

# 嘉合锦元回报混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年03月23日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合锦元回报混合型证券投资基金	
基金简称	嘉合锦元回报混合	
基金主代码	011015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年03月23日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,148,132.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合锦元回报混合A	嘉合锦元回报混合C
下属分级基金的交易代码	011015	011016
报告期末下属分级基金的份额总额	172,395,610.69份	59,752,522.12份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略：（1）利率预期策略、（2）收益率曲线策略、（3）信用债券投资策略、（4）杠杆投资策略、（5）可转换/交换债券投资策略；3、股票投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、股票期权投资策略
业绩比较基准	中证全债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	嘉合基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限

			公司
信息披露 负责人	姓名	崔为中	田东辉
	联系电话	021-60168288	010-68858113
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-0603-299	95580
传真		021-65015077	010-68858120
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1 幢329室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A 楼	北京市西城区金融大街3号A 座
邮政编码		200082	100808
法定代表人		郝艳芬	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年03月23日(基金合同生效日)-2021年06月30日)	
	嘉合锦元回报混合A	嘉合锦元回报混合C
本期已实现收益	494,123.17	84,529.19
本期利润	584,232.84	120,403.27
加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0016
本期加权平均净值利润率	0.33%	0.16%
本期基金份额净值增长率	0.33%	0.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	482,927.27	69,716.00
期末可供分配基金份额利润	0.0028	0.0012
期末基金资产净值	172,967,289.55	59,853,000.57
期末基金份额净值	1.0033	1.0017
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.33%	0.17%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金的合同生效日为2021年3月23日，主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2021年6月30日数据，特此说明。

### 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

嘉合锦元回报混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.03%	0.02%	-0.25%	0.17%	0.22%	-0.15%
过去三个月	0.30%	0.02%	1.79%	0.20%	-1.49%	-0.18%
自基金合同生效起至今	0.33%	0.02%	1.95%	0.20%	-1.62%	-0.18%

嘉合锦元回报混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.02%	-0.25%	0.17%	0.17%	-0.15%
过去三个月	0.16%	0.02%	1.79%	0.20%	-1.63%	-0.18%
自基金合同生效起至今	0.17%	0.01%	1.95%	0.20%	-1.78%	-0.19%

## 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



嘉合锦元回报混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月23日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于 2021 年 03 月 23 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自合同生效起 6 个月内为建仓期。

嘉合锦元回报混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月23日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于 2021 年 03 月 23 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自合同生效起 6 个月内为建仓期。

## § 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

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”或“公司”）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2021年6月30日，公司注册资本为人民币3亿元。

截至2021年6月30日，嘉合基金旗下共管理18只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合消费升级混合型发起式证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合医疗健康混合型发起式证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金及嘉合锦元回报混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李国林	权益投资部副总监、嘉合磐石混合型证券投资基	2021-03-23	-	22年	浙江工商大学经济学硕士，拥有22年金融从业经

	金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合消费升级混合型发起式证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股股票型证券投资基金的基金经理				历。曾任上银基金管理有限公司专户投资部总监兼研究总监、上海凯石益正资产管理有限公司投资总监、凯石基金管理有限公司投资事业部总监，2018年加入嘉合基金管理有限公司。
莫华寅	固定收益公募投资部副总监，嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金的基金经理	2021-03-23	-	12年	上海外国语大学工商管理硕士，特许金融分析师(CFA)，曾任中银基金管理有限公司渠道销售部区域主管，东吴证券股份有限公司固定收益总部高级交易员，浙商基金管理有限公司基金经理，兴业基金管理有限公司基金经理，2020年加入嘉合基金管理有限公司。
李超	固定收益研究部总监，嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金的基金经理	2021-06-30	-	14年	上海交通大学理学学士。曾任友邦保险中国区资产管理中心债券交易员、浦银安盛基金管理有限公司债券交易员、国投瑞银基金管理有限公司投资经理助理、交银施罗德基金管理有限公司投资经理、富国基金管理有限公司投资经理、上海弘尚资产管理中心（有限合伙）固定收益总监，2020年加入嘉合

					基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	-----------

注：1、李国林、莫华寅的“任职日期”为基金合同生效日，李超的“任职日期”为公告确定的任职日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### 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

上半年，虽然指数波澜不惊，但在风格上，却是大开大阖。一季度，经济名义增速高达21%，实际增速达18.3%。春节后，疫情消退，原油、铜、铝、钢材、铁矿石、煤炭、航运等商品价格高歌猛进，市场对全球经济复苏持很乐观的看法。于是，强周期板块的相关行业和个股大幅上涨，沉寂数年之久已的钢铁行业掀起复苏行情，整体涨幅达15.66%，而受益于经济向上不良资产下降预期的银行板块涨幅亦达10.51%，化工、有色、甚至煤炭都迎来了春天，涨幅排在前列。同时，医药、新能源、半导体板块等“赛道股”出现了幅度可观的下跌，不少龙头公司的下跌幅度达到30%以上。但是中国经济转型升级是时代的趋势。其中的龙头公司他们的行业地位、竞争优势还在强化。估值上偏低，还处在价值买入的范围，短期的下跌只是市场情绪的波动。于是经过两个多月之后，市场风格再一次转换。背后原因在于在新能源汽车销量逐月提速，行业排产量一增再增。

二季度申万电气设备行业的涨幅达30.7%，位列全行业第一。市场风格在二季度再次反转。

本报告期内，我们逐步完成本基金的建仓工作，主要配置了利率债及高等级信用债；权益方面，逐步配置了少量新能源、医药、消费板块的龙头公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合锦元回报混合A基金份额净值为1.0033元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.33%，同期业绩比较基准收益率为1.95%；截至报告期末嘉合锦元回报混合C基金份额净值为1.0017元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.17%，同期业绩比较基准收益率为1.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在利率下行，房住不炒，资金泛滥的时代背景下，我们认为我国的权益市场有望形成一个慢牛长牛的格局。即使是最近由平台反垄断、教育双减和DIDI数据安全所引发的市场担心，我们相信也很快就会过去。我们认为对相关行业的整顿和调整，应该只是局部的。发展经济始终是我们的一个重大国策。相应的，我们将对房地产、互联网、娱乐传媒、金融和部分利益流向私人资本的垄断性消费公司保持谨慎。我们相信中国将继续走市场经济的道路，继续支持资本市场发展和扩大改革开放的路线不会变更。随着中国经济的逐步转型升级，人均GDP不断增长的过程中，有着海量的市场空白和未被发现的需求，这为新兴公司的产生和成长提供了空间。这世界，人类对美好生活、对力量、对健康、对安全、对精神的追求是无止境的。只要有新的、好的服务或产品出现，不需要担心需求。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类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。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告期内无需要说明的相关情形。

### § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉合锦元回报混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：嘉合锦元回报混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	576,309.59
结算备付金		1,420,933.84
存出保证金		21,120.16
交易性金融资产	6.4.7.2	206,813,724.40
其中：股票投资		908,160.00
基金投资		-
债券投资		205,905,564.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		24,510,430.88
应收利息	6.4.7.5	2,411,865.40
应收股利		-
应收申购款		99.05
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		235,754,483.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		2,620,965.76
应付管理人报酬		164,520.50
应付托管费		41,130.13
应付销售服务费		36,215.46
应付交易费用	6.4.7.7	8,720.17
应交税费		2,518.33
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	60,122.85
负债合计		2,934,193.20
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	232,148,132.81
未分配利润	6.4.7.10	672,157.31
所有者权益合计		232,820,290.12
负债和所有者权益总计		235,754,483.32

注：1、报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0029元，A类基金份额净值1.0033元，C类基金份额净值1.0017元，基金份额总额232,148,132.81份，其中A类基金份额172,395,610.69份，C类基金份额59,752,522.12份。

2、由于本基金于2021年3月23日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示2021年6月30日的数据，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合锦元回报混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年03月23日（基金合同
----	-----	------------------------



		生效日) 至2021年06月30 日
<b>一、收入</b>		1,633,199.40
1. 利息收入		1,724,485.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	232,404.60
债券利息收入		1,204,955.58
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		287,125.71
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-228,990.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-261,725.75
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	32,735.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	125,983.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	11,720.23
<b>减：二、费用</b>		928,563.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	548,156.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	137,039.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	122,982.10
4. 交易费用	6.4.7.20	14,051.18
5. 利息支出		48,973.29
其中：卖出回购金融资产支出		48,973.29
6. 税金及附加		623.64
7. 其他费用	6.4.7.21	56,738.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		704,636.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		704,636.11

注：由于本基金于2021年3月23日成立，无比较式的上年度可比期间，因此上表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合锦元回报混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	253,164,582.16	-	253,164,582.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	704,636.11	704,636.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-21,016,449.35	-32,478.80	-21,048,928.15
其中：1. 基金申购款	443,694.02	946.27	444,640.29
2. 基金赎回款	-21,460,143.37	-33,425.07	-21,493,568.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	232,148,132.81	672,157.31	232,820,290.12

注：由于本基金于2021年3月23日成立，无比较式的上年度可比期间，因此上表只列示本期数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郝艳芬

沈珂

陈若

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉合锦元回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予嘉合锦元回报混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]3091号文)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2021年3月23日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币253,164,582.16元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“邮政储蓄银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同》和《嘉合锦元回报混合型证券投资基金招募说明书》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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、银行存款及现金、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-40%;每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2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2021年6月30日的财务状况、自2021年3月23日（基金合同生效日）至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2021年3月23日（基金合同生效日）起至2021年6月30日止。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配,具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后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。本基金每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、



国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

(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。

(h) 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	576,309.59	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	576,309.59	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	945,455.25	908,160.00	-37,295.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	105,368,173.33	105,456,564.40	88,391.07
	银行间市场	100,374,112.07	100,449,000.00	74,887.93
	合计	205,742,285.40	205,905,564.40	163,279.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	206,687,740.65	206,813,724.40	125,983.75

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,721.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	639.40
应收债券利息	2,409,495.09
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.50
合计	2,411,865.40

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	7,070.17
银行间市场应付交易费用	1,650.00
合计	8,720.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,784.85
应付证券出借违约金	-
预提费用	56,338.00
合计	60,122.85

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 嘉合锦元回报混合A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合锦元回报混合A)	本期 2021年03月23日(基金合同生效日)至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	176,816,554.05	176,816,554.05
本期申购	251,440.40	251,440.40
本期赎回(以“-”号填列)	-4,672,383.76	-4,672,383.76
本期末	172,395,610.69	172,395,610.69

##### 6.4.7.9.2 嘉合锦元回报混合C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合锦元回报混合C)	本期 2021年03月23日(基金合同生效日)至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	76,348,028.11	76,348,028.11
本期申购	192,253.62	192,253.62
本期赎回(以“-”号填列)	-16,787,759.61	-16,787,759.61
本期末	59,752,522.12	59,752,522.12

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 嘉合锦元回报混合A

单位：人民币元

项目 (嘉合锦元回报混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	494,123.17	90,109.67	584,232.84
本期基金份额交易产生的变动数	-11,195.90	-1,358.08	-12,553.98
其中：基金申购款	485.00	93.89	578.89
基金赎回款	-11,680.90	-1,451.97	-13,132.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	482,927.27	88,751.59	571,678.86

## 6.4.7.10.2 嘉合锦元回报混合C

单位：人民币元

项目 (嘉合锦元回报混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	84,529.19	35,874.08	120,403.27
本期基金份额交易产	-14,813.19	-5,111.63	-19,924.82

生的变动数			
其中：基金申购款	179.19	188.19	367.38
基金赎回款	-14,992.38	-5,299.82	-20,292.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,716.00	30,762.45	100,478.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	22,998.21
定期存款利息收入	203,333.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,008.47
其他	64.59
合计	232,404.60

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	4,256,408.00
减：卖出股票成本总额	4,518,133.75
买卖股票差价收入	-261,725.75

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	32,735.28
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	32,735.28

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	63,348,983.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	62,526,178.83
减：应收利息总额	790,069.04
买卖债券差价收入	32,735.28

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	125,983.75
——股票投资	-37,295.25
——债券投资	163,279.00
——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	125,983.75

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30



	日
基金赎回费收入	11,720.23
合计	11,720.23

注：1、赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费部分按持有期间的增加而递减计入基金财产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30 日
交易所市场交易费用	12,401.18
银行间市场交易费用	1,650.00
合计	14,051.18

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30 日
审计费用	21,127.00
信息披露费	35,211.00
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	56,738.00

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	548,156.06
其中：支付销售机构的客户维护费	271,535.04

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	137,039.02

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售	本期

服务费的各关联方名称	2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合锦元回报混合A	嘉合锦元回报混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	0.18	0.18
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	113,735.82	113,735.82
合计	0.00	113,736.00	113,736.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.60%。计算公式如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月23日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	576,309.59	22,998.21

注：除上表列示的金额外，本基金通过“邮储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，2021年6月30日的相关余额为人民币1,420,933.84元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	730	73,000.00	73,000.00	-

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及

创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理

部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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。

##### 6.4.13.2.1 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 2021年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	30,023,000.00
合计	30,023,000.00

- 1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。
- 2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。
- 3、未评级债券为短期融资券等无信用评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日
AAA	20,142,000.00
AAA以下	-
未评级	-
合计	20,142,000.00

- 1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。
- 2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。
- 3、未评级为短期融资券等无信用评级的债券。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。



针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注6.4.12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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；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，以保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括交易所及银行间交易的债券等固定收益类工具，同时固定收益类投资基本为期限一年以内（含一年）的投资标的，保证了组合较高的流动性，不易发生变现困难等情况。同时，本基金亦可以通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不超过该上市公司可流通股股票的15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不超过该上市公司可流通股股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	576,309.59	-	-	-	-	-	576,309.59
结算备付金	1,420,933.84	-	-	-	-	-	1,420,933.84
存出保证金	21,120.16	-	-	-	-	-	21,120.16
交易性金融资产	10,010,000.00	10,006,000.00	135,510,564.40	40,167,000.00	10,212,000.00	908,160.00	206,813,724.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-	24,510,430.88	24,510,430.88
应收利息	-	-	-	-	-	2,411,865.40	2,411,865.40
应收申购款	-	-	-	-	-	99.05	99.05
资产总计	12,028,363.59	10,006,000.00	135,510,564.40	40,167,000.00	10,212,000.00	27,830,555.33	235,754,483.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,620,965.76	2,620,965.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	164,520.50	164,520.50
应付托管费	-	-	-	-	-	41,130.13	41,130.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	36,215.46	36,215.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,720.17	8,720.17
应交税费	-	-	-	-	-	2,518.33	2,518.33

其他负债	-	-	-	-	-	60,122.85	60,122.85
负债总计	-	-	-	-	-	2,934,193.20	2,934,193.20
利率敏感度缺口	12,028,363.59	10,006,000.00	135,510,564.40	40,167,000.00	10,212,000.00	24,896,362.13	232,820,290.12

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整	
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 2021年06月30日
	市场利率平行下降25个基点	557,065.40
	市场利率平行上升25个基点	-557,065.40

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	908,160.00	0.39
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	205,905,564.40	88.44
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	206,813,724.40	88.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年06月30日
	业绩比较基准上升5%	230,143.95
	业绩比较基准下降5%	-230,143.95

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 以公允价值计量的资产和负债

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。

2021年6月30日，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中属于第一层次的余额为人民币908,160.00元，属于第二层次的余额为人民币205,905,564.40元，属于第三层次的余额为0。

#### 6.4.14.1.1 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### 6.4.14.1.2 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	908,160.00	0.39
	其中：股票	908,160.00	0.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	205,905,564.40	87.34
	其中：债券	205,905,564.40	87.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,997,243.43	0.85
8	其他各项资产	26,943,515.49	11.43
9	合计	235,754,483.32	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	594,980.00	0.26
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	313,180.00	0.13
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	908,160.00	0.39

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	2,000	313,180.00	0.13
2	000661	长春高新	600	232,200.00	0.10
3	300142	沃森生物	3,000	185,100.00	0.08
4	601012	隆基股份	2,000	177,680.00	0.08

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,780,382.00	1.62
2	000858	五粮液	474,730.00	0.20
3	000661	长春高新	348,715.00	0.15
4	603259	药明康德	316,279.00	0.14
5	300142	沃森生物	260,236.00	0.11
6	601012	隆基股份	176,177.00	0.08
7	300014	亿纬锂能	107,070.00	0.05

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,542,664.00	1.52
2	000858	五粮液	465,028.00	0.20
3	300014	亿纬锂能	108,000.00	0.05
4	000661	长春高新	78,556.00	0.03
5	300142	沃森生物	62,160.00	0.03

注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,463,589.00
卖出股票收入（成交）总额	4,256,408.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	84,058,800.00	36.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,683,764.40	35.08
	其中：政策性金融债	71,681,764.40	30.79
4	企业债券	10,067,000.00	4.32
5	企业短期融资券	30,023,000.00	12.90
6	中期票据	-	-



7	可转债(可交换债)	73,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	205,905,564.40	88.44

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019649	21国债01	840,000	84,058,800.00	36.10
2	190407	19农发07	300,000	30,165,000.00	12.96
3	190207	19国开07	200,000	20,120,000.00	8.64
4	200215	20国开15	100,000	10,139,000.00	4.35
5	155270	G19鲁金1	100,000	10,067,000.00	4.32

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚，南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其派出机构的处罚。注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,120.16
2	应收证券清算款	24,510,430.88
3	应收股利	-
4	应收利息	2,411,865.40
5	应收申购款	99.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,943,515.49

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉合锦元回报混合A	2,726	63,241.24	0.00	0.00%	172,395,610.69	100.00%
嘉合锦元回报混合C	1,136	52,599.05	4,000,158.89	6.69%	55,752,363.23	93.31%
合计	3,862	60,110.86	4,000,158.89	1.72%	228,147,973.92	98.28%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉合锦元回报混合A	1,009.98	0.00%

	嘉合锦元回报混合C	10.01	0.00%
	合计	1,019.99	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	嘉合锦元回报混合A	0~10
	嘉合锦元回报混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合锦元回报混合A	-
	嘉合锦元回报混合C	-
	合计	-

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间、C份额总量在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合锦元回报混合A	嘉合锦元回报混合C
基金合同生效日(2021年03月23日)基金份额总额	176,816,554.05	76,348,028.11
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	251,440.40	192,253.62
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,672,383.76	16,787,759.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	172,395,610.69	59,752,522.12
-------------	----------------	---------------

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生以下重大人事变动：

1、自2021年4月2日起，徐进先生不再担任公司总经理职务，公司董事长郝艳芬女士代任公司总经理职务。

本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内无重大人事变动情况。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
国元证券	2	9,719,997.00	100.00%	7,070.17	100.00%	-

注：1、本基金本报告期内新增国元证券交易单元2个。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国元证券	212,529,051.11	100.00%	1,023,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
2	嘉合锦元回报混合型证券投资基金招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
3	嘉合锦元回报混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
4	嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站	2021-02-02
5	嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
6	嘉合锦元回报混合型证券投资基金(A类份额)基金产品	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02

	资料概要		
7	嘉合锦元回报混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
8	嘉合基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
9	嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
10	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2021-03-31
11	嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员(总经理)变更的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-03
12	关于嘉合锦元回报混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
13	关于嘉合锦元回报混合型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合锦元回报混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合锦元回报混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合锦元回报混合型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人办公场所、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日