963,530.02
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)	10,544,067.05	-	419,462.97	10,963,530.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,721,954.15	-	-284,225.63	-2,006,179.78
(一)、综合收益总额	-	-	-280,037.94	-280,037.94
(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)	-1,721,954.15	-	-4,187.69	-1,726,141.84
其中：1.基金申购款	24,226.41	-	413.22	24,639.63
2.基金赎回款	-1,746,180.56	-	-4,600.91	-1,750,781.47
(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)	8,822,112.90	-	135,237.34	8,957,350.24
项目	上年度可比期间 2021年4月14日(基金合同生效日)至2021年6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)	-	-	-	-
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)	234,370,461.99	-	-	234,370,461.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-198,751,758.85	-	-59,102.40	-198,810,861.25
(一)、综合收益总额	-	-	94,128.22	94,128.22
(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)	-198,751,758.85	-	-153,230.62	-198,904,989.47
其中：1.基金申购款	145,118.83	-	-104.43	145,014.40
2.基金赎回款	-198,896,877.68	-	-153,126.19	-199,050,003.87
(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)	35,618,703.14	-	-59,102.40	35,559,600.74

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：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金惠诚债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），是经中国证监会 2020 年 9 月 4 日证监许可【2020】2159 号文注册募集。由国金基金管理有限公司于 2021 年 3 月 2 日至 2021 年 4 月 9 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 4 月 14 日生效。首次募集规模为 234,370,461.99 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会准予上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国债期货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相关规定）。

本基金业绩比较基准为： $90\% \times \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} + 10\% \times \text{沪深 300 指数收益率}$

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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。对于以摊余成本计量的金融负债，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

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

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) 交易性金融资产在购买/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，按实际利率法确认利息收入，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) 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

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

6.4.4.12 分部报告

无

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

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

新金融工具准则

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：

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744,569.16元，自应收利息转入的重分类金额为人民币120.06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744,689.22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231,170.97元，自应收利息转入的重分类金额为人民币114.40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231,285.37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3,507.30元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1.76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3,509.06元。

买入返售金融资产于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790,000.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00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，买入返售金融资产于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790,000.00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125,369.10元，转出至银行存款的重分类金额为人民币120.06元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币

114.40 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1.76 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 125,132.88 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。

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 8,859,210.30 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 125,132.88 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 8,984,343.18 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 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 1,000,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 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 1,000,000.00 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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、

债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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6月30日
----	-------------------

活期存款	44,925.72
等于：本金	44,919.42
加：应计利息	6.30
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：	44,925.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,046,225.26	-	1,051,099.50	4,874.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	142,241.35	8,513,268.85	6,721.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	142,241.35	8,513,268.85	6,721.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,410,531.76	142,241.35	9,564,368.35	11,595.24

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	410,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	410,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,896.63
其中：交易所市场	16,896.63
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	29,295.19
合计	46,191.82

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金惠诚 A		
项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	6,333,364.31	6,333,364.31
本期申购	3,574.75	3,574.75
本期赎回（以“-”号填列）	-439,799.60	-439,799.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额		-
本期申购		-
本期赎回(以“-”号填列)		-
本期末	5,897,139.46	5,897,139.46

金额单位：人民币元

国金惠诚 C		
项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
本期期初	4,210,702.74	4,210,702.74
本期申购	20,651.66	20,651.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,306,380.96	-1,306,380.96
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,924,973.44	2,924,973.44

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金惠诚 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	399,586.52	-139,093.74	260,492.78
本期利润	-159,201.83	-1,220.78	-160,422.61
本期基金份额交易产生的变动数	-8,538.73	9,258.45	719.72
其中：基金申购款	121.54	-79.33	42.21
基金赎回款	-8,660.27	9,337.78	677.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231,845.96	-131,056.07	100,789.89

单位：人民币元

国金惠诚 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	251,213.35	-92,243.16	158,970.19

本期利润	-116,835.23	-2,780.10	-119,615.33
本期基金份额交易产生的变动数	-35,090.16	30,182.75	-4,907.41
其中：基金申购款	877.35	-506.34	371.01
基金赎回款	-35,967.51	30,689.09	-5,278.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,287.96	-64,840.51	34,447.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	326.33
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	1,155.92
其他	46.45
合计	1,528.70

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	9,308,150.83
减：卖出股票成本总额	9,496,340.54
减：交易费用	24,641.45
买卖股票差价收入	-212,831.16

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	90,772.97
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-71,065.52
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	19,707.45

6.4.7.15.2 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1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,351,977.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,275,531.58
减：应计利息总额	146,986.12
减：交易费用	524.95
买卖债券差价收入	-71,065.52

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,672.43
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	5,672.43

注：无

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,000.88

——股票投资	-4,212.37
——债券投资	211.49
——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	-4,000.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	0.12
合计	0.12

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
律师费	7,575.66
公证费	3,030.31
中债债券账户维护费	9,000.00
银行费用	480.00
合计	44,881.16

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金利益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国民生银行股份有限公司	基金托管人

注：下述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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 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 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年4月14日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,886.64	169,971.51
其中：支付销售机构的客户维护费	6,627.49	1,472.82

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年4月14日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,261.41	36,422.46

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金惠诚 A	国金惠诚 C	合计
国金基金管理有限公司	-	627.06	627.06
国金证券股份有限公司	-	4,578.52	4,578.52
合计	-	5,205.58	5,205.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金惠诚 A	国金惠诚 C	合计
国金基金管理有限公司	-	18,077.31	18,077.31
国金证券股份有限公司	-	18,744.14	18,744.14
合计	-	36,821.45	36,821.45

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年4月14日(基金合同生效日)至 2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	44,925.72	326.33	526,806.02	15,011.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年6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

注：无

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

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,000,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 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

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会

下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	137,957.92	528,621.00
AAA 以下	721,743.07	1,122,724.00
未评级	-	-
合计	859,700.99	1,651,345.00

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申

请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	44,925.72	-	-	-	-	-	44,925.72
结算备付金	27,965.13	-	-	-	-	-	27,965.13
存出保证金	6,112.20	-	-	-	-	-	6,112.20
交易性金融资产	4,178,102.19	512,144.93	2,541,155.48	1,027,660.00	254,206.25	1,051,099.50	9,564,368.35
买入返售金融资产	410,000.00	-	-	-	-	-	410,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	276,114.39	276,114.39
应收申购款	-	-	-	-	-	199.92	199.92
资产总计	4,667,105.24	512,144.93	2,541,155.48	1,027,660.00	254,206.25	1,327,413.81	10,329,685.71
负债							
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	318,864.86	318,864.86
应付管理人	-	-	-	-	-	5,175.73	5,175.73

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,109.11	1,109.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	987.58	987.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,896.63	16,896.63
应交税费	-	-	-	-	-	6.37	6.37
其他负债	-	-	-	-	-	29,295.19	29,295.19
负债总计	1,000,000.00	-	-	-	-	372,335.47	1,372,335.47
利率敏感度缺口	3,667,105.24	512,144.93	2,541,155.48	1,027,660.00	254,206.25	955,078.34	8,957,350.24
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	744,569.16	-	-	-	-	-	744,569.16
结算备付金	231,170.97	-	-	-	-	-	231,170.97
存出保证金	3,507.30	-	-	-	-	-	3,507.30
交易性金融资产	3,390,678.00	-	-3,408,267.30	1,355,879.00	704,386.00	1,083,883.00	9,943,093.30
买入返售金融资产	790,000.00	-	-	-	-	-	790,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,015.05	21,015.05
应收利息	-	-	-	-	-	125,369.10	125,369.10
其他资产	-	-	-	-	-	10,605.97	10,605.97
资产总计	5,159,925.43	-	-3,408,267.30	1,355,879.00	704,386.00	1,240,873.12	11,869,330.85
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	755,470.55	755,470.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,537.08	6,537.08
应付托管费	-	-	-	-	-	1,400.79	1,400.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,429.83	2,429.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,605.24	10,605.24
应交税费	-	-	-	-	-	29.78	29.78
应付利息	-	-	-	-	-	-172.44	-172.44
其他负债	-	-	-	-	-	129,500.00	129,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	905,800.83	905,800.83
利率敏感度缺口	5,159,925.43	-	-3,408,267.30	1,355,879.00	704,386.00	335,072.29	10,963,530.02

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-13,575.79	-26,122.07
	-25 个基点	13,724.72	26,436.44

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇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外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,051,099.50	11.73	1,083,883.00	9.89
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	8,513,268.85	95.04	8,859,210.30	80.81
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	9,564,368.35	106.77	9,943,093.30	90.70

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+5%	33,660.73	25,062.10
	-5%	-33,660.73	-25,062.10

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,910,800.49	2,724,228.00
第二层次	7,653,567.86	7,218,865.30
第三层次	-	-
合计	9,564,368.35	9,943,093.30

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

本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	1,051,099.50	10.18
	其中：股票	1,051,099.50	10.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,513,268.85	82.42
	其中：债券	8,513,268.85	82.42
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	410,000.00	3.97
	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	72,890.85	0.71
8	其他各项资产	282,426.51	2.73
9	合计	10,329,685.71	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	101,834.00	1.14
C	制造业	689,326.50	7.70
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	25,298.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	76,012.00	0.85
H	住宿和餐饮业	25,160.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,440.00	0.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	41,934.00	0.47

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	26,095.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	1,051,099.50	11.73

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	占基金资产净值比例（%）
1	688363	华熙生物	400	56,872.00	0.63
2	300957	贝泰妮	200	43,506.00	0.49
3	300973	立高食品	400	41,580.00	0.46
4	600845	宝信软件	700	38,220.00	0.43
5	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.42
6	300171	东富龙	1,000	33,910.00	0.38
7	300034	钢研高纳	700	29,526.00	0.33
8	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.32
9	000089	深圳机场	3,700	28,564.00	0.32
10	300296	利亚德	3,800	27,740.00	0.31
11	002371	北方华创	100	27,712.00	0.31
12	002572	索菲亚	1,000	27,500.00	0.31
13	002410	广联达	500	27,220.00	0.30
14	000983	山西焦煤	2,000	26,780.00	0.30
15	300144	宋城演艺	1,700	26,095.00	0.29
16	600460	士兰微	500	26,000.00	0.29
17	688396	华润微	440	25,990.80	0.29
18	601898	中煤能源	2,500	25,950.00	0.29
19	601225	陕西煤业	1,200	25,416.00	0.28
20	600546	山煤国际	1,300	25,298.00	0.28
21	300088	长信科技	3,400	25,228.00	0.28
22	002384	东山精密	1,100	25,223.00	0.28
23	600754	锦江酒店	400	25,160.00	0.28

24	601872	招商轮船	4,300	24,768.00	0.28
25	600584	长电科技	900	24,300.00	0.27
26	600188	兖矿能源	600	23,688.00	0.26
27	002475	立讯精密	700	23,653.00	0.26
28	688012	中微公司	200	23,350.00	0.26
29	688126	沪硅产业	1,000	22,980.00	0.26
30	300347	泰格医药	200	22,890.00	0.26
31	600009	上海机场	400	22,680.00	0.25
32	688636	智明达	200	22,678.00	0.25
33	300604	长川科技	500	22,575.00	0.25
34	300373	扬杰科技	300	21,375.00	0.24
35	300223	北京君正	200	21,250.00	0.24
36	300759	康龙化成	200	19,044.00	0.21
37	603833	欧派家居	100	15,068.00	0.17
38	600487	亨通光电	900	13,086.00	0.15
39	603816	顾家家居	190	10,759.70	0.12
40	688033	天宜上佳	500	10,620.00	0.12

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	600383	金地集团	195,395.00	1.78
2	601318	中国平安	170,288.00	1.55
3	601898	中煤能源	163,000.00	1.49
4	002003	伟星股份	159,662.00	1.46
5	002371	北方华创	156,500.00	1.43
6	000887	中鼎股份	147,832.00	1.35
7	300207	欣旺达	145,562.00	1.33
8	300750	宁德时代	144,255.00	1.32
9	600019	宝钢股份	143,497.00	1.31
10	600196	复星医药	137,301.00	1.25
11	601888	中国中免	123,119.00	1.12
12	601088	中国神华	119,314.00	1.09
13	000786	北新建材	118,004.00	1.08
14	002129	TCL 中环	115,488.00	1.05

15	688363	华熙生物	112,522.00	1.03
16	600547	山东黄金	108,586.00	0.99
17	600845	宝信软件	103,543.00	0.94
18	000333	美的集团	103,354.00	0.94
19	600009	上海机场	102,554.00	0.94
20	600048	保利发展	100,051.00	0.91

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600383	金地集团	190,091.00	1.73
2	601318	中国平安	166,098.00	1.52
3	002701	奥瑞金	165,438.00	1.51
4	002003	伟星股份	164,340.00	1.50
5	000887	中鼎股份	147,116.00	1.34
6	300207	欣旺达	140,927.00	1.29
7	300750	宁德时代	138,288.00	1.26
8	600019	宝钢股份	137,413.00	1.25
9	601898	中煤能源	132,642.00	1.21
10	600196	复星医药	129,892.00	1.18
11	603678	火炬电子	128,292.00	1.17
12	002311	海大集团	127,763.00	1.17
13	603517	绝味食品	126,988.00	1.16
14	002371	北方华创	125,855.00	1.15
15	601088	中国神华	123,295.00	1.12
16	601888	中国中免	121,331.00	1.11
17	002129	TCL 中环	119,441.00	1.09
18	002557	洽洽食品	116,892.00	1.07
19	603920	世运电路	114,708.00	1.05
20	000786	北新建材	114,191.00	1.04

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	9,467,769.41
卖出股票收入（成交）总额	9,308,150.83

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,231,402.60	80.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	422,165.26	4.71
	其中：政策性金融债	422,165.26	4.71
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）	859,700.99	9.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,513,268.85	95.04

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	019658	21 国债 10	41,000	4,178,102.19	46.64
2	019664	21 国债 16	25,000	2,541,155.48	28.37
3	019641	20 国债 11	5,000	512,144.93	5.72
4	018008	国开 1802	4,000	422,165.26	4.71
5	128134	鸿路转债	300	38,778.12	0.43

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：无

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：无

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：无

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

上半年无国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 440 万元的行政处罚。贝泰妮生物科技集团股份有限公司于 2021 年 8 月 31 日受到深交所责令改正的行政处罚。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	6,112.20
2	应收清算款	276,114.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	282,426.51

7.11.4 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	128134	鸿路转债	38,778.12	0.43
2	127029	中钢转债	38,751.35	0.43

3	110064	建工转债	37,158.90	0.41
4	123129	锦鸡转债	35,114.86	0.39
5	128044	岭南转债	34,786.60	0.39
6	127032	苏行转债	34,080.04	0.38
7	113052	兴业转债	33,501.46	0.37
8	111001	山玻转债	31,751.13	0.35
9	127031	洋丰转债	31,524.35	0.35
10	123121	帝尔转债	29,539.86	0.33
11	123067	斯莱转债	29,085.48	0.32
12	128046	利尔转债	27,975.74	0.31
13	111000	起帆转债	27,297.99	0.30
14	128109	楚江转债	26,639.84	0.30
15	110074	精达转债	26,433.83	0.30
16	113545	金能转债	26,293.97	0.29
17	127043	川恒转债	26,091.48	0.29
18	113615	金诚转债	25,775.98	0.29
19	123078	飞凯转债	25,568.11	0.29
20	113048	晶科转债	25,559.12	0.29
21	127030	盛虹转债	23,636.78	0.26
22	123089	九洲转 2	21,600.37	0.24
23	128021	兄弟转债	21,164.53	0.24
24	110061	川投转债	21,076.27	0.24
25	113634	珀莱转债	20,969.22	0.23
26	113039	嘉泽转债	20,950.62	0.23
27	113047	旗滨转债	20,806.92	0.23
28	118001	金博转债	20,628.88	0.23
29	123112	万讯转债	20,549.83	0.23

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国金惠诚 A	69	85,465.79	4,816,920.41	81.68%	1,080,219.05	18.32%
国金惠诚 C	137	21,350.17	-	-	2,924,973.44	100.00%
合计	206	42,825.79	4,816,920.41	54.60%	4,005,192.49	45.40%

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	国金惠诚 A	47,983.57	0.8137%
	国金惠诚 C	200.72	0.0069%
	合计	48,184.29	0.5462%

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的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金惠诚 A	国金惠诚 C
基金合同生效日（2021 年 4 月 14 日）基金份额总额	141,685,409.80	92,685,052.19
本报告期期初基金份额总额	6,333,364.31	4,210,702.74
本报告期基金总申购份额	3,574.75	20,651.66
减：本报告期基金总赎回份额	439,799.60	1,306,380.96
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,897,139.46	2,924,973.44

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2022年1月10日，在托管人中国民生银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。本次大会审议了《关于持续运作国金惠诚债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，同意本次大会议案的基金份额占参加本次会议表决的持有人及代理人所持表决权的100%，达到二分之一以上，符合《基金法》、《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人董事会于2021年12月13日审议通过了《关于批准国金基金管理有限公司原任董事、总经理尹庆军先生辞职的议案》、《关于董事长纪路先生提名邵海波先生担任国金基金管理有限公司总经理的议案》等议案，邵海波先生自2022年1月28日起担任公司总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	5,851,609.91	31.17%	4,279.24	31.17%	-
安信证券	1	5,408,995.14	28.81%	3,955.55	28.81%	-
华创证券	1	3,599,517.28	19.17%	2,632.20	19.17%	-

太平洋证券	1	2,302,271.00	12.26%	1,683.76	12.26%	-
天风证券	1	1,075,705.00	5.73%	786.63	5.73%	-
中银国际证券	1	537,821.91	2.86%	393.26	2.86%	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ①经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增东北证券一个交易单元。

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	
	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
东方证券	17,934,484.71	47.52%	13,400,000.00	13.69%	-	-
安信证券	6,977,138.67	18.54%	19,467,000.00	19.89%	-	-
华创证券	6,673,348.20	17.68%	21,810,000.00	22.28%	-	-
太平洋证券	4,382,867.68	11.65%	38,860,000.00	39.69%	-	-
天风证券	1,166,481.25	3.10%	2,820,000.00	2.88%	-	-

中银国际证 券	599,794.90	1.59%	1,540,000.00	1.57%	-	-
东方财富证 券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	《关于国金惠诚债券型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月11日
2	《国金惠诚债券型证券投资基金2021年第4季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月21日
3	《国金基金管理有限公司关于开展直销柜台申购费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月29日
4	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月29日
5	《国金惠诚债券型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月23日
6	《国金惠诚债券型证券投资基金2021年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月30日
7	《国金惠诚债券型证券投资基金2022年第1季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年4月22日
8	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年4月23日
9	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年4月30日
10	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年5月28日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 1 月 1 日 -2022 年 6 月 30 日	4,816,920.41	-	-	4,816,920.41	54.60%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金惠诚债券型证券投资基金基金合同；
- 3、国金惠诚债券型证券投资基金托管协议；
- 4、国金惠诚债券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、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日