

# 嘉实现金添利货币市场基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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.....                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6         |
| 3.3 其他指标.....                                | 8         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9         |
| 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.....             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....        | 14        |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....      | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 14        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>14</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 14        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 14        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 7.2 利润表.....                                 | 18        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 19        |
| 7.4 报表附注.....                                | 22        |

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                                    | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                                       | 50        |
| 8.2 债券回购融资情况.....   | 51        |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                                     | 51        |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....                     | 52        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                                | 52        |
| 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....            | 52        |
| 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....                  | 53        |
| 8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明<br>细.....     | 53        |
| 8.9 投资组合报告附注.....   | 53        |
| <b>§9 基金份额持有人信息</b> .....                                 | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                                | 54        |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                               | 54        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                             | 54        |
| 9.4 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 .....                    | 55        |
| 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产<br>品情<br>况..... | 55        |
| <b>§10 开放式基金份额变动</b> .....                                | <b>55</b> |
| <b>§11 重大事件揭示</b> .....                                   | <b>55</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                                     | 55        |
| 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 .....                    | 55        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                         | 55        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                                       | 56        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                                | 56        |
| 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 .....                       | 56        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                               | 57        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....                                | 66        |
| 11.9 其他重大事件.....  | 66        |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                                   | <b>67</b> |
| 12.1 备查文件目录.....  | 67        |
| 12.2 存放地点.....  | 67        |
| 12.3 查阅方式.....  | 67        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 嘉实现金添利货币市场基金         |
| 基金简称       | 嘉实现金添利货币             |
| 基金主代码      | 004501               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2017 年 3 月 29 日      |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 116,656,153,166.43 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。  |
| 投资策略   | 在严谨深入的研究分析基础上，本基金综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质，以及各类资产的风险、收益率水平、流动性特征等，确定各类资产的配置比例。<br>具体投资策略包括：资产配置策略、组合久期投资策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略。 |
| 业绩比较基准 | 人民币活期存款税后利率  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。  |

### 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          | 嘉实基金管理有限公司                                | 中国银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名  | 胡勇钦               |
|             | 联系电话                                      | (010)65215588     |
|             | 电子邮箱                                      | service@jsfund.cn |
| 客户服务电话      | 400-600-8800                              | 95566             |
| 传真          | (010)65215588                             | (010)66594942     |
| 注册地址        | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元        | 北京西城区复兴门内大街 1 号   |
| 办公地址        | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号<br>北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 号   |
| 邮政编码        | 100005                                    | 100818            |
| 法定代表人       | 经雷  | 刘连舸               |

### 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》              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn |

|            |   |
|------------|---|
| 基金年度报告备置地点 | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司 |
|------------|---|

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                                      |
|--------|--------------------------|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场<br>二座普华永道中心 11 楼  |
| 注册登记机构 | 嘉实基金管理有限公司               | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱<br>乐部 C 座写字楼 12A 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<br>数据和指标 | 2022 年             | 2021 年             | 2020 年             |
|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 本期已实现<br>收益       | 2,035,550,695.83   | 2,996,560,744.43   | 2,388,069,788.40   |
| 本期利润              | 2,035,550,695.83   | 2,996,560,744.43   | 2,388,069,788.40   |
| 本期净值收<br>益率       | 1.7232%            | 2.2338%            | 2.2170%            |
| 3.1.2 期末<br>数据和指标 | 2022 年末            | 2021 年末            | 2020 年末            |
| 期末基金资<br>产净值      | 116,656,153,166.43 | 123,526,327,527.69 | 123,549,672,010.25 |
| 期末基金份<br>额净值      | 1.0000             | 1.0000             | 1.0000             |
| 3.1.3 累计<br>期末指标  | 2022 年末            | 2021 年末            | 2020 年末            |
| 累计净值收<br>益率       | 17.0635%           | 15.0805%           | 12.5660%           |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

（3）本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

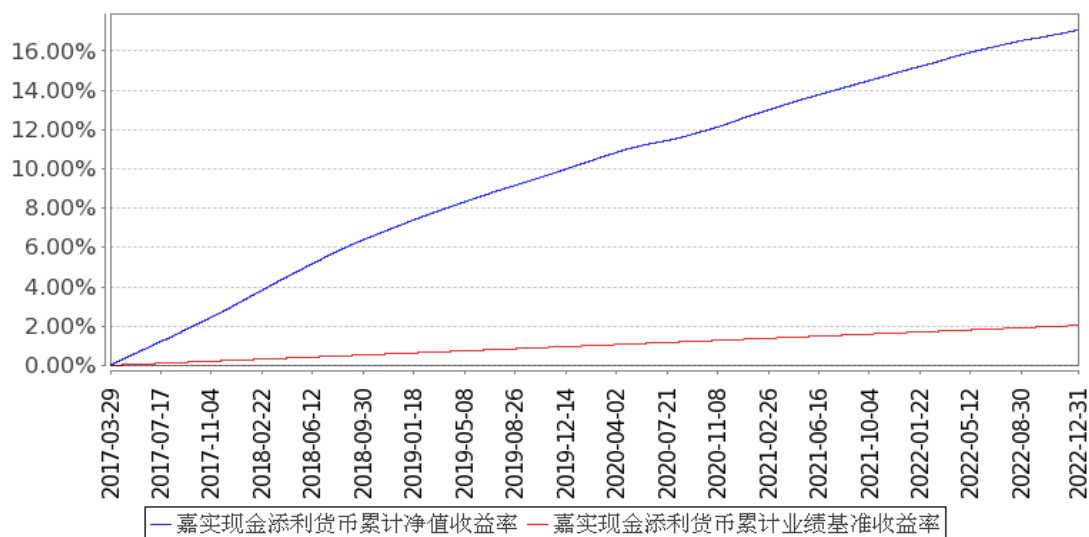
| 阶段 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|-----|-----|

|            | 收益率①     | 收益率标准差② | 基准收益率③  | 基准收益率标准差④ |          |         |
|------------|----------|---------|---------|-----------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.3518%  | 0.0007% | 0.0881% | 0.0000%   | 0.2637%  | 0.0007% |
| 过去六个月      | 0.7392%  | 0.0008% | 0.1763% | 0.0000%   | 0.5629%  | 0.0008% |
| 过去一年       | 1.7232%  | 0.0014% | 0.3500% | 0.0000%   | 1.3732%  | 0.0014% |
| 过去三年       | 6.3011%  | 0.0014% | 1.0546% | 0.0000%   | 5.2465%  | 0.0014% |
| 过去五年       | 13.4917% | 0.0024% | 1.7633% | 0.0000%   | 11.7284% | 0.0024% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.0635% | 0.0027% | 2.0344% | 0.0000%   | 15.0291% | 0.0027% |

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

嘉实现金添利货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

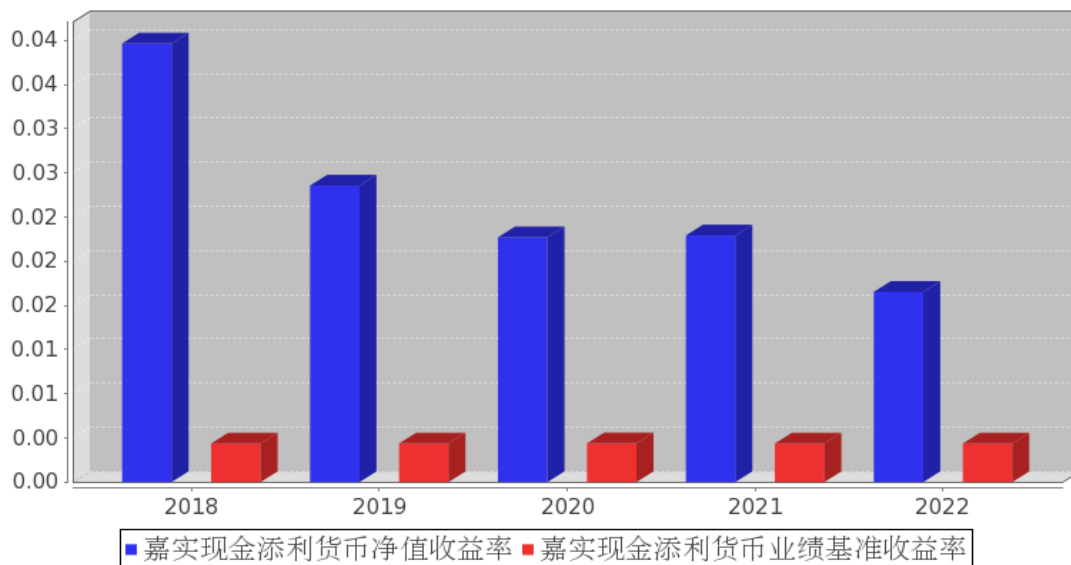
(2017年03月29日至2022年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实现金添利货币基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 已按再投资形式<br>转实收基金     | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计         | 备注 |
|--------|----------------------|-------------------|--------------|----------------------|----|
| 2022 年 | 2,035,550,695.<br>83 | -                 | -            | 2,035,550,695.<br>83 | -  |
| 2021 年 | 2,996,560,744.<br>43 | -                 | -            | 2,996,560,744.<br>43 | -  |
| 2020 年 | 2,388,069,788.<br>40 | -                 | -            | 2,388,069,788.<br>40 | -  |
| 合计     | 7,420,181,228.<br>66 | -                 | -            | 7,420,181,228.<br>66 | -  |

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批



全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2022 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 298 只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF 等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 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 |        |   |
| 李瞳 | 本基金、嘉实活钱包货币、嘉实 6 个月理财债券、嘉实 60 天滚动持有短债、嘉实短债债券、嘉实 90 天滚动持有短债、嘉实 30 天持有期中短债债券基金经理 | 2017 年 4 月 13 日 | -    | 13 年   | 曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意

见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，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；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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

### 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

回顾 2022 年，国际经济持续受到疫情反复、高通胀、地缘冲突等因素的负面影响，经济活动有所放缓。成熟经济体经济表现存在一定分化，多数经济体持续面临弱化压力，而美国下半年出现小幅反弹。美国一、二季度 GDP 环比折年率处于负增长区间、分别为-1.6%和-0.6%，三、四季度小幅反弹至 3.2%、2.9%；欧元区 GDP 环比折年率趋势下行，自一季度的 2.6%弱化至四季度的 0.5%；日本经济增速在二季度反弹之后重回收缩状态，三季度 GDP 环比折年率-0.8%。受通胀因素影响，主要经济体货币政策延续 21 年以来的收缩状态，美联储、欧央行均连续进行多次政策利率

上调。国内经济方面，22 年运行状态整体受到疫情因素扰动明显。年初经济开局表现平稳，一季度社会消费品零售总额同比增长 3.3%；固定资产投资同比增长 9.3%；贸易表现良好，出口同比增长 15.5%；季度末社会融资规模同比增长 10.5%。但从二季度开始受到疫情的持续扰动，面临经济景气压力。PMI 自二季度开始多数月份处于荣枯线以下，仅在 6 月、9 月、12 月勉强触及荣枯线。消费表现低迷，上半年社会消费品零售总额同比下降 0.7%。而固定资产投资项目表现出一定韧性，上半年固定资产投资同比增长 6.1%。经济主要亮点来自贸易，上半年出口同比增长 13.9%。下半年宏观形势较为复杂，经济需求端有所弱化。贸易需求见顶回落，出口同比增速自 10 月开始进入负增长区间。消费表现小幅反弹之后重新走弱，社会消费品零售总额自 10 月开始进入负增长区间。固定资产投资整体小幅下滑，固定资产投资全年同比增速 5.1%，其中受政策支持的基建项维持较快增速。地产政策有所调整，但受到疫情反复、居民预期等因素影响地产销售表现并未明显好转，全年销售面积同比减少 24.3%。全年来看价格压力有限，居民消费价格表现温和，生产价格呈现回落态势。社会融资规模总量表现依然较弱，同比增速下行至年底的 9.6%。在政策支持下社会融资结构有所改善，企业中长期贷款持续实现规模同比多增。

债券市场方面，收益率整体呈现先下后上的状态。一季度资金价格和债券收益率有所调整，1 月央行下调政策利率之后公开市场操作转为谨慎，而后资金价格并未明显下行、打破市场宽松预期。偏强的社融数据引发市场宽信用担忧，债券收益率明显上行。一季度 DR007 均值 2.10%，较 21 年四季度低 0.06%，期间价格波动较大。1 年 AAA 存单收益率自 1 月最低 2.41%的水平上行至 3 月中旬最高 2.62%，10 年国债收益率自 1 月最低 2.67%的水平上行至 3 月中旬最高 2.85%。二季度疫情对于经济扰动明显，一方面央行在 4 月全面降准、提前上缴利润，财政方面积极开展留抵退税向市场注入了充裕的流动性，另一方面政府债大规模发行、维持财政开支强度并积极部署稳经济措施。债券市场长短端表现分化，短端收益率跟随资金面价格明显下行，而长端利率则处于区间波动并在 6 月震荡走高。二季度 DR007 均值 1.72%，较一季度价格明显下行。1 年 AAA 存单收益率下行至最低 2.25%，10 年国债收益率在 5 月底最低至 2.70%后逐步走高。债券市场在三季度出现缓慢的方向变化，经济弱现实叠加地产断贷事件推动收益率一度快速下行。而后为应对经济下行、政策积极发力，提升专项债使用效率、陆续推出政策性开发性金融工具。8 月央行下调政策利率之后市场宽信用预期渐强，资金价格和长短端收益率震荡走高。三季度 DR007 均值 1.52%，较二季度进一步下行。1 年 AAA 存单收益率、10 年国债收益率低点出现在 8 月中旬分别在 1.89%、2.58%，而后转为向上趋势。四季度债券市场在资金面收敛、防疫政策优化调整、理财净值化等多重因素影响下出现明显波动，11 月央行全面降准之后陆续有所缓和。四季度 DR007 均值 1.74%，

较三季度明显反弹。1 年 AAA 存单收益率、10 年国债收益率分别最高上行至 2.75%和 2.91%。

报告期间，我们充分分析国内外经济形势变化，紧跟政策风向，合理应对市场波动，在保证流动性安全的同时，把握时点性收益率相对高点，积极调整组合，保持了基金的流动性安全和收益平稳增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为 1.7232%，业绩比较基准收益率为 0.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际经济方面，仍将面临疫情、通胀压力、地缘冲突等不确定性因素。国际货币基金组织在 1 月最新报告中预测 23 年全球经济增速将会从 22 年的 3.4%下行至 2.9%。22 年多数经济体采取紧缩货币政策应对通胀压力，但由此带来经济活动放缓的不利影响。22 年 12 月美国 CPI 同比上升 6.5%、环比下降 0.1%，通胀压力出现缓和迹象。就业数据表现良好但景气数据出现下滑，22 年 12 月 ISM 制造业 PMI 下行至 48.4，为 20 年下半年以来首次处于荣枯线以下。23 年 2 月美国联邦公开市场委员会声明加息 25bps，但措辞较为温和或暗示未来的加息节奏会有所放缓。欧元区当前经济状态与美国存在一定差异，近期经济数据强于预期而通胀数据仍然不容乐观。欧洲 PMI 数据自 22 年四季度以来有所好转，最新公布的 22 年 12 月核心通胀处于 5.2%的高位。预计欧央行仍将维持紧缩态度，关注后续的加息节奏和力度。未来一方面需要关注主要经济体经济放缓带来的外需弱化风险，另一方面需要警惕其紧缩货币政策对新兴经济体造成的外溢负面影响。

国内经济方面，22 年 12 月中央经济工作会议分析了未来经济形势、阐明了政策发展思路：会议提及我国经济面临地缘政治、贸易走弱、通胀压力等因素带来的挑战，国内方面需求收缩、供给冲击、预期转弱的整体压力依然较大。会议表达了对我国经济实现稳定增长的乐观预期，预计 23 年二季度社会生产秩序会加快修复。会议提出了相应的政策要求，对于财政政策要求加力提效，对于货币政策要求精准有力。展望未来，在经济恢复基础尚不牢固状态下预计流动性仍将保持合理充裕，并继续加强结构性货币政策工具的使用。预计财政政策将会保持力度，关注相关的政府债发行和财政开支规模。当前谋求经济企稳的政策态度较为明显，在积极政策效用不断累积的情形下，如果经济景气出现回升、信贷需求增强则资金面也会随之出现收敛、债券市场收益率将会面临一定上行压力。后续持续观察政策效果，尤其是地产行业运行的边际变化。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性和流动性为

首要任务，兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，灵活调整久期，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金每日收益计算并分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

无。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实现金添利货币市场基金（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、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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     | 普华永道中天审字(2023)第 25396 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 | 嘉实现金添利货币市场基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见    | (一) 我们审计的内容           |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>我们审计了嘉实现金添利货币市场基金(以下简称“嘉实现金添利货币基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实现金添利货币基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>         |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实现金添利货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | 无  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>嘉实现金添利货币基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实现金添利货币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,除非基金管理人管理层计划清算嘉实现金添利货币基金、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嘉实现金添利货币基金的财务报告过程。</p>                     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 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</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>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。</p> <p>(二) 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。</p> <p>(三) 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。</p> <p>(四) 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，就可能对嘉实现金添利货币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嘉实现金添利货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 注册会计师的姓名  | 张勇   周祎   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼  |
| 审计报告日期    | 2023 年 03 月 27 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 61,316,344,540.78       | 57,217,871,402.86        |
| 结算备付金      |         | 161,254,349.98          | 293,788,381.82           |
| 存出保证金      |         | 229,326.08              | 7,348.91                 |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 56,848,353,977.44       | 73,124,831,499.57        |
| 其中：股票投资    |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 56,805,420,744.34       | 71,011,931,499.57        |



|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资      |            | 42,933,233.10              | 2,112,900,000.00            |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | 6,255,826,064.99           | 9,174,000,907.00            |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 11,018.95                  | 9,000.00                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                          | 834,902,194.53              |
| 资产总计          |            | 124,582,019,278.22         | 140,645,410,734.69          |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2021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     |            | 7,868,538,025.81           | 13,350,040,319.93           |
| 应付清算款         |            | -                          | 3,697,792,333.30            |
| 应付赎回款         |            | 19,808.97                  | 10,949.15                   |
| 应付管理人报酬       |            | 29,434,085.02              | 32,987,282.19               |
| 应付托管费         |            | 4,905,680.84               | 5,497,880.36                |
| 应付销售服务费       |            | 21,584,995.67              | 24,190,673.59               |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 602,057.94                 | 831,348.42                  |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 781,457.54                 | 7,732,420.06                |
| 负债合计          |            | 7,925,866,111.79           | 17,119,083,207.00           |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 116,656,153,166.43         | 123,526,327,527.69          |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                          | -                           |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | -                          | -                           |
| 净资产合计         |            | 116,656,153,166.43         | 123,526,327,527.69          |
| 负债和净资产总计      |            | 124,582,019,278.22         | 140,645,410,734.69          |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 116,656,153,166.43 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 2,933,273,854.81                          | 4,068,051,434.47                               |
| 1. 利息收入                |          | 1,582,431,254.22                          | 4,057,958,415.04                               |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13 | 1,394,501,243.60                          | 2,073,378,093.10                               |
| 债券利息收入                 |          | -   | 1,585,770,894.46                               |
| 资产支持证券利息收入             |          | -   | 106,463,789.40                                 |
| 买入返售金融资产收入             |          | 187,930,010.62                            | 292,345,638.08                                 |
| 证券出借利息收入               |          | -   | -  |
| 其他利息收入                 |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 1,350,842,600.59                          | 10,093,019.43                                  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14 | -   | -  |
| 基金投资收益                 |          | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15 | 1,325,031,754.40                          | 12,199,701.77                                  |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.16 | 25,810,846.19                             | -2,106,682.34                                  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18 | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.19 | -   | -  |
| 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） | 7.4.7.20 | -   | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.21 | -   | -  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 897,723,158.98                            | 1,071,490,690.04                               |
| 1. 管理人报酬               |          | 356,810,218.24                            | 407,730,975.64                                 |
| 2. 托管费                 |          | 59,468,369.70                             | 67,955,162.67                                  |
| 3. 销售服务费               |          | 261,660,826.68                            | 299,002,715.55                                 |
| 4. 投资顾问费               |          | -   | -  |

|                     |          |                  |                  |
|---------------------|----------|------------------|------------------|
| 5. 利息支出             |          | 217,810,926.24   | 295,378,786.76   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 217,810,926.24   | 295,378,786.76   |
| 6. 信用减值损失           | 7.4.7.22 | -                | -                |
| 7. 税金及附加            |          | 1,525,763.82     | 953,360.67       |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.23 | 447,054.30       | 469,688.75       |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 2,035,550,695.83 | 2,996,560,744.43 |
| 减：所得税费用             |          | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 2,035,550,695.83 | 2,996,560,744.43 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -                | -                |
| 六、综合收益总额            |          | 2,035,550,695.83 | 2,996,560,744.43 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）      | 123,526,327,527.69                     | -      | -     | 123,526,327,527.69 |
| 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）      | 123,526,327,527.69                     | -      | -     | 123,526,327,527.69 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -6,870,174,361.26                      | -      | -     | -6,870,174,361.26  |

|  |                                  |        |                   |                       |
|--|----------------------------------|--------|-------------------|-----------------------|
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | 2,035,550,695.83  | 2,035,550,695.83      |
| (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)      | -6,870,174,361.26                | -      | -                 | -6,870,174,361.26     |
| 其中:1.基金申购款                               | 1,864,206,937,030.13             | -      | -                 | 1,864,206,937,030.13  |
| 2.基金赎回款                                  | -1,871,077,111,391.39            | -      | -                 | -1,871,077,111,391.39 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                | -      | -2,035,550,695.83 | -2,035,550,695.83     |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                | -      | -                 | -                     |
| 四、本期末净资产(基金净值)                           | 116,656,153,166.43               | -      | -                 | 116,656,153,166.43    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31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)                     | 123,549,672,010.25    | - | -                 | 123,549,672,010.25    |
| 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)                     | 123,549,672,010.25    | - | -                 | 123,549,672,010.25    |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -23,344,482.56        | - | -                 | -23,344,482.56        |
| (一)、综合收益总额                          | -                     | - | 2,996,560,744.43  | 2,996,560,744.43      |
| (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) | -23,344,482.56        | - | -                 | -23,344,482.56        |
| 其中:1.基金申购款                          | 2,195,818,820,369.96  | - | -                 | 2,195,818,820,369.96  |
| 2.基金赎回款                             | -2,195,842,164,852.52 | - | -                 | -2,195,842,164,852.52 |
| (三)、本期向基金份额持有                       | -                     | - | -2,996,560,744.43 | -2,996,560,744.43     |

|                             |                    |   |   |                    |
|-----------------------------|--------------------|---|---|--------------------|
| 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、本期末净资产(基金净值)              | 123,526,327,527.69 | - | - | 123,526,327,527.69 |

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：

经雷

梁凯

李袁

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

嘉实现金添利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]442号《关于核准嘉实现金添利货币市场基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》于2017年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为400,808,917.72份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益:

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

#### (2) 金融负债的分类

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

#### (1) 金融资产的分类

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

基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证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公允价值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。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子



价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直

线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额。当日申购的基金份额自登记机构确认之日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自登记机构确认之日起，不享有基金的收益分配权益。本基金每份基金份额享有同等分配权。

#### 7.4.4.11 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 57,217,871,402.86 元、293,788,381.82 元、7,348.91 元、9,174,000,907.00 元、834,902,194.53 元和 9,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 57,592,784,782.42 元、293,920,586.62 元、7,352.21 元、9,178,072,040.92 元、0.00 元和 9,000.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 73,124,831,499.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 73,580,616,972.52 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 13,350,040,319.93 元、3,697,792,333.30 元、10,949.15 元、32,987,282.19 元、5,497,880.36 元、24,190,673.59 元、662,645.26 元、6,800,695.71 元和 269,079.09 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算

款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款,金额分别为 13,356,841,015.64 元、3,697,792,333.30 元、10,949.15 元、32,987,282.19 元、5,497,880.36 元、24,190,673.59 元、662,645.26 元、0.00 元和 269,079.09 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及

金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,339,026.05            | 1,871,402.86             |
| 等于：本金          | 1,338,805.88            | 1,871,402.86             |
| 加：应计利息         | 220.17                  | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 定期存款           | 61,315,005,514.73       | 57,216,000,000.00        |
| 等于：本金          | 61,138,000,000.00       | 57,216,000,000.00        |
| 加：应计利息         | 177,005,514.73          | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | 3,803,093,222.29        | 500,000,000.00           |
| 存款期限 3 个月以上    | 57,511,912,292.44       | 56,716,000,000.00        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 合计             | 61,316,344,540.78       | 57,217,871,402.86        |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |                   |                   |                |         |
|----|-------------------------|-------------------|-------------------|----------------|---------|
|    | 按实际利率计算的账面价值            | 影子定价              | 偏离金额              | 偏离度 (%)        |         |
| 债券 | 交易所市场                   | 379,388,450.82    | 378,724,669.59    | -663,781.23    | -0.0006 |
|    | 银行间市场                   | 56,426,032,293.52 | 56,408,071,661.71 | -17,960,631.81 | -0.0154 |
|    | 合计                      | 56,805,420,744.34 | 56,786,796,331.30 | -18,624,413.04 | -0.0160 |

|        |                          |                   |                   |               |         |
|--------|--------------------------|-------------------|-------------------|---------------|---------|
| 资产支持证券 | 42,933,233.10            | 42,929,033.10     | -4,200.00         | -0.0000       |         |
| 合计     | 56,848,353,977.44        | 56,829,725,364.40 | -18,628,613.04    | -0.0160       |         |
| 项目     | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                   |                   |               |         |
|        | 按实际利率计算的账面价值             | 影子定价              | 偏离金额              | 偏离度 (%)       |         |
| 债券     | 交易所市场                    | 270,500,274.93    | 270,063,000.00    | -437,274.93   | -0.0004 |
|        | 银行间市场                    | 70,741,431,224.64 | 70,779,799,000.00 | 38,367,775.36 | 0.0311  |
|        | 合计                       | 71,011,931,499.57 | 71,049,862,000.00 | 37,930,500.43 | 0.0307  |
| 资产支持证券 | 2,112,900,000.00         | 2,120,565,370.00  | 7,665,370.00      | 0.0062        |         |
| 合计     | 73,124,831,499.57        | 73,170,427,370.00 | 45,595,870.43     | 0.0369        |         |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 6,255,826,064.99         | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | 6,255,826,064.99         | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 8,700,000,000.00         | -         |
| 银行间市场 | 474,000,907.00           | -         |
| 合计    | 9,174,000,907.00         | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。



## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息  | -                       | 834,902,194.53           |
| 其他应收款 | -                       | -                        |
| 待摊费用  | -                       | -                        |
| 合计    | -                       | 834,902,194.53           |

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | 79.09                    |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 512,457.54              | 662,645.26               |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 512,457.54              | 662,645.26               |

|      |            |              |
|------|------------|--------------|
| 应付利息 | -          | 6,800,695.71 |
| 预提费用 | 269,000.00 | 269,000.00   |
| 合计   | 781,457.54 | 7,732,420.06 |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                       |
|---------------|-----------------------------|-----------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额                  |
| 上年度末          | 123,526,327,527.69          | 123,526,327,527.69    |
| 本期申购          | 1,864,206,937,030.13        | 1,864,206,937,030.13  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,871,077,111,391.39       | -1,871,077,111,391.39 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                           | -                     |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                           | -                     |
| 本期申购          | -                           | -                     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                           | -                     |
| 本期末           | 116,656,153,166.43          | 116,656,153,166.43    |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分 | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 本期期初           | -                 | -     | -                 |
| 本期利润           | 2,035,550,695.83  | -     | 2,035,550,695.83  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -                 | -     | -                 |
| 其中：基金申购款       | -                 | -     | -                 |
| 基金赎回款          | -                 | -     | -                 |
| 本期已分配利润        | -2,035,550,695.83 | -     | -2,035,550,695.83 |
| 本期末            | -                 | -     | -                 |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                    | 2,605,051.69                     |
| 定期存款利息收入  | 1,387,897,044.67            | 2,068,660,886.10                 |
| 其他存款利息收入  | -                           | -                                |
| 结算备付金利息收入 | 3,997,711.46                | 4,458,548.50                     |
| 其他        | 1,435.78                    | 61.35                            |
| 合计        | 1,394,501,243.60            | 2,073,378,093.10                 |

## 7.4.7.14 股票投资收益

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,312,123,987.06                | -                                    |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 12,907,767.34                   | 12,199,701.77                        |
| 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                           | 1,325,031,754.40                | 12,199,701.77                        |

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 267,301,945,120.38              | 118,709,858,189.37                   |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 265,556,161,216.83              | 117,813,577,885.73                   |
| 减：应计利息总额               | 1,732,876,136.21                | 884,080,601.87                       |
| 减：交易费用                 | -                               | -                                    |
| 买卖债券差价收入               | 12,907,767.34                   | 12,199,701.77                        |

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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12月31日 | 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 26,433,857.33         | -                     |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -623,011.14           | -2,106,682.34         |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入       | -                     | -                     |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入       | -                     | -                     |
| 合计                       | 25,810,846.19         | -2,106,682.34         |

#### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 2,487,150,546.13            | 4,030,975,870.21                 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 2,440,900,000.00            | 3,987,853,000.00                 |
| 减：应计利息总额       | 46,873,557.27               | 45,229,552.55                    |
| 减：交易费用         | -                           | -                                |
| 资产支持证券投资收益     | -623,011.14                 | -2,106,682.34                    |

#### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.19 股利收益**

无。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

无。

**7.4.7.21 其他收入**

无。

**7.4.7.22 信用减值损失**

无。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用      | 140,000.00                      | 140,000.00                           |
| 信息披露费     | 120,000.00                      | 120,000.00                           |
| 证券出借违约金   | -                               | -                                    |
| 银行划款手续费   | 151,894.30                      | 171,956.55                           |
| 债券托管账户维护费 | 33,600.00                       | 34,800.00                            |
| 其他        | 1,560.00                        | 2,932.20                             |
| 合计        | 447,054.30                      | 469,688.75                           |

**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**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称                             | 与本基金的关系  |
|-----------------------------------|----------|
| 嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)                | 基金管理人    |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)                | 基金托管人    |
| DWS Investments Singapore Limited | 基金管理人的股东 |

|                    |             |
|--------------------|-------------|
| 立信投资有限责任公司         | 基金管理人的股东    |
| 中诚信托有限责任公司         | 基金管理人的股东    |
| 嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”) | 基金管理人的控股子公司 |
| 嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”) | 基金管理人的控股子公司 |

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 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

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 356,810,218.24                  | 407,730,975.64                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,488,174.78                    | 12,658,225.25                        |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 59,468,369.70                   | 67,955,162.67                        |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日      |  |
|----------------|---|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |  |
|                | 嘉实现金添利货币                                    |  |
| 嘉实基金管理有限公司     | 247,513,797.29                              |  |
| 中国银行           | 14,103,591.57                               |  |
| 嘉实财富           | 25.55                                       |  |
| 合计             | 261,617,414.41                              |  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |  |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |  |
|                | 嘉实现金添利货币                                    |  |
| 嘉实基金管理有限公司     | 279,416,668.30                              |  |
| 中国银行           | 19,552,810.07                               |  |
| 嘉实财富           | 25.55                                       |  |
| 合计             | 298,969,503.92                              |  |

注：本基金的销售服务费年费率为 0.22%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 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

单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日      |        |      |       |      |                    |              |
|---|--------|------|-------|------|--------------------|--------------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                              | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |              |
|   | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出         |
| 中国银行股份有限公司                                  | -      | -    | -     | -    | 108,802,857,500.00 | 7,514,402.13 |
| 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |        |      |       |      |                    |              |
| 银行间市场交易的各关联方名称                              | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |              |
|   | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出         |
| 中国银行股份有限公司                                  | -      | -    | -     | -    | 56,267,822,000.00  | 5,491,060.91 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------------------|--|---|
| 报告期初持有的基金份额             | 0.19                                   | 0.19  |
| 报告期内申购/买入总份额            | -                                      | -   |
| 报告期内因拆分变动份额             | -                                      | -   |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额          | -                                      | -   |
| 报告期末持有的基金份额             | 0.19                                   | 0.19  |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 0.00%                                  | 0.00%                                       |

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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

无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称         | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 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         |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 1,339,026.05                           | 2,605,051.69   | 1,871,402.86                                | 258,597.15     |
| 中国银行股份有限公司_定期 | 4,817,405,166.25                       | 236,718,083.48 | 11,500,000,000.00                           | 312,392,499.42 |

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计         | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 2,035,550,695.83 | -                 | -            | 2,035,550,695.83 | -  |



## 7.4.12 期末（2022 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

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 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

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,868,538,025.81 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 112203009 | 22 农业银行 CD009 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.66  | 500,000   | 49,827,749.90  |
| 112203010 | 22 农业银行 CD010 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.63  | 600,000   | 59,776,661.29  |
| 112203016 | 22 农业银行 CD016 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.57  | 1,000,000 | 99,574,102.28  |
| 112205102 | 22 建设银行 CD102 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.50  | 1,000,000 | 99,497,432.49  |
| 112206075 | 22 交通银行 CD075 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.61  | 1,000,000 | 99,614,304.22  |
| 112210358 | 22 兴业银行 CD358 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.69  | 5,479,000 | 546,212,930.49 |
| 112211001 | 22 平安银行 CD001 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.98  | 2,000,000 | 199,956,931.77 |
| 112211006 | 22 平安银行 CD006 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.94  | 1,100,000 | 109,932,439.49 |
| 112211012 | 22 平安银行 CD012 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.90  | 1,855,000 | 185,320,392.91 |
| 112211069 | 22 平安银行 CD069 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.57  | 894,000   | 89,018,265.54  |
| 112215159 | 22 民生银行 CD159 | 2023 年 1 月 3 日 | 100.36 | 5,000,000 | 501,819,166.67 |
| 112215217 | 22 民生银行 CD217 | 2023 年 1 月 3 日 | 100.23 | 3,277,000 | 328,443,879.00 |
| 112215561 | 22 民生银行 CD561 | 2023 年 1 月 3 日 | 98.76  | 891,000   | 87,997,056.92  |
| 160006    | 16 付息国债 06    | 2023 年 1 月 3 日 | 102.30 | 1,000,000 | 102,298,377.91 |
| 160207    | 16 国开 07      | 2023 年 1 月 3 日 | 102.97 | 1,600,000 | 164,751,444.57 |

|           |                |                |        |           |                |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
|           |                | 日              |        |           |                |
| 160404    | 16 农发 04       | 2023 年 1 月 3 日 | 103.30 | 2,900,000 | 299,560,031.70 |
| 180204    | 18 国开 04       | 2023 年 1 月 3 日 | 104.28 | 1,880,000 | 196,047,379.25 |
| 180303    | 18 进出 03       | 2023 年 1 月 3 日 | 104.84 | 200,000   | 20,967,374.63  |
| 200303    | 20 进出 03       | 2023 年 1 月 3 日 | 101.57 | 670,000   | 68,053,204.41  |
| 210302    | 21 进出 02       | 2023 年 1 月 3 日 | 102.70 | 500,000   | 51,352,177.16  |
| 210312    | 21 进出 12       | 2023 年 1 月 3 日 | 102.71 | 3,460,000 | 355,390,080.52 |
| 220201    | 22 国开 01       | 2023 年 1 月 3 日 | 102.03 | 5,264,000 | 537,106,855.79 |
| 220301    | 22 进出 01       | 2023 年 1 月 3 日 | 101.60 | 2,300,000 | 233,675,821.32 |
| 220304    | 22 进出 04       | 2023 年 1 月 3 日 | 101.33 | 200,000   | 20,265,243.08  |
| 220401    | 22 农发 01       | 2023 年 1 月 3 日 | 101.52 | 3,900,000 | 395,929,704.98 |
| 2204102   | 22 农发贴现 02     | 2023 年 1 月 3 日 | 99.55  | 1,838,000 | 182,973,584.90 |
| 2204105   | 22 农发贴现 05     | 2023 年 1 月 3 日 | 99.34  | 600,000   | 59,601,786.41  |
| 229937    | 22 贴现国债 37     | 2023 年 1 月 3 日 | 99.87  | 849,000   | 84,792,309.46  |
| 229945    | 22 贴现国债 45     | 2023 年 1 月 3 日 | 99.66  | 59,000    | 5,879,742.28   |
| 012281757 | 22 豫交投 SCP001  | 2023 年 1 月 4 日 | 101.17 | 460,000   | 46,537,715.49  |
| 012281877 | 22 京能洁能 SCP003 | 2023 年 1 月 4 日 | 101.03 | 1,100,000 | 111,131,556.46 |
| 012281904 | 22 首钢 SCP003   | 2023 年 1 月 4 日 | 101.01 | 1,100,000 | 111,110,354.54 |
| 012282344 | 22 首钢 SCP004   | 2023 年 1 月 4 日 | 100.81 | 2,500,000 | 252,026,025.09 |
| 012282945 | 22 中电投 SCP024  | 2023 年 1 月 4 日 | 100.43 | 900,000   | 90,384,768.06  |
| 012283209 | 22 中电投 SCP025  | 2023 年 1 月 4 日 | 100.37 | 160,000   | 16,059,431.31  |
| 012283230 | 22 中电投 SCP026  | 2023 年 1 月 4 日 | 100.38 | 2,000,000 | 200,752,767.44 |
| 042280238 | 22 电网 CP004    | 2023 年 1 月 4 日 | 101.01 | 1,000,000 | 101,007,968.49 |

|           |                  |                   |        |            |                  |
|-----------|------------------|-------------------|--------|------------|------------------|
|           |                  | 日                 |        |            |                  |
| 072210119 | 22 中信建投<br>CP004 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 100.69 | 3,000,000  | 302,065,540.96   |
| 072210137 | 22 招商证券<br>CP006 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 100.54 | 1,357,000  | 136,432,172.19   |
| 102000048 | 20 中金集<br>MTN001 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 102.84 | 1,875,000  | 192,828,030.74   |
| 102000363 | 20 汇金<br>MTN003  | 2023 年 1 月 4<br>日 | 102.03 | 300,000    | 30,608,425.12    |
| 112212040 | 22 北京银行<br>CD040 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 100.37 | 7,529,000  | 755,660,633.34   |
| 112212076 | 22 北京银行<br>CD076 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 100.20 | 6,968,000  | 698,205,987.56   |
| 112273038 | 22 台州银行<br>CD042 | 2023 年 1 月 4<br>日 | 99.89  | 2,420,000  | 241,727,000.27   |
| 合计        |                  |                   |        | 84,485,000 | 8,522,174,808.40 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 132,238,866.20     | 510,527,269.87      |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 11,241,012,440.82  | 10,413,130,879.73   |
| 合计     | 11,373,251,307.02  | 10,923,658,149.60   |

注：评级取自第三方评级机构。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 2,853,051,683.52   | 3,731,299,649.46    |
| AAA 以下 | 61,224,068.63      | -                   |
| 未评级    | 1,504,437,277.14   | -                   |
| 合计     | 4,418,713,029.29   | 3,731,299,649.46    |

注：评级取自第三方评级机构。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

|        | 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------|------------------|
| AAA    | 42,933,233.10    | 2,112,900,000.00 |
| AAA 以下 | -                | -                |
| 未评级    | -                | -                |
| 合计     | 42,933,233.10    | 2,112,900,000.00 |

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 40,814,618,002.94       | 50,097,140,570.50        |
| AAA 以下 | 198,838,405.09          | -                        |
| 未评级    | -                       | -                        |
| 合计     | 41,013,456,408.03       | 50,097,140,570.50        |

注：评级取自第三方评级机构。

#### 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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约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相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)以及根据份额持有人集中度情况调整投资组合的方式来实现。

本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。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 10%。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还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。当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基

金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 不计息 | 合计                |
|-------------------------|-------------------|------------------|-------|-----|-------------------|
| 资产                      |                   |                  |       |     |                   |
| 银行存款                    | 57,487,030,322.99 | 3,829,314,217.79 | -     | -   | 61,316,344,540.78 |
| 结算备付金                   | 161,254,349.98    | -                | -     | -   | 161,254,349.98    |
| 存出保证金                   | 229,326.08        | -                | -     | -   | 229,326.08        |
| 交易性金融资产                 | 56,686,056,270.16 | 162,297,707.28   | -     | -   | 56,848,353,977.44 |
| 衍生金融资产                  | -                 | -                | -     | -   | -                 |
| 买入返售金融资产                | 6,255,826,064.99  | -                | -     | -   | 6,255,826,064.99  |

|                          |                    |                  |       |                |                    |
|--------------------------|--------------------|------------------|-------|----------------|--------------------|
| 应收清算款                    | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 债权投资                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应收股利                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应收申购款                    | -                  | -                | -     | 11,018.95      | 11,018.95          |
| 递延所得税资产                  | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 其他资产                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 资产总计                     | 120,590,396,334.20 | 3,991,611,925.07 | -     | 11,018.95      | 124,582,019,278.22 |
| 负债                       | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 短期借款                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 交易性金融负债                  | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 衍生金融负债                   | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 卖出回购金融资产款                | 7,868,538,025.81   | -                | -     | -              | 7,868,538,025.81   |
| 应付清算款                    | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应付赎回款                    | -                  | -                | -     | 19,808.97      | 19,808.97          |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -                | -     | 29,434,085.02  | 29,434,085.02      |
| 应付托管费                    | -                  | -                | -     | 4,905,680.84   | 4,905,680.84       |
| 应付销售服务费                  | -                  | -                | -     | 21,584,995.67  | 21,584,995.67      |
| 应付投资顾问费                  | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应交税费                     | -                  | -                | -     | 602,057.94     | 602,057.94         |
| 应付利润                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 递延所得税负债                  | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 其他负债                     | -                  | -                | -     | 781,457.54     | 781,457.54         |
| 负债总计                     | 7,868,538,025.81   | -                | -     | 57,328,085.98  | 7,925,866,111.79   |
| 利率敏感度缺口                  | 112,721,858,308.39 | 3,991,611,925.07 | -     | -57,317,067.03 | 116,656,153,166.43 |
| 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | 6 个月以内             | 6 个月<br>-1 年     | 1-5 年 | 不计息            | 合计                 |
| 资产                       |                    |                  |       |                |                    |
| 银行存款                     | 48,817,871,402.86  | 8,400,000,000.00 | -     | -              | 57,217,871,402.86  |
| 结算备付金                    | 293,788,381.82     | -                | -     | -              | 293,788,381.82     |
| 存出保证金                    | 7,348.91           | -                | -     | -              | 7,348.91           |
| 交易性金融资产                  | 72,355,461,255.10  | 769,370,244.47   | -     | -              | 73,124,831,499.57  |
| 衍生金融资产                   | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 买入返售金融资产                 | 9,174,000,907.00   | -                | -     | -              | 9,174,000,907.00   |
| 应收清算款                    | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 债权投资                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应收股利                     | -                  | -                | -     | -              | -                  |
| 应收申购款                    | -                  | -                | -     | 9,000.00       | 9,000.00           |

|           |                    |                  |   |                   |                    |
|-----------|--------------------|------------------|---|-------------------|--------------------|
| 递延所得税资产   | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 其他资产      | -                  | -                | - | -834,902,194.53   | 834,902,194.53     |
| 资产总计      | 130,641,129,295.69 | 9,169,370,244.47 | - | -834,911,194.53   | 140,645,410,734.69 |
| 负债        | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 短期借款      | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 交易性金融负债   | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 衍生金融负债    | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 卖出回购金融资产款 | 13,350,040,319.93  | -                | - | -                 | 13,350,040,319.93  |
| 应付清算款     | -                  | -                | - | 3,697,792,333.30  | 3,697,792,333.30   |
| 应付赎回款     | -                  | -                | - | 10,949.15         | 10,949.15          |
| 应付管理人报酬   | -                  | -                | - | 32,987,282.19     | 32,987,282.19      |
| 应付托管费     | -                  | -                | - | 5,497,880.36      | 5,497,880.36       |
| 应付销售服务费   | -                  | -                | - | 24,190,673.59     | 24,190,673.59      |
| 应付投资顾问费   | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 应交税费      | -                  | -                | - | 831,348.42        | 831,348.42         |
| 应付利润      | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 递延所得税负债   | -                  | -                | - | -                 | -                  |
| 其他负债      | -                  | -                | - | 7,732,420.06      | 7,732,420.06       |
| 负债总计      | 13,350,040,319.93  | -                | - | 3,769,042,887.07  | 17,119,083,207.00  |
| 利率敏感度缺口   | 117,291,088,975.76 | 9,169,370,244.47 | - | -2,934,131,692.54 | 123,526,327,527.69 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。



## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 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12月31日）            | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升<br>5%     | -                           | -                 |
|    | 业绩比较基准下降<br>5%     | -                           | -                 |

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 56,848,353,977.44  | 73,124,831,499.57   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 56,848,353,977.44  | 73,124,831,499.57   |

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 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  | 固定收益投资                | 56,848,353,977.44  | 45.63         |
|    | 其中：债券                 | 56,805,420,744.34  | 45.60         |
|    | 资产支持证<br>券            | 42,933,233.10      | 0.03          |
| 2  | 买入返售金融资产              | 6,255,826,064.99   | 5.02          |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                  | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 61,477,598,890.76  | 49.35         |
| 4  | 其他各项资产                | 240,345.03         | 0.00          |
| 5  | 合计                    | 124,582,019,278.22 | 100.00        |

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%)   |                |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 9.86             |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |                |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 7,868,538,025.81 | 6.75           |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                | -              |

注：报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 82 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 57 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 21.12               | 6.74                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 23.87               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 21.08               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 14.49               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 25.89               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |

|    |        |      |
|----|--------|------|
| 合计 | 106.45 | 6.74 |
|----|--------|------|

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

#### 8.5 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                 | 按实际利率计算的账面价值      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | 2,363,938,032.45  | 2.03          |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -             |
| 3  | 金融债券                 | 5,047,223,421.39  | 4.33          |
|    | 其中：政策性金融债            | 3,598,593,217.76  | 3.08          |
| 4  | 企业债券                 | 287,314,924.05    | 0.25          |
| 5  | 企业短期融资券              | 6,864,402,517.34  | 5.88          |
| 6  | 中期票据                 | 1,229,085,441.08  | 1.05          |
| 7  | 同业存单                 | 41,013,456,408.03 | 35.16         |
| 8  | 其他                   | -                 | -             |
| 9  | 合计                   | 56,805,420,744.34 | 48.69         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                 | -             |

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量 (张)   | 按实际利率计算的账面价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|------------|------------------|---------------|
| 1  | 112210373 | 22 兴业银行 CD373 | 29,000,000 | 2,888,589,203.14 | 2.48          |
| 2  | 112210379 | 22 兴业银行 CD379 | 25,000,000 | 2,488,311,601.54 | 2.13          |
| 3  | 112210384 | 22 兴业银行 CD384 | 12,000,000 | 1,193,137,643.70 | 1.02          |
| 4  | 112210358 | 22 兴业银行 CD358 | 11,800,000 | 1,176,366,596.06 | 1.01          |
| 5  | 112205051 | 22 建设银行 CD051 | 11,000,000 | 1,104,192,925.00 | 0.95          |
| 6  | 112210363 | 22 兴业银行 CD363 | 11,000,000 | 1,096,258,420.15 | 0.94          |

|    |           |                  |            |                  |      |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------|
| 7  | 220201    | 22 国开 01         | 10,700,000 | 1,091,763,555.66 | 0.94 |
| 8  | 112211050 | 22 平安银行<br>CD050 | 10,000,000 | 1,003,840,277.78 | 0.86 |
| 9  | 112212040 | 22 北京银行<br>CD040 | 10,000,000 | 1,003,666,666.67 | 0.86 |
| 10 | 112212076 | 22 北京银行<br>CD076 | 10,000,000 | 1,002,017,777.78 | 0.86 |

### 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0774%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0743% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0440%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

### 8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称  | 数量（份）   | 按实际利率计算的<br>账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|------------------|--------------|
| 1  | 179821 | 至诚 9A | 420,000 | 42,933,233.10    | 0.04         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支资产支持证券。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

#### 8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中国建设银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

### 8.9.3 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 | 229,326.08 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收利息  | -          |
| 4  | 应收申购款 | 11,018.95  |
| 5  | 其他应收款 | -          |
| 6  | 待摊费用  | -          |
| 7  | 其他    | -          |
| 8  | 合计    | 240,345.03 |

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额               | 占总份额比<br>例 (%) |
| 12,432,525   | 9,383.14      | 14,626,921.00 | 0.01           | 116,641,526,245.43 | 99.99          |

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额 (份)      | 占总份额比例 (%) |
|----|-------|---------------|------------|
| 1  | 个人    | 10,687,762.97 | 0.01       |
| 2  | 个人    | 8,962,707.16  | 0.01       |
| 3  | 其他机构  | 8,674,864.80  | 0.01       |
| 4  | 个人    | 6,891,448.03  | 0.01       |
| 5  | 个人    | 6,868,073.65  | 0.01       |
| 6  | 个人    | 6,832,345.64  | 0.01       |
| 7  | 个人    | 6,678,508.73  | 0.01       |
| 8  | 个人    | 6,452,101.68  | 0.01       |
| 9  | 个人    | 6,363,545.73  | 0.01       |
| 10 | 个人    | 6,089,986.22  | 0.01       |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 6,584,079.60 | 0.01         |

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | >=100             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |

**9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况**

无。

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                               |                      |
|-------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2017年3月29日）<br>基金份额总额 | 400,808,917.72       |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 123,526,327,527.69   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 1,864,206,937,030.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 1,871,077,111,391.39 |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                    |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 116,656,153,166.43   |

注：报告期期间基金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。

**§ 11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

**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****(1) 基金管理人的重大人事变动情况**

2022年5月12日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

**(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况**

本报告期内，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**

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 140,000.00 元,该审计机构已连续 6 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

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1                  | 内容               |
|-----------------------|------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人              |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2022 年 6 月 2 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 北京证监局            |
| 受到的具体措施类型             | 责令改正             |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 对子公司管控不严格        |
| 管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见) | 已完成整改并通过北京证监局验收  |
| 其他                    | -                |
| 措施 2                  | 内容               |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 高级管理人员           |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2022 年 6 月 14 日  |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 北京证监局            |
| 受到的具体措施类型             | 警示函              |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 对子公司管控不严格        |
| 管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见) | -                |
| 其他                    | -                |
| 措施 3                  | 内容               |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人              |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2022 年 12 月 26 日 |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 北京证监局            |
| 受到的具体措施类型             | 责令改正             |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 内控管理不完善          |
| 管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见) | 已完成整改并通过北京证监局验收  |
| 其他                    | -                |

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%) |    |
| 安信证券股份有限公司   | 3      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 渤海证券股份有限公司   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长城证券股份有限公司   | 3      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券股份有限公司   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 诚通证券股份有限公司   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 德邦证券股份有限公司   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 第一创业证券股份有限公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东北证券股份有限公司   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东方财富证券股份有限公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东方证券股份有限公司   | 5      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东吴证券股份有限公司   | 3      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东兴证券股份有限公司   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券股份有限公司   | 5 | - | - | - | - | - |
| 高盛高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司   | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国新证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司   | 5 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有限责任公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 华林证券股份有限     | 1 | - | - | - | - | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司         |   |   |   |   |   |   |
| 华龙证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 联储证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 万联证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | 3 | - | - | - | - | - |

|                      |    |   |   |   |   |   |
|----------------------|----|---|---|---|---|---|
| 股份有限<br>公司           |    |   |   |   |   |   |
| 兴业证券<br>股份有限<br>公司   | 3  | - | - | - | - | - |
| 野村东方<br>国际证券<br>有限公司 | 2  | - | - | - | - | - |
| 英大证券<br>有限责任<br>公司   | 1  | - | - | - | - | - |
| 粤开证券<br>股份有限<br>公司   | 2  | - | - | - | - | - |
| 招商证券<br>股份有限<br>公司   | 2  | - | - | - | - | - |
| 浙商证券<br>股份有限<br>公司   | 1  | - | - | - | - | - |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司 | 5  | - | - | - | - | - |
| 中国银河<br>证券股份<br>有限公司 | 2  | - | - | - | - | - |
| 中国中金<br>财富证券<br>有限公司 | 1  | - | - | - | - | - |
| 中航证券<br>有限公司         | 1  | - | - | - | - | - |
| 中泰证券<br>股份有限<br>公司   | 5  | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券股份<br>有限公司 | 4  | - | - | - | - | - |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司   | 10 | - | - | - | - | - |
| 中银国际<br>证券股份<br>有限公司 | 2  | - | - | - | - | - |

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券

商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 华融证券股份有限公司更名为国新证券股份有限公司。新时代证券股份有限公司更名为诚通证券股份有限公司。北京高华证券有限责任公司更名为高盛高华证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中信证券华南股份有限公司退租交易单元 2 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：华林证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华龙证券股份有限公司新增交易单元 2 个，天风证券股份有限公司新增交易单元 2 个，万联证券股份有限公司新增交易单元 1 个，东方财富证券股份有限公司新增交易单元 2 个，山西证券股份有限公司新增交易单元 2 个，粤开证券股份有限公司新增交易单元 2 个，德邦证券股份有限公司新增交易单元 2 个，第一创业证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国新证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

### 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

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 (%) |
| 安信证券股份有限公司 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 渤海证券股份有限公司 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 长城证券股份有限公司 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 长江证券股份     | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 有限公司         |   |   |   |   |   |   |
| 诚通证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 高盛高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |

|              |                |       |                  |      |   |   |
|--------------|----------------|-------|------------------|------|---|---|
| 司            |                |       |                  |      |   |   |
| 广发证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 国海证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 国金证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 643,775,654.00 | 35.80 | 2,860,384,000.00 | 0.57 | - | - |
| 国新证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 国信证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 海通证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 宏信证券有限责任公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 华宝证券股份有限公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 华创证券有限责任公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |
| 华福证券有限责任公司   | -              | -     | -                | -    | - | - |

|            |                  |       |                    |       |   |   |
|------------|------------------|-------|--------------------|-------|---|---|
| 司          |                  |       |                    |       |   |   |
| 华林证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 华龙证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1,154,594,400.00 | 64.20 | 500,397,416,000.00 | 99.43 | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 联储证券有限责任公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 山西证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | -                | -     | -                  | -     | - | - |



|                          |   |   |   |   |   |   |
|--------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 司                        |   |   |   |   |   |   |
| 万联证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 西部证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 西南证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 野村东<br>方国际<br>证券有<br>限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证<br>券有限<br>责任公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |

| 司            |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

### 11.9 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  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 5 月 12 日  |
| 2  | 嘉实基金管理有限公司住所变更公告     | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 11 月 10 日 |
| 3  | 嘉实基金管理有限公司关于提醒投资     | 中国证券报、基金管理                  | 2022 年 12 月 21 日 |

|  |                |                   |  |
|--|----------------|-------------------|--|
|  | 者持续完善客户身份信息的公告 | 人网站及中国证监会基金电子披露网站 |  |
|--|----------------|-------------------|--|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实现金添利货币市场基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实现金添利货币市场基金托管协议》；
- (4) 《嘉实现金添利货币市场基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实现金添利货币市场基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日