

# 嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金

## 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01月01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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	嘉合慧康63个月定开债券	
基金主代码	009673	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月04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	7,999,034,344.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	009673	009674
报告期末下属分级基金的份额总额	7,999,027,675.31份	6,669.02份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用持有到期策略，将基金资产主要配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益类资产，力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内，本基金采用买入并持有策略构建投资组合，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。
业绩比较基准	同期三年期银行定期存款基准利率(税后)+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	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	《证券时报》
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01月01日-2021年06月30日)	
	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C
本期已实现收益	140,913,098.94	113.75
本期利润	140,913,098.94	113.75
加权平均基金份额本期利润	0.0176	0.0171
本期加权平均净值利润率	1.75%	1.69%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.70%
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	37,021,767.82	24.20
期末可供分配基金份额利润	0.0046	0.0036
期末基金资产净值	8,036,049,443.13	6,693.22
期末基金份额净值	1.0046	1.0036
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	3.09%	2.99%

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）。

## 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

## 嘉合慧康63个月定开债券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
过去一个月	0.29%	0.01%	0.27%	0.01%	0.02%	0.00%
过去三个月	0.91%	0.01%	0.81%	0.01%	0.10%	0.00%
过去六个月	1.76%	0.01%	1.63%	0.01%	0.13%	0.00%
自基金合同 生效起至今	3.09%	0.01%	2.99%	0.01%	0.10%	0.00%

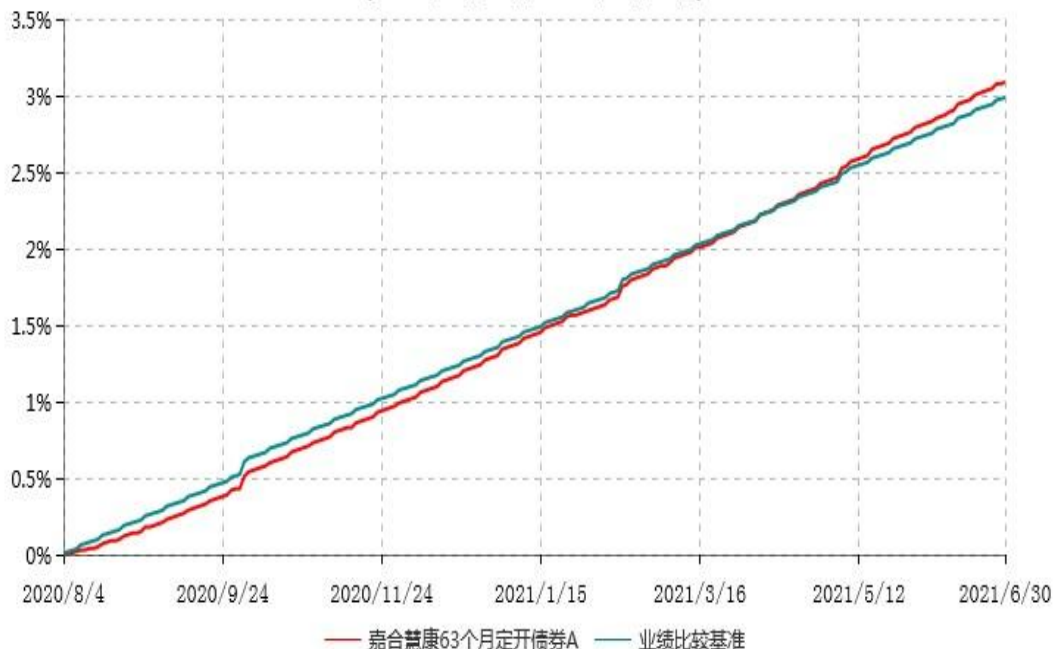
## 嘉合慧康63个月定开债券C

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
过去一个月	0.28%	0.01%	0.27%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.88%	0.01%	0.81%	0.01%	0.07%	0.00%
过去六个月	1.70%	0.01%	1.63%	0.01%	0.07%	0.00%
自基金合同 生效起至今	2.99%	0.01%	2.99%	0.01%	0.00%	0.00%

### 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



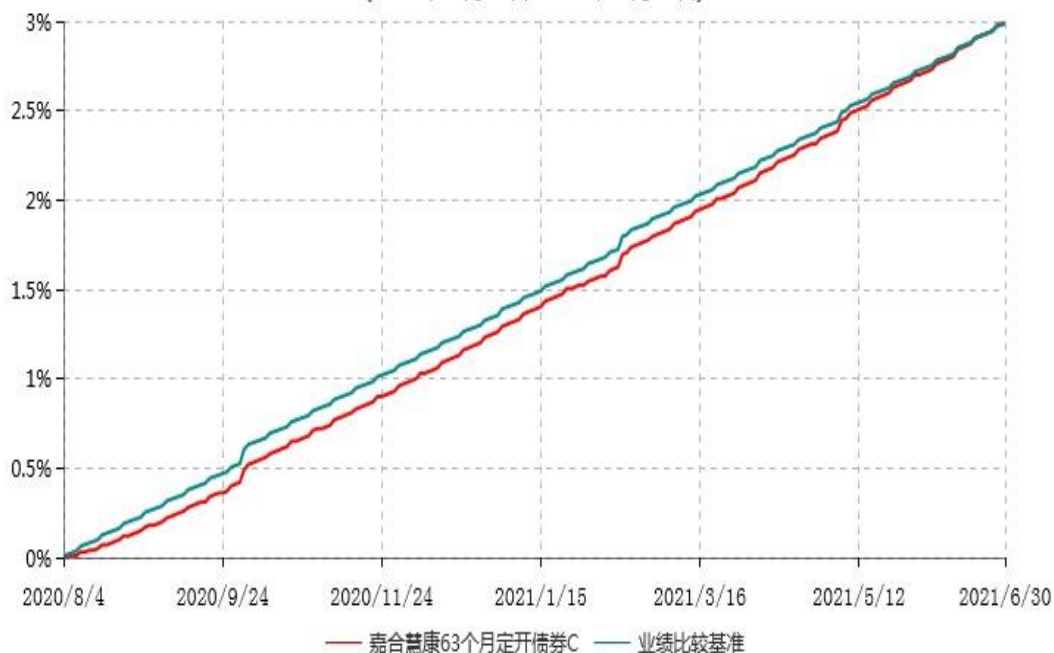
嘉合慧康63个月定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年08月04日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效。截至本报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效，按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

嘉合慧康63个月定开债券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  
(2020年08月04日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效。截至本报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效，按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
季慧娟	嘉合货币市场基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、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的基金经理	2020-08-04	-	13年	上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士，拥有13年金融行业从业经验。曾任华宝信托有限责任公司交易员，德邦基金管理有限公司债券交易员兼研究员，中欧基金管理有限公司债券交易员。2014年加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、季慧娟的“任职日期”为基金合同生效日。

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

2021年上半年，国内经济总体延续修复态势，工业生产和出口强劲，前期增速较快的基建和房地产投资有所放缓，消费缓慢回升。从6月公布的数据来看，多项指标小幅走弱。通胀方面，大宗价格上涨令PPI冲高，CPI温和上涨。

上半年，央行货币政策保持中性，政策利率维持不变。MLF和公开市场操作以等量续作为主，公开市场操作除跨季等特殊时期增量外，大多数时间保持100亿投放节奏，市场流动性较宽裕。上半年，除1月底流动性紧张外，大部分时间市场流动性处于宽松状态。

上半年债券市场震荡上涨，其中最大的回调来自于1月下旬资金紧张带来对货币政策转向的担忧，债券收益率快速上行。而后，在资金宽松和机构欠配背景下，债券收益率缓慢下行。6月市场行情有所波动，6月初市场调整较快，随着央媒表态和中长期存款利率下降后，债市重新反转，快速上涨。

报告期内，本基金配置了期限匹配的政策性金融债，提高账户杠杆。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券A基金份额净值为1.0046元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.76%，同期业绩比较基准收益率为1.63%；截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券C基金份额净值为1.0036元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.70%，同期业绩比较基准收益率为1.63%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增速放缓，扰动因素增多，经济受出口承压和地产政策趋严等影响或面临一定下行压力。降准表明政府关注经济增长相对比重提升，“跨周期调节”促使政策提前。虽然海外央行政策将引发影响，但国内货币政策仍将以我为主，因此预计未来一段时间货币政策将保持中性偏宽松的基调。政治局会议提出“积极的财政政策要合理把握预算内投资和地方政府债券发行进度，推动今年底明年初形成实物工作量”，财政政策将有所发力，但考虑到合理把握地方债发行进度，稳健的货币政策要保持流动性合理充裕，因此影响可能相对平稳。债市而言，一方面房地产和城投信贷管控，结构性欠配仍然存在。另一方面，债券收益率降准后下行较快，整体收益率相对较低，与2020年疫情低点空间缩窄，因此债市将更加震荡纠结。信用债方面，重点关注地方政府隐性债务的化解方向。

我们将继续勤勉尽责，力争为投资者获取稳定增长的收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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，本基金于2021年03月18日实施第一次利润分配，嘉合慧康A每10份基金份额派发红利0.100元，嘉合慧康C每10份基金份额派发红利0.100元，于2021年06月21日实施第二次利润分配，嘉合慧康A每10份基金份额派发红利0.080元，嘉合慧康C每10份基金份额派发红利0.080元。

#### 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”）在嘉合慧康63个月定期开放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《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合规守信、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，本基金共进行利润分配14,398.261832万元。

## 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：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

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	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,879,655.62	4,286,395.31
结算备付金		40,322,812.03	-
存出保证金		46,868.12	109,344.73
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		100,076,904.85	100,000,000.00
应收利息	6.4.7.5	248,014,854.41	147,882,018.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	11,912,708,701.80	10,953,803,933.94
资产总计		12,303,049,796.83	11,206,081,692.27
<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>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,164,575,813.99	3,064,607,275.11
应付证券清算款		100,056,803.28	100,089,424.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		994,765.85	1,022,630.87
应付托管费		331,588.60	340,876.96
应付销售服务费		0.60	0.62
应付交易费用	6.4.7.7	150,304.11	115,711.55
应交税费		-	-
应付利息		767,205.10	649,231.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	117,178.95	131,000.00
负债合计		4,266,993,660.48	3,166,956,150.83
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,999,034,344.33	7,999,034,343.79
未分配利润	6.4.7.10	37,021,792.02	40,091,197.65
所有者权益合计		8,036,056,136.35	8,039,125,541.44
负债和所有者权益总		12,303,049,796.83	11,206,081,692.27

计			
---	--	--	--

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.0046元，A类基金份额净值1.0046元，C类基金份额净值1.0036元，基金份额总额7,999,034,344.33份，其中A类基金份额7,999,027,675.31份，C类基金份额6,669.02份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		189,344,745.21
1. 利息收入		189,344,745.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	182,860.13
债券利息收入		189,161,885.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
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）		-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-



<b>减：二、费用</b>		48,431,532.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,994,520.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,998,173.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3.62
4. 交易费用	6.4.7.19	99.75
5. 利息支出		40,321,555.62
其中：卖出回购金融资产支出		40,321,555.62
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	117,178.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		140,913,212.69
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		140,913,212.69

注：由于本基金于2020年8月4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。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01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)	7,999,034,343.79	40,091,197.65	8,039,125,541.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	140,913,212.69	140,913,212.69
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)	0.54	-	0.54

其中：1. 基金申购款	0.54	-	0.54
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-143,982,618.32	-143,982,618.32
五、期末所有者权益（基金净值）	7,999,034,344.33	37,021,792.02	8,036,056,136.35

注：由于本基金于2020年8月4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。

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

嘉合慧康63个月定期开放债券型基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会下发的《关于准予嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]945号)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《嘉合慧康63个月定期开放债券型基金基金合同》发售,基金合同于2020年8月4日生效。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币7,999,034,343.71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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合慧康63个月定期开放债券型基金基金合同》和《嘉合慧康63个月定期开放债券型基金招募说明书》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,包括债券(国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具,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。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。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，本基金开放期开始前3个月、开放期以及开放期结束后的3个月内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。在开放期内，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为同期三年期银行定期存款基准利率(税后)+0.5%。

#### 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、2021年上半年度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。

##### 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。

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

#### 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

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后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；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同，但本基金同一基金份额类别内的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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下固定收益品种的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的在上海证券交易所、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》、《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）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	1,879,655.62
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	1,879,655.62

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

##### 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。

#### 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	788.16
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	18,145.30
应收债券利息	247,995,899.85
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	21.10
合计	248,014,854.41

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期债券	11,912,708,701.80
合计	11,912,708,701.80

注：本基金持有的持有至到期投资均为债券投资，其中持有交易所市场债券 2,288,715,790.19 元，持有银行间市场债券 9,623,992,911.61 元。于 2021 年 06 月 30 日，上述持有至到期投资无需计提减值准备。

#### 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	-
银行间市场应付交易费用	150,304.11
合计	150,304.11

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	117,178.95
合计	117,178.95

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 嘉合慧康63个月定开债券A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,999,027,675.13	7,999,027,675.13
本期申购	0.18	0.18
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,999,027,675.31	7,999,027,675.31

## 6.4.7.9.2 嘉合慧康63个月定开债券C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开债券C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,668.66	6,668.66
本期申购	0.36	0.36
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,669.02	6,669.02

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 嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开 债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,091,167.18	-	40,091,167.18
本期利润	140,913,098.94	-	140,913,098.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-143,982,498.30	-	-143,982,498.30
本期末	37,021,767.82	-	37,021,767.82

## 6.4.7.10.2 嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
---------------------------	-------	-------	---------

上年度末	30.47	-	30.47
本期利润	113.75	-	113.75
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-120.02	-	-120.02
本期末	24.20	-	24.20

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	43,547.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	138,875.40
其他	437.60
合计	182,860.13

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 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——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。

##### 6.4.7.14.2 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。

**6.4.7.14.3 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 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	99.75
合计	99.75

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
中债登	9,000.00
上清所	9,000.00
合计	117,178.95

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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
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01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,994,520.99
其中：支付销售机构的客户维护费	112,414.26

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%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01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,998,173.59



注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	1.81	1.81
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	1.81	1.81

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.1%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类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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

份额单位：份

嘉合慧康63个月定开债券A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,398,999,000.00	29.99%	2,398,999,000.00	29.99%
中航信托股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广东万和集团有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
上海慧弘实业集团有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
福建圣农控股集团有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
北京智勇仁信投资咨询有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

山东通汇 资本管理 有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
----------------------	------	-------	------	-------

## 嘉合慧康63个月定开债券C

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中航信托 股份有限 公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广东万和 集团有限 公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
上海慧弘 实业集团 有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
福建圣农 控股集团 有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
北京智勇 仁信投资 咨询有限 公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
山东通汇 资本管理 有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

## 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01月01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	1,879,655.62	43,547.13

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40,322,812.03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

嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021-03-18	2021-03-18	0.100	79,990,276.74	0.10	79,990,276.84	-
2	2021-06-21	2021-06-21	0.080	63,992,221.38	0.08	63,992,221.46	-
合计			0.180	143,982,498.12	0.18	143,982,498.30	-

嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
----	-------	-----	-------------	----------	-----------	----------	----

1	2021-03-18	2021-03-18	0.100	66.48	0.20	66.68	-
2	2021-06-21	2021-06-21	0.080	53.18	0.16	53.34	-
合计			0.180	119.66	0.36	120.02	-

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 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

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
150314	15进出14	2021-07-01	102.01	4,540,000	463,112,832.51
150314	15进出14	2021-07-02	102.01	1,020,000	104,047,376.47
150314	15进出14	2021-07-01	102.01	2,070,000	211,154,969.89
150314	15进出14	2021-07-01	102.01	4,130,000	421,289,867.46
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	2,160,000	207,061,911.87
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	2,160,000	207,061,911.87
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	2,230,000	213,772,251.60
200405	20农发05	2021-07-09	95.86	4,400,000	421,792,783.43
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	2,200,000	210,896,391.72
200405	20农发05	2021-07-05	95.86	4,310,000	413,165,203.77
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	550,000	52,724,097.93
200405	20农发05	2021-07-01	95.86	1,120,000	107,365,435.78
合计				30,890,000	3,033,445,034.30

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日止，本基金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 1,272,500,000.00 元，分别于2021年07月01日、07月02日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或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。

#### 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徽商银行股份有限公司，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度的证券，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发行的证券，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**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

#### **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。

#### **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及上年度末均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**

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。

#### **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及上年度末均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，包括债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单及其他货币市场工具。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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	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



## 嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021年 06月30 日							
资产							
银行存款	1,879,655.62	-	-	-	-	-	1,879,655.62
结算备付金	40,322,812.03	-	-	-	-	-	40,322,812.03
存出保证金	46,868.12	-	-	-	-	-	46,868.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	100,076,904.85	100,076,904.85
应收利息	-	-	-	-	-	248,014,854.41	248,014,854.41
其他资产	-	-	-	11,912,708,701.80	-	-	11,912,708,701.80
资产总计	42,249,335.77	-	-	11,912,708,701.80	-	348,091,759.26	12,303,049,796.83
负债							
卖出回购金融资产款	4,164,575,813.99	-	-	-	-	-	4,164,575,813.99
应付证券清算款	-	-	-	-	-	100,056,803.28	100,056,803.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	994,765.85	994,765.85
应付托管费	-	-	-	-	-	331,588.60	331,588.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.60	0.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	150,304.11	150,304.11
应付利息	-	-	-	-	-	767,205.10	767,205.10
其他负债	-	-	-	-	-	117,178.95	117,178.95
负债总计	4,164,575,813.99	-	-	-	-	102,417,846.49	4,266,993,660.48
利率敏感度缺口	-4,122,326,478.22	-	-	11,912,708,701.80	-	245,673,912.77	8,036,056,136.35
上年度末 2020年	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

12月31日							
资产							
银行存款	4,286,395.31	-	-	-	-	-	4,286,395.31
存出保证金	109,344.73	-	-	-	-	-	109,344.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	100,000,000.00	100,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	147,882,018.29	147,882,018.29
其他资产	-	-	-	10,953,803,933.94	-	-	10,953,803,933.94
资产总计	4,395,740.04	-	-	10,953,803,933.94	-	247,882,018.29	11,206,081,692.27
负债							
卖出回购金融资产款	3,064,607,275.11	-	-	-	-	-	3,064,607,275.11
应付证券清算款	-	-	-	-	-	100,089,424.65	100,089,424.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,022,630.87	1,022,630.87
应付托管费	-	-	-	-	-	340,876.96	340,876.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.62	0.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	115,711.55	115,711.55
应付利息	-	-	-	-	-	649,231.07	649,231.07
其他负债	-	-	-	-	-	131,000.00	131,000.00
负债总计	3,064,607,275.11	-	-	-	-	102,348,875.72	3,166,956,150.83
利率敏感度缺口	-3,060,211,535.07	-	-	10,953,803,933.94	-	145,533,142.57	8,039,125,541.44

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	上年度末 2020年12月31日
	市场利率平行下降25个基点	110,040,612.95	113,474,870.98
	市场利率平行上升25个基点	-110,040,612.95	-113,474,870.98

#### 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

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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06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0，属于第二层次的余额为人民币11,912,708,701.80元，属于第三层次的余额为0。（2020年12月31日，属于第一层次的余额为0，属于第二层次的余额为人民币10,953,803,933.94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)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与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。

## 6.4.14.1.1.2 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(2020年12月31日：无)。

## 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卖出回购金融资产、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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,912,708,701.80	96.83
	其中：债券	11,912,708,701.80	96.83
	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	42,202,467.65	0.34
8	其他各项资产	348,138,627.38	2.83

9	合计	12,303,049,796.83	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.2 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,912,708,701.80	148.24
	其中：政策性金融债	11,912,708,701.80	148.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,912,708,701.80	148.24

## 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	150314	15进出14	35,500,000	3,621,256,730.00	45.06
2	200405	20农发05	33,000,000	3,163,445,875.74	39.37
3	018017	国开2007	11,501,000	1,151,946,171.06	14.33
4	200315	20进出15	9,300,000	933,033,524.33	11.61
5	018083	农发2001	8,803,180	878,050,367.63	10.93

## 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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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，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，国家开发银行、中国进出口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。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	46,868.12
2	应收证券清算款	100,076,904.85
3	应收股利	-
4	应收利息	248,014,854.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,138,627.38

#### 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 慧康6 3个月 定开 债券A	142	56,331,180. 81	7,999,022,000. 00	100.0 0%	5,675.31	0.00%
嘉合 慧康6 3个月 定开 债券C	75	88.92	0.00	0.00%	6,669.02	100.0 0%
合计	217	36,861,909. 42	7,999,022,000. 00	100.0 0%	12,344.33	0.00%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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	嘉合慧康63个月定 开债券A	1,348.62	0.00%
	嘉合慧康63个月定 开债券C	870.26	13.05%
	合计	2,218.88	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	嘉合慧康63个月定 开债券A	0~10
	嘉合慧康63个月定 开债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	嘉合慧康63个月定 开债券A	0~10
	嘉合慧康63个月定 开债券C	0
	合计	0~10

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份额和C份额总量均在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合慧康63个月定开债 券A	嘉合慧康63个月定开债 券C
基金合同生效日(2020年08月04 日)基金份额总额	7,999,027,675.05	6,668.66
本报告期期初基金份额总额	7,999,027,675.13	6,668.66

本报告期基金总申购份额	0.18	0.36
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,999,027,675.31	6,669.02

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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
国元证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。

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	396,382,277.12	100.00%	28,230,041,000.00	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	嘉合基金管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性公告	《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	2021-01-22
2	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2020年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
3	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

4	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第一次分红公告	《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-17
5	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
6	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
7	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
8	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报告提示性公告	《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	2021-04-22
9	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
10	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第二次分红公告	《证券时报》、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

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	20210101 - 20210630	2,398,999,000.00	0.00	0.00	2,398,999,000.00	29.99%
	2	20210101 - 20210630	1,599,999,000.00	0.00	0.00	1,599,999,000.00	20.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持							

有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

## 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慧康63个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合慧康63个月定期开放债券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、基金托管人办公场所。

### 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