

# 英大智享债券型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 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 1 月 1 日起至 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.....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	20
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>66</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	66
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	69
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
8.11 投资组合报告附注.....	69
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>72</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	72
9.4 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品情况.....	73
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
11.8 其他重大事件.....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点.....	82
13.3 查阅方式.....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	英大智享债券型证券投资基金	
基金简称	英大智享债券	
场内简称	-	
基金主代码	010174	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 23 日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	130,401,874.32 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	英大智享债券 A	英大智享债券 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	010174	010175
报告期末下属分级基金的份额总额	109,483,123.01 份	20,918,751.31 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的基础上，力争获得长期稳定的投资收益。	
投资策略	1、资产配置策略；2、固定收益类资产投资策略；3、股票投资策略；4、衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
	英大智享债券 A	英大智享债券 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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		英大基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘康喜	朱广科
	联系电话	010-59112026	0574-87050338
	电子邮箱	liukx@ydmc.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		400-890-5288	0574-83895886

传真	010-59112222	0574-89103213
注册地址	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码	100020	315100
法定代表人	范育晖	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年 12 月 23 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	英大智享债券 A	英大智享债券 C	英大智享债券 A	英大智享债券 C	英大智享债券 A	英大智享债券 C
本期已实现收益	4,562,621.64	913,762.28	9,957,127.99	4,157,492.61	-221,373.26	-153,569.89
本期利润	-4,530,075.82	-1,271,604.75	11,228,332.26	4,884,247.51	-377,864.37	-255,770.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0384	-0.0491	0.0562	0.0446	-0.0024	-0.0025
本期加权平均净值利润率	-3.75%	-4.81%	5.49%	4.38%	-0.24%	-0.25%
本期基金份额净值增长率	-3.43%	-3.82%	6.74%	6.32%	-0.24%	-0.25%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	3,095,043.36	418,004.15	8,297,685.14	1,860,138.53	-377,864.37	-255,770.08
期末可供分配基金份额利润	0.0283	0.0200	0.0589	0.0546	-0.0024	-0.0025
期末基金资产净值	112,578,166.37	21,336,755.46	149,999,676.58	36,151,481.90	157,718,297.93	102,988,132.84
期末基金份额净值	1.0283	1.0200	1.0648	1.0605	0.9976	0.9975
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	2.83%	2.00%	6.48%	6.05%	-0.24%	-0.25%

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

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

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大智享债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.87%	0.38%	0.21%	0.12%	2.66%	0.26%
过去六个月	-1.08%	0.31%	-0.17%	0.11%	-0.91%	0.20%
过去一年	-3.43%	0.31%	0.53%	0.13%	-3.96%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.83%	0.29%	5.24%	0.13%	-2.41%	0.16%

英大智享债券 C

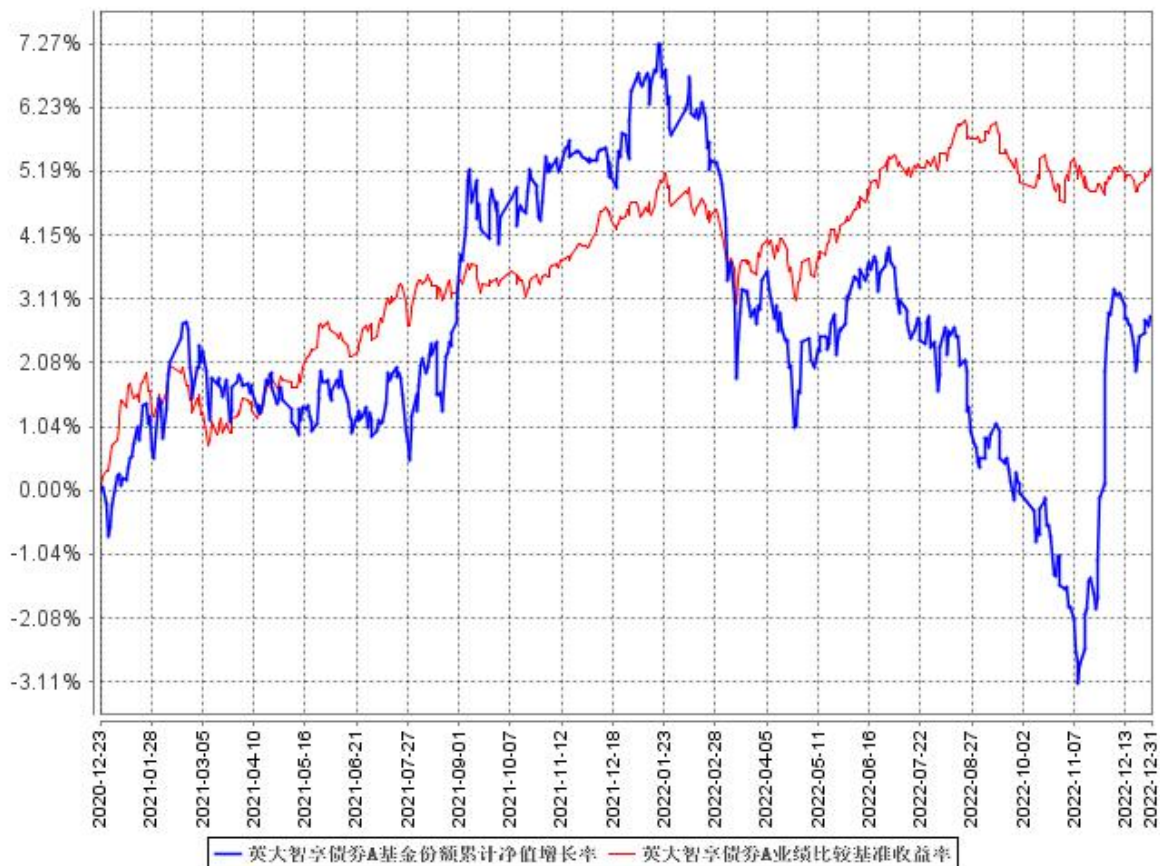
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.77%	0.38%	0.21%	0.12%	2.56%	0.26%
过去六个月	-1.28%	0.31%	-0.17%	0.11%	-1.11%	0.20%
过去一年	-3.82%	0.31%	0.53%	0.13%	-4.35%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.00%	0.29%	5.24%	0.13%	-3.24%	0.16%

注：本基金的业绩比较基准是：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%

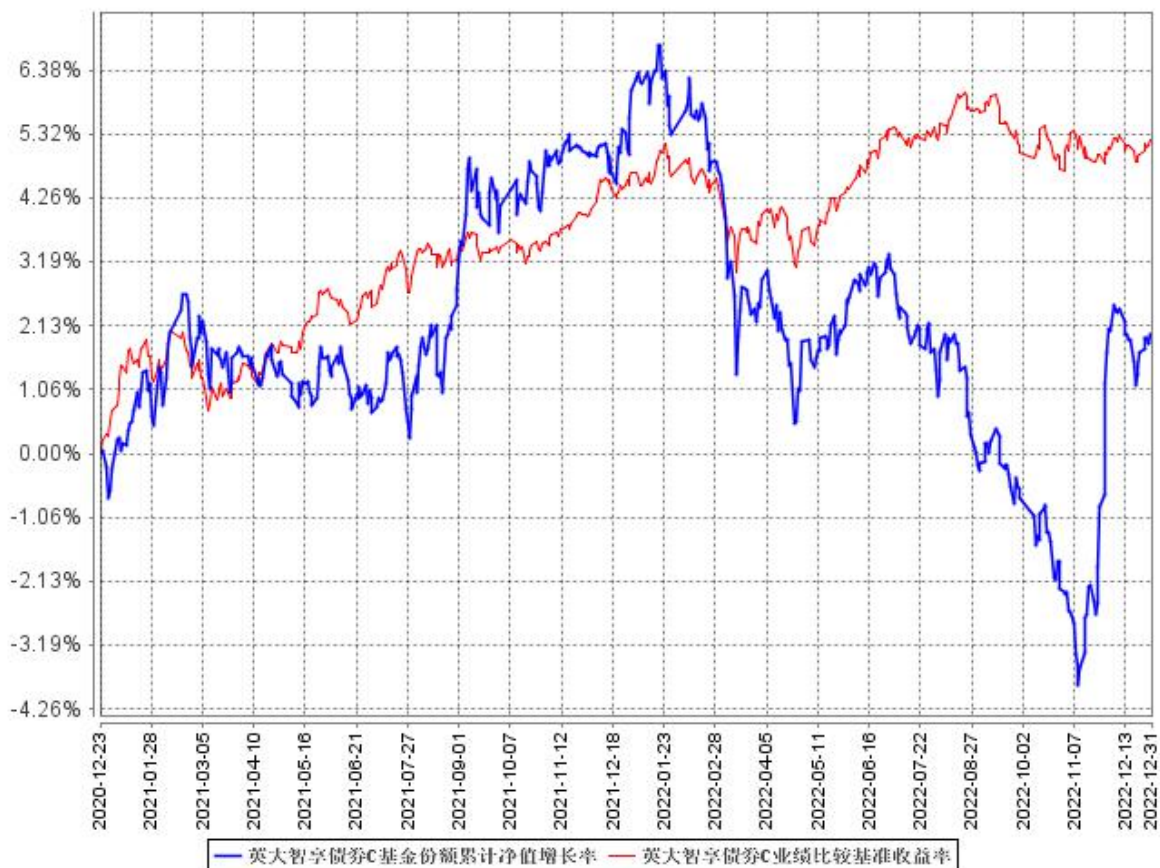


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

英大智享债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

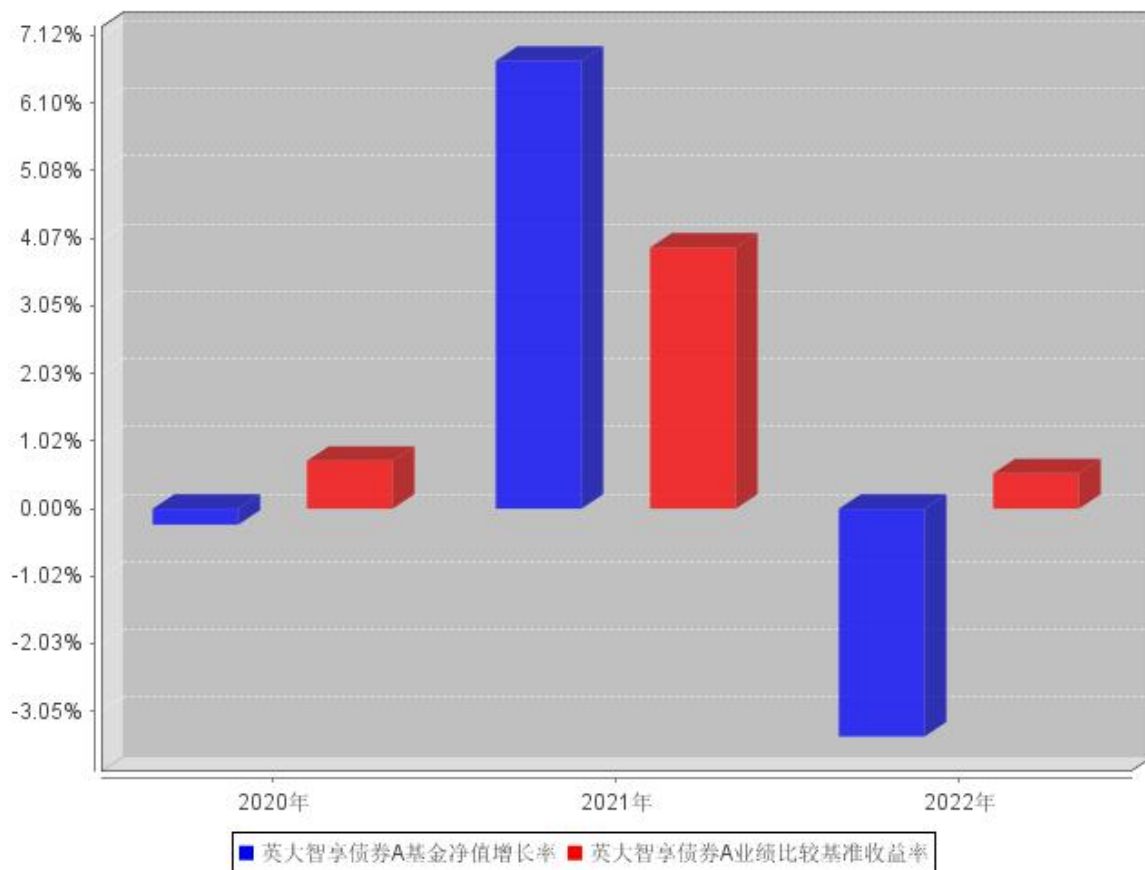


英大智享债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

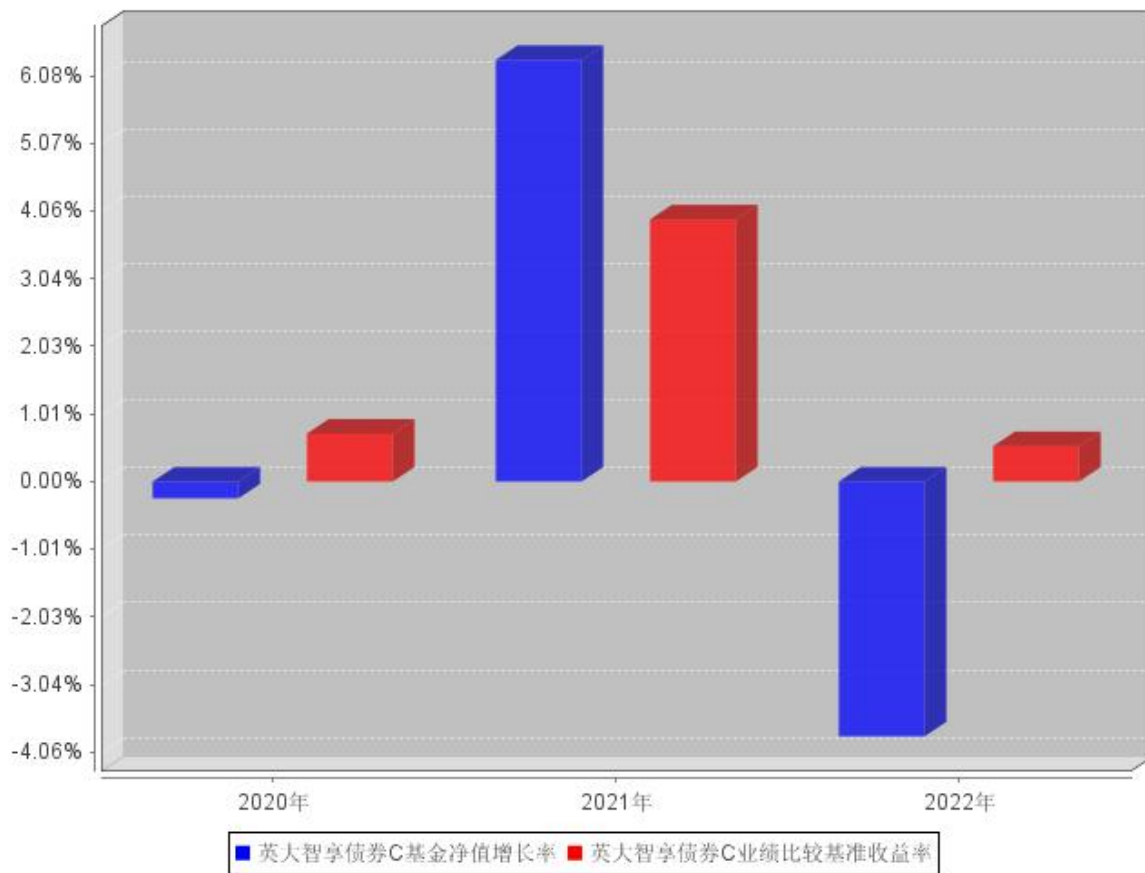


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大智享债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



英大智享债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：过去三年未进行利润分配。

## § 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

英大基金管理有限公司（以下简称“英大基金”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金 11.46 亿元，是国网英大国际控股集团有限公司的全资子公司，实际控制人为国家电网有限公司。英大基金依托股东优势，坚持市场化发展方向，立足新发展阶段、贯彻新发展理念，根植主业、服务实业、坚持能源特色、努力创造价值，积极构建规模、速度、结构、质量、效益、安全“六统一”的新发展格局，致力于为客户提供卓越的资产管理服务。

截至 2022 年末，公司全口径管理资产规模站稳千亿平台，主动管理能力与业务规模同步提升，依托高效的决策机制、专业的投研团队、严谨的风控体系，力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司，先后荣获“最具成长潜力基金公司”“杰出新锐基金公司”等奖项。

截至 2022 年 12 月 31 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安旻纯债债券型证券投资基金 22 只开放式证券投资基金，同时，管理数十个特定客户资产投资组合。

注：基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张大铮	本基金基金经理	2020 年 12 月 23 日	-	20	香港中文大学工商管理硕士。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，中国国际金融有限公

					<p>司固定收益部副总经理、资产管理部副总经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司助理总经理、固定收益投资部总监，民生基金管理有限公司(筹)副总裁。2019年5月加入英大基金，曾任总经理助理(投资总监)，现任副总经理，英大纯债债券型证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫66个月定期开放债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
易祺坤	本基金基金经理	2020年12月23日	-	11	<p>北京大学理学学士。2011年8月至2013年8月就职于寰富投资咨询(上海)有限公司，任衍生品交易员。2013年10月加入英大基金管理有限公司，历任交易管理部交易员、交易管理部副总经理(主持工作)。现任固定收益部总经理助理、基金经理，英大纯债债券型证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大通盈</p>

					纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大智享债券型证券投资基金基金合同》、《英大智享债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作无重大违法违规行为，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

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、私募资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

风险管理部定期对公司的不同投资组合在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

2022 年一季度，稳增长政策集中发力，出口高位回落，海外疫情反复但出口仍有韧性，价格因素推升投资，居民消费边际改善。多地房贷利率下调，地产政策边际放松，但 3 月开始国内疫情出现反复，经济下行压力有所加大。

二季度，基建维持高增，地产调控政策持续边际放松。4 月疫情在全国范围内呈现散点状爆发，部分城市经济停摆使得经济下行压力加大，生产、消费均受疫情拖累，出口增速回落。5-6 月复工复产逐步推进，经济底部反弹。

三季度，基建持续拉动投资，消费温和复苏，出口韧性开始消退，地产在风险事件发酵后低位缓慢修复，经济整体呈现低位企稳格局。但经济改善力度整体偏弱，修复持续性有待观察。

四季度，稳经济政策持续落地，地产支持政策加码，宽地产、宽信用预期逐步发酵，出口快速回落，疫情防控政策进一步优化，但疫情的大规模扩散使得经济短期修复力度偏弱，整体呈现低位企稳格局。10 月人民币汇率承压，经济延续弱修复走势。11 月疫情防控措施优化二十条落地，地产支持政策频出，经济修复预期走强。年底中央政治局会议以及经济工作会议先后召开，奠定



2023 年稳中求进的政策总基调，财政政策有望更加积极、稳健的货币政策侧重结构。

2022 年在货币政策中性偏松叠加央行上缴超 1 万亿结存利润的背景下，货币市场利率整体维持宽松，1 年期 AAA 同业存单震荡下行至 1.9%，直到 8 月 15 日央行 MLF 降息缩量续作，货币政策边际收紧信号明显，货币市场利率震荡上行。债券市场全年整体呈现 V 型反转走势，10 年国债 8 月 17 日触及年内低点 2.61%，随后受货币政策边际收紧、地产支持政策、疫情防控优化政策、银行理财产品遭持续赎回导致市场出现负反馈等多因素影响下震荡上行。截至 2022 年末，R007 上行至 2.79%，1 年期 AAA 同业存单上行至 2.42%，10 年国债上行至 2.84%。

股市方面，年初市场对于企业盈利的悲观预期逐步释放，PPI 持续高企，美联储货币政策收紧预期走强，海外俄乌冲突短时间内打压全球风险偏好，股市整体走低。进入二季度，国内疫情冲击经济，美联储超预期紧缩，人民币贬值压力上升，全球风险偏好大幅受挫，多重因素导致 4 月股市探底。随后经济修复预期走强，悲观预期此前已反应较为充分，股市底部反弹，二季度权益市场整体呈 V 型走势。三季度经济修复斜率不达预期，股市震荡走低。随后外围通胀持续发酵，美联储紧缩预期大幅走强，全球风险偏好再度受挫，9 月美元走强使得人民币短时间内大幅贬值，股市快速探底。四季度人民币汇率冲高带动股市探底，随后稳经济政策频繁出台，经济修复预期逐步走强，市场情绪有所修复，人民币汇率逐步企稳，美联储加息预期放缓，外围对于股市的影响边际减弱，股市整体震荡企稳。截至 2022 年末，上证指数下跌 15.13%，深证成指下跌 25.85%，创业板指下跌 29.37%。

报告期内，本基金整体维持稳健的组合久期，再投资过程中始终秉持低杠杆、短久期、高评级原则。在信用风险频发的环境下，严控产品的信用风险。权益投资方面，本基金坚持自下而上的品种选择和组合构建理念，灵活调整行业板块配置比例，保持稳健的风格。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大智享债券 A 基金份额净值为 1.0283 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.43%；截至本报告期末英大智享债券 C 基金份额净值为 1.0200 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.82%；同期业绩比较基准收益率为 0.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，债券市场面临的压力上升，收益率大概率易上难下。国内方面，稳增长政策红利或将逐步释放，疫情防控政策优化带动经济动能提升，财政政策继续拉动基建，地产拖累有望进一步减弱，风险偏好或将继续提升，但居民和企业信心恢复仍需时间，经济修复节奏和力度可能反复。另一方面，海外流动性拐点已现，通胀压力缓和，加息节奏放缓，人民币汇率趋于稳定，对于货币政策的制约降低。欧美经济整体将进入衰退期已经较为确定，全球衰退共振风险上升，

外需大概率持续承压。

权益及可转债市场方面，2023 年市场风险偏好或将继续回升，板块分化可能持续，前期调整后权益市场估值已处于相对低位，政策红利释放带来的经济复苏预期将继续为权益提供支撑。转债估值较前期高位有所回调，待市场估值调整到位后关注正股逻辑坚实、主题明确、具有较强上涨动能的题材个券。

本基金在运作时将更加关注基本面和资金面的变化，根据市场情况动态调整组合久期和大类资产配置比例，权益投资将继续秉持研究驱动投资的理念，精选行业及个股，在严控产品信用风险和流动性风险的同时，为持有人带来稳定的投资收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，及时识别合规风险，有效进行风险控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求，研究法规变化对公司业务的影响，督促责任部门落实各项法规要求，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制；三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核；四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，采用法规解读加案例演示的方式，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和运营等内部制度建设情况、内部制度执行情况、各项业务开展的合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作；二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形；三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提

出改进性建议。

#### **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，基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定进行披露。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导、各基金经理、研究部、交易部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期本基金未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在英大智享债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均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	毕马威华振审字第 2303411 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	英大智享债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的英大智享债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）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、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>该基金管理人英大基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</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>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3) 评价该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>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	左艳霞	刘宇宁
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层	
审计报告日期	2023年3月30日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：英大智享债券型证券投资基金

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	219,129.10	501,722.36
结算备付金		5,161,033.24	50,122.22
存出保证金		2,218.30	42,044.74
交易性金融资产	7.4.7.2	171,872,142.53	211,072,941.92
其中：股票投资		26,169,752.38	40,119,941.92
基金投资		-	-
债券投资		145,702,390.15	170,953,000.00
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
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		4,100.00	12,302.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	2,041,859.85
资产总计		177,258,623.17	213,720,993.49
<b>负债和净资产</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		43,043,749.85	26,999,786.50
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	197,551.38



应付管理人报酬		69,235.58	94,039.64
应付托管费		11,539.25	15,673.29
应付销售服务费		7,321.01	13,053.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,219.46	6,132.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	203,636.19	243,598.13
负债合计		43,343,701.34	27,569,835.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	130,401,874.32	174,957,190.23
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,513,047.51	11,193,968.25
净资产合计		133,914,921.83	186,151,158.48
负债和净资产总计		177,258,623.17	213,720,993.49

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，英大智享债券 A 基金份额净值 1.0283 元，基金份额总额 109,483,123.01 份；英大智享债券 C 基金份额净值 1.0200 元，基金份额总额 20,918,751.31 份。英大智享债券份额总额合计为 130,401,874.32 份。

## 7.2 利润表

会计主体：英大智享债券型证券投资基金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,661,891.57	19,778,434.78
1.利息收入		54,081.23	7,546,562.12
其中：存款利息收入	7.4.7.13	54,081.23	609,359.34
债券利息收入		-	5,431,294.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,505,908.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,561,769.77	10,116,058.15
其中：股票投资收益	7.4.7.14	603,469.28	9,729,473.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	6,233,679.68	-579,253.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
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	724,620.81	965,838.69
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	-11,278,064.49	1,997,959.17
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	321.92	117,855.34
<b>减：二、营业总支出</b>		2,139,789.00	3,665,855.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	887,647.14	1,892,565.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	147,941.19	315,427.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	106,327.52	445,962.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		759,750.73	438,851.54
其中：卖出回购金融资产支出		759,750.73	438,851.54
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,122.42	6,612.53
8. 其他费用	7.4.7.23	226,000.00	566,435.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,801,680.57	16,112,579.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,801,680.57	16,112,579.77
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,801,680.57	16,112,579.77

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：英大智享债券型证券投资基金

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 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）	174,957,190.23	-	11,193,968.25	186,151,158.48
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）	174,957,190.23	-	11,193,968.25	186,151,158.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,555,315.91	-	-7,680,920.74	-52,236,236.65
（一）、综合收益总额	-	-	-5,801,680.57	-5,801,680.57
（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）	-44,555,315.91	-	-1,879,240.17	-46,434,556.08
其中：1.基金申购款	5,986,623.77	-	217,177.95	6,203,801.72
2.基金赎回款	-50,541,939.68	-	-2,096,418.12	-52,638,357.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	130,401,874.32	-	3,513,047.51	133,914,921.83
项目	上年度可比期间 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）	261,340,065.22	-	-633,634.45	260,706,430.77
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）	261,340,065.22	-	-633,634.45	260,706,430.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-86,382,874.99	-	11,827,602.70	-74,555,272.29
（一）、综合收益总额	-	-	16,112,579.77	16,112,579.77
（二）、本期基金份	-86,382,874.99	-	-4,284,977.07	-90,667,852.06



书》的有关规定，并报中国证监会备案。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，并不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大智享债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、公开发行的次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会或国务院授权的部门核准或注册上市的股票）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附

注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 7.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### ((a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金

额

为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 后续计量

###### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

###### - 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

###### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。



- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

## 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

#### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算本基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益

分配，收益的计算以权益除权日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上

市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

#### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。

“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 501,722.36 元、50,122.22 元、42,044.74 元、12,302.40 元和 2,041,859.85 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 502,110.32 元、50,137.51 元、42,065.64 元和 12,302.40 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 211,072,941.92 元。



于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值为人民币 213,114,377.62 元。

#### 以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 26,999,786.50 元、197,551.38 元、94,039.64 元、15,673.29 元、13,053.72 元和 243,598.13 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 27,001,689.19 元、197,551.38 元、94,039.64 元、15,673.29 元、13,053.72 元和 241,695.44 元。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的银行存款、交易性金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则,将上述应计利息分别转入银行存款、交易性金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示,无期初留存收益影响。

#### (ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	219,129.10	501,722.36
等于：本金	218,920.82	501,722.36
加：应计利息	208.28	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	219,129.10	501,722.36

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	31,652,897.93	-	26,169,752.38	-5,483,145.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	29,235,450.93	385,057.63	28,925,829.13	-694,679.43
	银行间市场	117,607,271.64	2,530,261.02	116,776,561.02	-3,360,971.64
	合计	146,842,722.57	2,915,318.65	145,702,390.15	-4,055,651.07
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	178,495,620.50	2,915,318.65	171,872,142.53	-9,538,796.62	
项目	上年度末				
	2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	38,453,055.01	-	40,119,941.92	1,666,886.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	820,000.00	-	820,000.00	-
	银行间市场	170,060,619.04	-	170,133,000.00	72,380.96

	合计	170,880,619.04	-	170,953,000.00	72,380.96
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	209,333,674.05	-	211,072,941.92	1,739,267.87

### 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

注：本基金于本年末及上年末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金于本年末及上年末均未持有黄金衍生品

### 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

注：本基金于本期末及上期末均未持有任何买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期内无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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

本基金本期未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期末（2022年12月31日），本基金未发生其他债权投资减值准备。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本报告期末（2022 年 12 月 31 日），本基金未发生其他债权投资减值准备计提情况。

**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**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本报告期末本基金未进行其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	2,041,859.85
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,041,859.85

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	14,636.19	61,695.44
其中：交易所市场	963.89	46,974.10
银行间市场	13,672.30	14,721.34
-	-	-
应付利息	-	1,902.69
预提银行间费用	9,000.00	-
预提审计费用	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	203,636.19	243,598.13

**7.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

英大智享债券 A

项目	本期 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	140,867,611.62	140,867,611.62
本期申购	934,637.92	934,637.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,319,126.53	-32,319,126.53
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	109,483,123.01	109,483,123.01

金额单位：人民币元

英大智享债券 C		
项目	本期 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	34,089,578.61	34,089,578.61
本期申购	5,051,985.85	5,051,985.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-18,222,813.15	-18,222,813.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	20,918,751.31	20,918,751.31

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

注：无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

英大智享债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,297,685.14	834,379.82	9,132,064.96
本期利润	4,562,621.64	-9,092,697.46	-4,530,075.82
本期基金份额交易产生的变动数	-2,267,039.53	760,093.75	-1,506,945.78
其中：基金申购款	82,345.55	-63,485.28	18,860.27
基金赎回款	-2,349,385.08	823,579.03	-1,525,806.05
本期已分配利润	-	-	-

本期末	10,593,267.25	-7,498,223.89	3,095,043.36
-----	---------------	---------------	--------------

单位：人民币元

英大智享债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,860,138.53	201,764.76	2,061,903.29
本期利润	913,762.28	-2,185,367.03	-1,271,604.75
本期基金份额交易产生的变动数	-930,524.69	558,230.30	-372,294.39
其中：基金申购款	349,037.34	-150,719.66	198,317.68
基金赎回款	-1,279,562.03	708,949.96	-570,612.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,843,376.12	-1,425,371.97	418,004.15

#### 7.4.7.13 存款利息收入

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
活期存款利息收入	11,892.86	166,279.99
定期存款利息收入	-	389,565.20
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	41,885.20	52,708.75
其他	303.17	805.40
合计	54,081.23	609,359.34

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出股票成交总额	10,796,645.24	139,320,265.75
减：卖出股票成本总额	10,170,774.08	129,590,792.36
减：交易费用	22,401.88	-
买卖股票差价收入	603,469.28	9,729,473.39



**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 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	5,995,726.72	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	237,952.96	-579,253.93
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	6,233,679.68	-579,253.93

**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 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	247,877,893.24	501,714,097.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	244,133,281.54	495,999,007.14
减：应计利息总额	3,501,090.55	6,294,344.67
减：交易费用	5,568.19	-
买卖债券差价收入	237,952.96	-579,253.93

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

**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**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**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**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本报告期及上年度可比区间，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本报告期及上年度可比区间，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**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**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本年度及上年度均无贵金属赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**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**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益其他收益投资。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	724,620.81	965,838.69
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	724,620.81	965,838.69

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
1. 交易性金融资产	-11,278,064.49	1,997,959.17
——股票投资	-7,150,032.46	1,925,578.21
——债券投资	-4,128,032.03	72,380.96
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-11,278,064.49	1,997,959.17

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

**7.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
基金赎回费收入	321.92	117,855.34
合计	321.92	117,855.34

**7.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
乙类帐户维护费	45,400.00	24,800.00
其他	600.00	400.00
交易费用	-	361,235.13

合计	226,000.00	566,435.13
----	------------	------------

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司	基金托管人
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
国网英大国际控股集团有限公司控股子公司（注）	受国网英大国际控股集团有限公司控制的企业
北京英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 国网英大国际控股集团有限公司控股子公司包括国网国际融资租赁有限公司、英大国际信托有限责任公司、英大证券有限责任公司、英大泰和财产保险股份有限公司、英大泰和人寿保险股份有限公司和英大长安保险经纪有限公司等。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	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

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
英大证券有限责 任公司	14,167,262.24	100.00%	258,315,136.82	100.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
英大证券有限责 任公司	29,340,802.91	100.00%	-	-

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
英大证券有限责 任公司	63,000,000.00	100.00%	77,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
英大证券有限责 任公司	10,361.20	100.00%	963.89	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
英大证券有限责 任公司	188,907.37	100.00%	46,974.10	100.00%

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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
当期发生的基金应支付的管理费	887,647.14	1,892,565.56
其中：支付销售机构的客户维护费	205,199.35	768,236.07

注：支付基金管理人英大基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	147,941.19	315,427.62

注：支付基金托管人宁波银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	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		
	英大智享债券 A	英大智享债券 C	合计
英大基金管理有限公司	-	9,677.91	9,677.91
英大证券有限责任公司	-	736.22	736.22
宁波银行股份有限公司	-	31.65	31.65
合计	-	10,445.78	10,445.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
英大智享债券 A	英大智享债券 C	合计	
英大基金管理有限公司	-	574.46	574.46
英大证券有限责任公司	-	3,436.45	3,436.45
宁波银行股份有限公司	-	21.77	21.77
合计	-	4,032.68	4,032.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

英大智享债券 C 日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 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						
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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
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
宁波银行股份有限公司	20,215,477.53	-	-	-	-	-

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

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	英大智享债券 A	英大智享债券 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	67,611,263.25	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	67,611,263.25	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.8500%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	英大智享债券 A	英大智享债券 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	47,612,263.25	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-



报告期末持有的基金份额	67,611,263.25	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	38.6400%	-

注：报告期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；报告期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	219,129.10	11,892.86	501,722.36	166,279.99

注：本基金通过“宁波银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2022年12月31日的相关余额为人民币72,127.74元。（2021年12月31日：人民币42,044.74元）

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金未持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 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

注：本期末，本基金无因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本报告期末，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为 34,030,153.32 元。

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
2220034	22 贵阳银行小微债 01	2023 年 1 月 3 日	99.29	120,000	11,914,389.04
102280276	22 港兴港投 MTN002	2023 年 1 月 3 日	104.21	120,000	12,505,791.78
180403	18 农发 03	2023 年 1 月 3 日	104.89	94,000	9,859,242.79
102002032	20 华发实业 MTN004	2023 年 1 月 3 日	99.61	27,000	2,689,451.95
合计				361,000	36,968,875.56

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,013,596.53 元，于 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 1 月 5 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风险事件，以控制可能出现的信用风险。

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

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,260,989.04	20,015,000.00
合计	10,260,989.04	20,015,000.00

注：1. 债项评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 以上按短期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

3. 表中列示的未评级债券为无第三方机构评级的超短期融资券等。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	91,065,475.18	66,322,000.00
AAA 以下	12,474,425.94	-
未评级	21,412,943.83	14,767,500.00
合计	124,952,844.95	81,089,500.00

注：1. 长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 以上按长期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的证券主要在银行间本币市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 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 15%。

本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	219,129.10	-	-	-	-	-	219,129.10
结算备付金	5,161,033.24	-	-	-	-	-	5,161,033.24

存出保证金	2,218.30	-	-	-	-	-	2,218.30
交易性金融资产	20,749,545.20	1,307,640.41	57,516,887.07	55,675,918.02	10,452,399.45	26,169,752.38	171,872,142.53
应收申购款	-	-	-	-	-	4,100.00	4,100.00
资产总计	26,131,925.84	1,307,640.41	57,516,887.07	55,675,918.02	10,452,399.45	26,173,852.38	177,258,623.17
负债							
卖出回购金融资产款	43,043,749.85	-	-	-	-	-	43,043,749.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	69,235.58	69,235.58
应付托管费	-	-	-	-	-	11,539.25	11,539.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,321.01	7,321.01
应交税费	-	-	-	-	-	8,219.46	8,219.46
其他负债	-	-	-	-	-	203,636.19	203,636.19
负债总计	43,043,749.85	0.00	0.00	0.00	0.00	299,951.49	43,343,701.34
利率敏感度缺口	-16,911,824.01	1,307,640.41	57,516,887.07	55,675,918.02	10,452,399.45	25,873,900.89	133,914,921.83
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	501,722.36	-	-	-	-	-	501,722.36
结算备付金	50,122.22	-	-	-	-	-	50,122.22
存出保证金	42,044.74	-	-	-	-	-	42,044.74
交易性金融资产	49,846,500.00	50,087,000.00	820,000.00	70,199,500.00	-	40,119,941.92	211,072,941.92
其他资产	-	-	-	-	-	2,041,859.85	2,041,859.85
应收申购款	-	-	-	-	-	12,302.40	12,302.40
资产总计	50,440,389.32	50,087,000.00	820,000.00	70,199,500.00	0.00	42,174,104.17	213,720,993.49
负债							
卖出回购金融资产款	26,999,786.50	-	-	-	-	-	26,999,786.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	197,551.38	197,551.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	94,039.64	94,039.64
应付托管费	-	-	-	-	-	15,673.29	15,673.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,053.72	13,053.72
应交税费	-	-	-	-	-	6,132.35	6,132.35
其他负债	-	-	-	-	-	243,598.13	243,598.13
负债总计	26,999,786.50	0.00	0.00	0.00	0.00	570,048.51	27,569,835.01
利率敏感度缺口	23,440,602.82	50,087,000.00	820,000.00	70,199,500.00	0.00	41,604,055.66	186,151,158.35

	.82	.00	.00	.66	.48
--	-----	-----	-----	-----	-----

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	市场利率平行下降25个基点	434,052.29	392,141.90
市场利率平行上升25个基点	-426,543.99	-386,092.69	

#### 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券和证券交易所市场交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	26,169,752.38	19.54	40,119,941.92	21.55
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	145,702,390.15	108.80	170,953,000.00	91.84
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	171,872,142.53	128.34	211,072,941.92	113.39

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	沪深 300 指数出现涨跌变化，其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5 个百分点	1,001,264.55	1,718,485.24
	沪深 300 指数下跌 5 个百分点	-1,001,264.55	-1,718,485.24

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；



第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	26,169,752.38	40,119,941.92
第二层次	145,702,390.15	170,133,000.00
第三层次	-	820,000.00
合计	171,872,142.53	211,072,941.92

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

##### 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

注：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

注：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 2022 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：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工具主要包括应收款项和卖出回购金融资产款，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

##### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	26,169,752.38	14.76
	其中：股票	26,169,752.38	14.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	145,702,390.15	82.20
	其中：债券	145,702,390.15	82.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,380,162.34	3.04
8	其他各项资产	6,318.30	0.00
9	合计	177,258,623.17	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,003,926.00	0.75
C	制造业	15,454,322.38	11.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,581,990.00	2.67
J	金融业	4,302,514.00	3.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,827,000.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	26,169,752.38	19.54

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末，本基金未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	244,600	4,302,514.00	3.21
2	002555	三七互娱	197,900	3,581,990.00	2.67
3	000423	东阿阿胶	75,547	3,074,762.90	2.30
4	603228	景旺电子	140,319	2,840,056.56	2.12
5	002867	周大生	162,400	2,278,472.00	1.70
6	603989	艾华集团	84,194	2,162,101.92	1.61
7	300832	新产业	36,700	1,840,138.00	1.37
8	002739	万达电影	130,500	1,827,000.00	1.36
9	002035	华帝股份	297,900	1,650,366.00	1.23
10	600256	广汇能源	111,300	1,003,926.00	0.75
11	600419	天润乳业	58,500	917,280.00	0.68
12	600315	上海家化	21,700	691,145.00	0.52

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603228	景旺电子	912,531.00	0.49
2	601166	兴业银行	910,106.00	0.49
3	600315	上海家化	774,040.00	0.42
4	600419	天润乳业	773,940.00	0.42

**8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002555	三七互娱	3,382,769.00	1.82
2	300497	富祥药业	1,632,459.00	0.88
3	600256	广汇能源	1,281,900.00	0.69
4	601166	兴业银行	1,275,689.00	0.69
5	603228	景旺电子	1,272,135.24	0.68
6	000423	东阿阿胶	1,194,273.00	0.64
7	300832	新产业	393,120.00	0.21
8	002867	周大生	364,300.00	0.20

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,370,617.00
卖出股票收入（成交）总额	10,796,645.24

**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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	54,997,067.93	41.07
	其中：政策性金融债	10,488,556.16	7.83
4	企业债券	19,866,617.85	14.84
5	企业短期融资券	10,260,989.04	7.66
6	中期票据	51,518,504.05	38.47
7	可转债（可交换债）	9,059,211.28	6.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	145,702,390.15	108.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	102280276	22 港兴港投 MTN002	120,000	12,505,791.78	9.34
2	2220034	22 贵阳银行小 微债 01	120,000	11,914,389.04	8.90
3	2228031	22 恒丰银行永 续债	120,000	11,728,047.12	8.76
4	180403	18 农发 03	100,000	10,488,556.16	7.83
5	1920034	19 北部湾银行 二级 01	100,000	10,452,399.45	7.81

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期内未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期内未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11 投资组合报告附注

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

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体本期，除以下情形外，未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

22 恒丰银行永续债：2022 年 3 月 21 日，恒丰银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会罚款 480 万元；2022 年 5 月 25 日，恒丰银行因违反规定办理结汇、未按照规定报送结售汇综合头寸报表被国家外汇管理局山东省分局责令改正，给予警告，处罚款 71 万，没收违法所得 24.39 万元，罚没款合计 95.39 万元。

19 北部湾银行二级 01：2022 年 7 月 12 日，广西北部湾银行因欠交存款准备金被中国人民银

行南宁中心支行罚款 48 万元；2022 年 12 月 7 日，广西北部湾银行因反外汇登记管理规定等三条违法违规事项被国家外汇管理局广西壮族自治区分局警告，没收违法所得 4807.22 元，并罚款 113 万元。

18 农发 03：2022 年 3 月 21 日，中国农业发展银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会罚款 480 万元。

20 碧地 01：2022 年 1 月 4 日，碧桂园因广告宣传违法被南部县市场监管局正式立案调查并责令改正该广告宣传行为。

基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处罚不会对所持有证券的投资价值构成实质性影响。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定，也均在基金的备选股票池之内。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,218.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,318.30

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	3,380,237.53	2.52
2	113050	南银转债	2,349,306.85	1.75
3	113602	景 20 转债	2,022,026.49	1.51
4	113011	光大转债	1,307,640.41	0.98

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
英大智享债券 A	479	228,566.02	67,611,263.25	61.75%	41,871,859.76	38.25%
英大智享债券 C	500	41,837.50	-	-	20,918,751.31	100.00%
合计	954	136,689.60	67,611,263.25	51.85%	62,790,611.07	48.15%

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	英大智享债券 A	10,156.73	0.0093%
	英大智享债券 C	2,060.12	0.0098%
	合计	12,216.85	0.0094%

注：上表中基金管理人从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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



#### 9.4 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品情况

注：无

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大智享债券 A	英大智享债券 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 23 日）基金份额总额	158,096,162.30	103,243,902.92
本报告期期初基金份额总额	140,867,611.62	34,089,578.61
本报告期基金总申购份额	934,637.92	5,051,985.85
减:本报告期基金总赎回份额	32,319,126.53	18,222,813.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	109,483,123.01	20,918,751.31

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内，英大基金管理有限公司于 2022 年 3 月 12 日发布公告，自 2022 年 3 月 11 日起，党晶先生新任英大基金管理有限公司副总经理职务；于 2022 年 12 月 28 日发布公告，自 2022 年 12 月 26 日起，马晓燕女士不再担任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期，基金托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内增长超过百分之三十。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生涉及基金管理人、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

本基金投资策略没有发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为 60,000 元。本次会计师事务所的聘任已经基金管理人董事会批准，并履行了必要的程序。

### 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

注：本报告期内，本基金未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金未发生托管人及其高级管理人员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	
英大证券	2	14,167,262.24	100.00%	10,361.20	100.00%	-

注：根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

## 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
英大证券	29,340,802.91	100.00%	63,000,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	英大基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年1月1日
2	英大智享债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022年1月22日
3	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年1月22日
4	英大基金管理有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	公司网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年1月27日
5	英大基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构的公告	公司网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年2月23日
6	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年3月12日
7	英大基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信	2022年3月25日

		息披露平台	
8	英大基金管理有限公司关于参加中信建投证券股份有限公司申购费率(含定期定额投资)优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年3月25日
9	英大智享债券型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022年3月30日
10	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年3月30日
11	英大智享债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022年4月21日
12	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年4月21日
13	关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年4月22日
14	关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年4月22日
15	英大基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022年5月6日
16	英大基金管理有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站、上海证券报、证券日报、中国证券报、证券时报、中国证监会电子信息披露平台	2022年5月9日
17	英大基金管理有限公司关于旗下部分产品参与银河证券	公司网站、中国证券报、上海证券报、证	2022年5月9日

	基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	
18	英大基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构的公告	公司网站、上海证券报、证券日报、中国证券报、券时报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 5 月 10 日
19	英大基金管理有限公司关于下线英大财富宝 APP 运营及维护服务的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 5 月 28 日
20	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明(2022 年 6 月)	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 6 月 30 日
21	英大智享债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站、券时报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 7 月 20 日
22	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 7 月 20 日
23	关于旗下部分产品参与东海证券基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 7 月 20 日
24	英大基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 8 月 10 日
25	英大智享债券型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 8 月 30 日
26	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、券时报、证券日报、 中国证监会电子信息披露平台	2022 年 8 月 30 日

27	英大智享债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 10 月 25 日
28	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 10 月 25 日
29	英大智享债券型证券投资基金（英大智享债券 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 9 日
30	英大智享债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 9 日
31	英大智享债券型证券投资基金（英大智享债券 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 9 日
32	英大基金管理有限公司关于旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	公司网站、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 9 日
33	英大基金管理有限公司关于完善基金日净值查询服务的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 9 日
34	英大基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 11 月 23 日
35	英大基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 12 月 20 日
36	英大基金管理有限公司关于董事长变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会电子信息披露平台	2022 年 12 月 28 日
37	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2022 年 12 月）	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、	2022 年 12 月 31 日

---

		中国证监会电子信 息披露平台	
--	--	-------------------	--



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101 - 20221231	67,611,263.25	-	-	67,611,263.25	51.85%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

- (1) 赎回申请延期办理的风险  
持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。
- (2) 基金净值大幅波动的风险  
当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。
- (3) 基金规模较小导致的风险  
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。
- (4) 提前终止基金合同的风险  
高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。
- (5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险  
当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

中国证监会批准英大智享债券型证券投资基金设立的文件

《英大智享债券型证券投资基金基金合同》

《英大智享债券型证券投资基金托管协议》

《英大智享债券型证券投资基金招募说明书》

《英大智享债券型证券投资基金产品资料概要》

基金管理人业务资格批件和营业执照

报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.ydamc.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人英大基金管理有限公司，客户服务电话：010-57835666、400-890-5288。

英大基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日