

# 江信洪福纯债债券型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:江信基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03月25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。

大华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7  |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                | 7  |
| 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 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9  |
| § 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.....             | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....        | 14 |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....      | 14 |
| § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 15 |
| § 6 审计报告.....                                | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 15 |
| § 7 年度财务报表.....                              | 17 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 17 |
| 7.2 利润表.....                                 | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 20 |
| 7.4 报表附注.....                                | 21 |
| § 8 投资组合报告.....                              | 45 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 45 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 46 |
| 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.....       | 46 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 46 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 46 |
| 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.....      | 47 |
| 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.....   | 47 |
| 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.....   | 47 |
| 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.....      | 47 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....          | 47 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 47 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 48 |
| § 9 基金份额持有人信息.....                      | 49 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 49 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 49 |
| 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情况.....   | 49 |
| § 10 开放式基金份额变动.....                     | 49 |
| § 11 重大事件揭示.....                        | 49 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 50 |
| 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.....   | 50 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 50 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 50 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 50 |
| 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.....      | 50 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 50 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 51 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 53 |
| 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..... | 53 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 53 |
| § 13 备查文件目录.....                        | 53 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 53 |
| 13.2 存放地点.....                          | 53 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 53 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金名称       | 江信洪福纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 江信洪福            |
| 基金主代码      | 003424          |
| 交易代码       | 003424          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2016年12月07日     |
| 基金管理人      | 江信基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 508,184,550.27份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 投资策略 | <p>本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济指标、货币政策与财政政策、商业银行信贷扩张、国际资本流动和其他影响短期资金供求状况等因素的分析，预判对未来利率市场变化情况。根据对未来利率市场变化的预判情况，分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征，并以此决定各类资产的配置比例和期限匹配。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>（1）久期策略</p> <p>本基金通过对影响市场利率的各种因素（如宏观经济状况、货币政策走向、资金供求情况等）的分析，判断市场利率变化趋势，以确定基金组合的久期目标。当预期未来市场利率水平下降时，本基金将通过增持剩余期限较长的债券等方式提高基金组合久期；当预期未来市场利率水平上升时，本基金将通过</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式缩短基金组合久期，以规避组合跌价风险。</p> <p>（2）期限结构配置策略</p> <p>本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型、梯形或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以最大限度避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。</p> <p>（3）类属配置策略</p> <p>类属配置是指债券组合中国债、金融债、企业债、公司债等不同债券投资品种之间的配置比例。</p> <p>本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。</p> <p>（4）个券选择策略</p> <p>本基金在个券选择上将安全性因素放在首位，优先选择高信用等级的债券品种，防范违约风险。其次，在具体的券种选择上，将根据拟合收益率曲线的实际情况，挖掘收益率明显偏高的券种，若发现该类券种主要由于市场波动原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格属于相对低估，本基金将重点关注此类低估品种，并选择收益率曲线上定价相对低估的期限段进行投资。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察，分析资产支持证券底层资产信用状况变化，并预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响情况，评估其内在价值进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债总财富（总值）指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 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      | 江信基金管理有限公司                    |                    | 中国光大银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名                            | 毛建宇                | 石立平                       |
|         | 联系电话                          | 010-57380902       | 010-63639180              |
|         | 电子邮箱                          | customer@jxfund.cn | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话  | 400-622-0583                  |                    | 95595                     |
| 传真      | 010-57380988                  |                    | 010-63639132              |
| 注册地址    | 北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A |                    | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址    | 北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A |                    | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 邮政编码    | 100086                        |                    | 100033                    |
| 法定代表人   | 孙桢礪                           |                    | 李晓鹏                       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                               |
|---------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》                        |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.jxfund.cn                 |
| 基金年度报告备置地点          | 北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                          |
|--------|------------------|-------------------------------|
| 会计师事务所 | 大华会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市海淀区西四环中路16号院7号楼8层          |
| 注册登记机构 | 江信基金管理有限公司       | 北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A |

## § 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 | 2021年         | 2020年         | 2019年         |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 18,681,134.35 | 24,506,051.40 | 23,395,996.13 |

|                      |                |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期利润                 | 26,745,503.25  | 17,966,584.87  | 25,339,560.81  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0528         | 0.0355         | 0.0500         |
| 本期加权平均净值利润率          | 4.89%          | 3.37%          | 4.84%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 5.00%          | 3.37%          | 4.95%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2021年末         | 2020年末         | 2019年末         |
| 期末可供分配利润             | 50,454,365.19  | 28,200,690.64  | 27,378,423.69  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0993         | 0.0557         | 0.0540         |
| 期末基金资产净值             | 563,310,841.52 | 534,743,733.46 | 537,050,672.95 |
| 期末基金份额净值             | 1.1085         | 1.0557         | 1.0602         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2021年末         | 2020年末         | 2019年末         |
| 基金份额累计净值增长率          | 25.22%         | 19.26%         | 15.37%         |

### 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

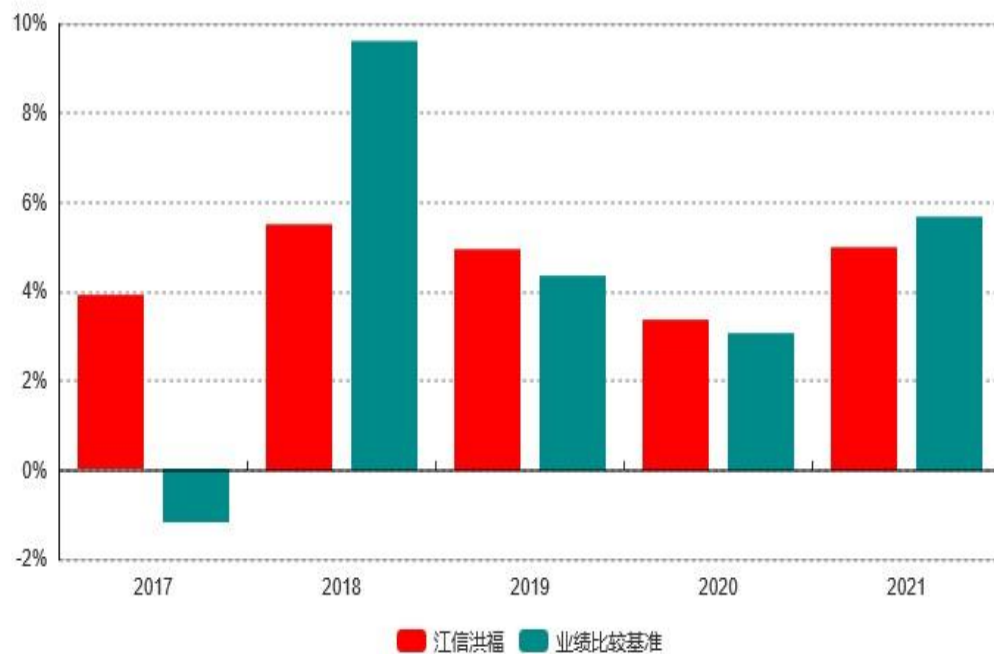
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.28%        | 0.02%               | 1.48%              | 0.08%                     | -0.20% | -0.06% |
| 过去六个月          | 2.94%        | 0.03%               | 3.53%              | 0.09%                     | -0.59% | -0.06% |
| 过去一年           | 5.00%        | 0.03%               | 5.69%              | 0.08%                     | -0.69% | -0.05% |
| 过去三年           | 13.91%       | 0.05%               | 13.68%             | 0.11%                     | 0.23%  | -0.06% |
| 过去五年           | 24.86%       | 0.05%               | 23.15%             | 0.11%                     | 1.71%  | -0.06% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 25.22%       | 0.05%               | 22.70%             | 0.11%                     | 2.52%  | -0.06% |

#### 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

江信洪福纯债债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月07日-2021年12月31日)



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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|-------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2020年 | 0.400       | 20,280,358.29 | 5,589.01  | 20,285,947.30 | -  |
| 合计    | 0.400       | 20,280,358.29 | 5,589.01  | 20,285,947.30 | -  |

## § 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

江信基金管理有限公司是2012年12月经中国证监会（证监基字[2012]1717号文）批准设立的基金管理公司，注册资本1.8亿元人民币，股东为：国盛证券有限责任公司、安徽恒生阳光控股有限公司、金麒麟投资有限公司、鹰潭红石投资管理有限合伙企业、鹰潭聚福投资管理有限合伙企业。目前，各家持股比例分别为：30%、17.5%、17.5%、17.5%、17.5%。公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2021年12月31日，本基金管理人管理的开放式基金为：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、江信祺福债券型证券投资基金、江信添福债券型证券投资基金、江信洪福纯债债券型证券投资基金、江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信一年定期开放债券型证券投资基金、江信增利货币市场基金。同时，公司还管理着多个资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                    | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                 |
|----|-----------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                       | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                    |
| 杨淳 | 公司固定收益投资总监助理、本基金的基金经理 | 2016-12-07      | -    | 14年    | 杨淳先生，金融学硕士，曾先后就职于北京天相投资顾问有限公司任行业研究员、中金瑞盈资产管理有限公司任证券分析师、国盛证券有限责任公司研究所任证券分析师、江信基金管理有 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 限公司任研究部固定收益研究员，现任江信基金管理有限公司固定收益投资副总监，并担任江信添福债券型证券投资基金、江信洪福纯债债券型证券投资基金、江信一年定期开放债券型证券投资基金、江信增利货币市场基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|

(1) 任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期或基金成立日期填写；

(2) 证券从业年限的计算标准及含义遵从《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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 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

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理办法》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和资产管理计划的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

公司建立了科学的投资决策体系，不断完善投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各基金经理的投资权限。加强交易执行环节的内部控制，实行集中交易制度，交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，系统强制启动公平交易程序。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，以保证公司管理的不同投资组合获得公平对待，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理办法》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和特定客户资产管理组合的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人通过不断完善研究方法和投资决策流程，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合享有公平的投资决策机会；公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离的原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；公司不断加强对投资交易行为的监察稽核力度，确保做好对公平交易各环节的监控和分析评估工作。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年全年债券市场收益率整体震荡下行。2021 年初市场预期疫情缓和并将走上复苏的道路，对货币政策放松空间存在疑虑。1 月末，资金面的紧张使市场认为货币政策可能转向，2-3 月份债券收益率逐步走高，创出年内高点。3 月跨季资金面维持宽松，宏观经济数据方面虽然出口，工业生产较好，而消费低迷，基建和投资相对较弱。在政策的影响下，房地产和城投的融资偏弱，市场欠配的力量逐步带动债券收益率逐步下行。7 月央行年内第一次降准，扫除了市场关于货币政策转向的担忧，市场债券收益率快速下行。9-10 月份大宗商品的价格上涨对市场产生暂时性的扰动，而房地产行业接连的违约事件，导致整个房地产产业链均受到影响，市场预期宏观经济承压，从而预期货币政策进一步宽松，12 月央行年内第二次降准后，市场预期央行会再次降息，债券收益率再次下行，年终收于年内低点。全年银行间 7 天逆回购（R007）收益率均值为 2.33，基本在政策性利率附近，货币政策全年保持宽松趋势，债券收益率全面下行，2021 年末 1 年期国债曲线收益率为 2.24，较年初下行 23BP，10 年期国债曲线收益率为 2.78，较年初下行 36BP。

报告期内，本基金重点配置高评级信用债及政策性金融债，保持投资组合合理且稳定的

的久期水平，同时通过利率交易策略增强收益。本基金未来在控制信用风险的基础上，注重投资组合的流动性和收益性，重点配置 3 年以内的金融债为主，控制投资组合的杠杆率和久期，争取获得超越业绩比较基准的收益水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信洪福基金份额净值为1.1085元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.00%，同期业绩比较基准收益率为5.69%。

#### 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 2022 年，从金融数据看，总量方面已经初见成效，结构方面仍待优化，上半年货币政策有望维持宽松的态势，重点关注信贷投放的可持续性，房地产的销售情况是否会好转以带动房地产投资企稳，同时关注基础建设投资对经济的托底作用。海外通胀压力较高，二季度欧美主要国家均存在加息的预期，如加息的幅度或者节奏超预期，可能对我国的货币政策产生溢出效应，同时下半年国内通胀压力预计将高于上半年，因此我们预计 2022 年上半年可以对债券市场保持相对的乐观，下半年则存在一定的扰动因素。整体看信用风险整体依然处于上行阶段，重点关注高评级信用债，利率债方面长端要注意利差保护，控制好投资组合久期和杠杆水平。

#### 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，本基金管理人进一步完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。按照法律法规的要求，认真做好基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。同时定期不定期地组织合规培训，进一步加强对员工的合规教育。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 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，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会负责人为公司总经理，成员包括投资管理总部、运营保障总部、研究发展部、风控稽核总部、证券交易部等部门的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值

的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，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，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 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

截止本报告期末，本基金运作正常，无需预警说明。

### § 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，中国光大银行股份有限公司在江信洪福纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金

份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《江信洪福纯债债券型证券投资基金2021年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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     | 大华审字[2022]004478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   | 江信洪福纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                           |
| 审计意见      | 我们审计了后附的江信洪福纯债债券型证券投资基金(以下简称江信洪福基金)财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表，以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了江信洪福基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于江信洪福基金，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            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 其他事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 其他信息            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 江信洪福基金管理层负责按照企业会计准则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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。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：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。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。3. 评价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。4. 对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，就可能导致对江信洪福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告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江信洪福基金不能持续经营。5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。6. 就江信洪福基金中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表意见。我们负责指导、监督和执行集团审计。我们对审</p> |

|           |                                                                                                                                     |    |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | 计意见承担全部责任。我们与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。我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项。 |    |
| 会计师事务所的名称 | 大华会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                    |    |
| 注册会计师的姓名  | 陈静                                                                                                                                  | 孟琪 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市海淀区西四环中路16号院7号楼8层                                                                                                                |    |
| 审计报告日期    | 2022-03-25                                                                                                                          |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：江信洪福纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 987,728.98         | 318,208.21          |
| 结算备付金      |         | 967,746.24         | 2,394,001.18        |
| 存出保证金      |         | 5,386.67           | 1,510.18            |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 487,505,000.00     | 676,139,181.60      |
| 其中：股票投资    |         | —                  | —                   |
| 基金投资       |         | —                  | —                   |
| 债券投资       |         | 487,505,000.00     | 676,139,181.60      |
| 资产支持证券投资   |         | —                  | —                   |
| 贵金属投资      |         | —                  | —                   |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | —                  | —                   |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | 90,900,405.00      | 19,600,149.40       |
| 应收证券清算款    |         | —                  | 925,985.26          |
| 应收利息       | 7.4.7.5 | 12,729,611.19      | 13,018,460.41       |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 593,095,878.08             | 712,397,496.24              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 29,400,000.00              | 177,000,649.32              |
| 应付证券清算款         |            | 20,781.29                  | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 143,067.88                 | 135,169.84                  |
| 应付托管费           |            | 47,689.29                  | 45,056.61                   |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 1,430.00                   | 5,535.99                    |
| 应交税费            |            | 42,458.74                  | 15,182.71                   |
| 应付利息            |            | -10,390.64                 | 312,168.31                  |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 140,000.00                 | 140,000.00                  |
| 负债合计            |            | 29,785,036.56              | 177,653,762.78              |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 508,184,550.27             | 506,543,042.82              |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 55,126,291.25              | 28,200,690.64               |
| 所有者权益合计         |            | 563,310,841.52             | 534,743,733.46              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 593,095,878.08             | 712,397,496.24              |

## 7.2 利润表

会计主体：江信洪福纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年12月31日 |
|------------------------|------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | 30,612,127.43                     | 23,330,776.16                          |
| 1. 利息收入                |            | 24,716,433.62                     | 23,949,526.05                          |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 40,984.57                         | 57,759.34                              |
| 债券利息收入                 |            | 24,017,290.76                     | 22,573,382.14                          |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                 | 645,140.73                             |
| 买入返售金融资产收入             |            | 658,158.29                        | 673,243.84                             |
| 其他利息收入                 |            | -                                 | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -2,168,802.20                     | 5,920,389.17                           |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.4    | -2,168,802.20                     | 5,911,363.63                           |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.14.3 | -                                 | 9,025.54                               |
| 收益                     |            |                                   |                                        |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -                                 | -                                      |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | -                                 | -                                      |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | 8,064,368.90                      | -6,539,466.53                          |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                 | -                                      |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 127.11                            | 327.47                                 |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 3,866,624.18                      | 5,364,191.29                           |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2.1 | 1,640,125.99  | 1,601,287.94  |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 546,708.61    | 533,762.71    |
| 3. 销售服务费            |            | -             | -             |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.20   | 16,000.06     | 24,286.77     |
| 5. 利息支出             |            | 1,439,338.58  | 3,009,568.76  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 1,439,338.58  | 3,009,568.76  |
| 6. 税金及附加            |            | 39,250.94     | 14,585.11     |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.21   | 185,200.00    | 180,700.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 26,745,503.25 | 17,966,584.87 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 26,745,503.25 | 17,966,584.87 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：江信洪福纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31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）                   | 506,543,042.82                | 28,200,690.64 | 534,743,733.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                             | 26,745,503.25 | 26,745,503.25  |
| 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） | 1,641,507.45                  | 180,097.36    | 1,821,604.81   |
| 其中：1. 基金申购款                       | 2,258,396.82                  | 232,613.85    | 2,491,010.67   |
| 2. 基金赎回款                          | -616,889.37                   | -52,516.49    | -669,405.86    |

|                                        |                                    |                |                |
|----------------------------------------|------------------------------------|----------------|----------------|
| 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）                        | 508,184,550.27                     | 55,126,291.25  | 563,310,841.52 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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）                        | 506,557,817.59                     | 30,492,855.36  | 537,050,672.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                  | 17,966,584.87  | 17,966,584.87  |
| 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）      | -14,774.77                         | 27,197.71      | 12,422.94      |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,425,403.58                       | 96,411.20      | 1,521,814.78   |
| 2. 基金赎回款                               | -1,440,178.35                      | -69,213.49     | -1,509,391.84  |
| 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） | -                                  | -20,285,947.30 | -20,285,947.30 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 506,543,042.82                     | 28,200,690.64  | 534,743,733.46 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

初英

付明

刘健菲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

江信洪福纯债债券型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2016]2150号文《关于准予江信洪福纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由江信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《江信洪福纯债债券型证券投资基金基金合同》负责在2016年11月28日至2016年12月2日公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)验资,首次募集的净认购金额为 200,204,102.98 元人民币,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 16,005.00 元人民币。上述资金已于 2016 年 12 月 6 日全额划入本基金在基金托管人中国光大银行股份有限公司开立的基金托管专户。根据《基金法》、《运作办法》以及基金合同、招募说明书、基金份额发售公告的有关规定,本基金募集结果符合有关条件,本基金管理人于 2016 年 12 月 7 日向中国证监会办理完毕基金备案手续并已获书面确认,基金合同自该日期正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

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国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、政府支持机构债、地方政府债、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等金融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,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券和可交换债券。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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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:中债总财富(总值)指数收益率。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

本财务报表由本基金的基金管理人江信基金管理有限公司于 2021 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》和具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《江信洪福纯债债券型证券投资基金合同》和在财务报表附注列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

###### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算

时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 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。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。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。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期未发生外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 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，本基金确定以下类别股票及债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)在交易所上市的有价证券（包括股票、可转换债券、权证等），根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，以收盘价估值，上市债券以收盘净价估值，期货合约以结算价格估值。交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。本基金以其估值日在

证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价；交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括资产支持债券等），采用估值技术确定公允价值。如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

（2）在交易所发行的未上市品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，首次发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按本文附件确定公允价值。本基金分为以下几类进行估值：

1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4）已经发行未上市期间的债券按以下原则处理：①交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。②对银行间市场未上市，且第三方未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用成本估值。③分离交易可转债，上市日前，按未上市有价证券估值原则分别对债券和获配的权证进行估值；自上市日起，债券和获配的权证按上市有价证券估值原则进行估值。

（3）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采

用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

(4) 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 987,728.98         | 318,208.21          |
| 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           | 987,728.98         | 318,208.21          |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021年12月31日  |                |              |
|---------------|-------|---------------------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                   | -              | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 111,262,790.00      | 111,229,000.00 | -33,790.00   |
|               | 银行间市场 | 371,579,500.00      | 376,276,000.00 | 4,696,500.00 |
|               | 合计    | 482,842,290.00      | 487,505,000.00 | 4,662,710.00 |
| 资产支持证券        |       | -                   | -              | -            |
| 基金            |       | -                   | -              | -            |
| 其他            |       | -                   | -              | -            |
| 合计            |       | 482,842,290.00      | 487,505,000.00 | 4,662,710.00 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2020年12月31日 |                |              |
|               |       | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                   | -              | -            |
| 贵金属投资-金交所黄    |       | -                   | -              | -            |

|        |       |                |                |               |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
| 金合约    |       |                |                |               |
| 债券     | 交易所市场 | 221,443,897.84 | 221,073,181.60 | -370,716.24   |
|        | 银行间市场 | 458,096,942.66 | 455,066,000.00 | -3,030,942.66 |
|        | 合计    | 679,540,840.50 | 676,139,181.60 | -3,401,658.90 |
| 资产支持证券 |       | -              | -              | -             |
| 基金     |       | -              | -              | -             |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 679,540,840.50 | 676,139,181.60 | -3,401,658.90 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 60,900,000.00       | -         |
| 银行间市场 | 30,000,405.00       | -         |
| 合计    | 90,900,405.00       | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 19,600,149.40       | -         |
| 合计    | 19,600,149.40       | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 267.85             | 607.90              |
| 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  | 479.05             | 1,185.03            |
| 应收债券利息     | 12,620,830.14      | 13,012,950.49       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  | -                   |
| 应收买入返售证券利息 | 108,031.51         | 3,716.22            |
| 应收申购款利息    | -                  | -                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 其他         | 2.64               | 0.77                |
| 合计         | 12,729,611.19      | 13,018,460.41       |

本报告期末“其他”项为结算保证金利息。

#### 7.4.7.6其他资产

本报告期末，本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,430.00           | 5,535.99            |
| 合计          | 1,430.00           | 5,535.99            |

#### 7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |

|       |            |            |
|-------|------------|------------|
| 应付赎回费 | -          | -          |
| 预提费用  | 140,000.00 | 140,000.00 |
| 合计    | 140,000.00 | 140,000.00 |

## 7.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |                |
|---------------|-------------------------|----------------|
|               | 2021年01月01日至2021年12月31日 |                |
|               | 基金份额（份）                 | 账面金额           |
| 上年度末          | 506,543,042.82          | 506,543,042.82 |
| 本期申购          | 2,258,396.82            | 2,258,396.82   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -616,889.37             | -616,889.37    |
| 本期末           | 508,184,550.27          | 508,184,550.27 |

申购含红利再投份额。

## 7.4.7.10未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 31,610,362.54 | -3,409,671.90 | 28,200,690.64 |
| 本期利润           | 18,681,134.35 | 8,064,368.90  | 26,745,503.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 162,868.30    | 17,229.06     | 180,097.36    |
| 其中：基金申购款       | 214,199.58    | 18,414.27     | 232,613.85    |
| 基金赎回款          | -51,331.28    | -1,185.21     | -52,516.49    |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 50,454,365.19 | 4,671,926.06  | 55,126,291.25 |

## 7.4.7.11存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----|-------------------------|-------------------------|
|    | 2021年01月01日至2021年12月31日 | 2020年01月01日至2020年12月31日 |

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 16,305.55 | 23,986.23 |
| 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 | 24,567.43 | 33,679.39 |
| 其他        | 111.59    | 93.72     |
| 合计        | 40,984.57 | 57,759.34 |

本报告期内“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期本基金无股票投资收益。

#### 7.4.7.13基金投资收益

本报告期本基金无基金投资收益。

#### 7.4.7.14债券投资收益

##### 7.4.7.14.1债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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 | -2,168,802.20                 | 5,911,363.63                       |
| 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                            | -2,168,802.20                 | 5,911,363.63                       |

##### 7.4.7.14.2债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|-----------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,081,343,145.02              | 1,383,002,241.90                   |

|                         |                  |                  |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,064,594,574.10 | 1,353,833,299.27 |
| 减：应收利息总额                | 18,917,373.12    | 23,257,579.00    |
| 买卖债券差价收入                | -2,168,802.20    | 5,911,363.63     |

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | -                             | 22,889,100.00                      |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | -                             | 21,994,160.00                      |
| 减：应收利息总额       | -                             | 885,914.46                         |
| 资产支持证券投资收益     | -                             | 9,025.54                           |

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17股利收益

本报告期本基金无股利收益。

#### 7.4.7.18公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                           | 本期<br>2021年01月01日至2021年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12<br>月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                     | 8,064,368.90                      | -6,539,466.53                          |
| ——股票投资                         | -                                 | -                                      |
| ——债券投资                         | 8,064,368.90                      | -6,539,466.53                          |
| ——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<br>价值变动产生的预估增<br>值税 | -                                 | -                                      |
| 合计                             | 8,064,368.90                      | -6,539,466.53                          |

注：其他项为股指期货多头公允价值变动

#### 7.4.7.19其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 127.11                            | 327.47                                 |
| 合计      | 127.11                            | 327.47                                 |

## 7.4.7.20交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,100.06                          | 781.77                                 |
| 银行间市场交易费用 | 14,900.00                         | 23,505.00                              |
| 合计        | 16,000.06                         | 24,286.77                              |

## 7.4.7.21其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 审计费用      | 60,000.00                         | 60,000.00                              |
| 信息披露费     | 80,000.00                         | 80,000.00                              |
| 帐户维护费     | 36,000.00                         | 36,000.00                              |
| 跨市场转托管手续费 | 8,000.00                          | 3,500.00                               |
| 其他费用      | 1,200.00                          | 1,200.00                               |
| 合计        | 185,200.00                        | 180,700.00                             |

## 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

截止资产负债表日，本基金无重大或有事项。

## 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报告日止，本公司无应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9关联方关系

本报告期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。

| 关联方名称      | 与本基金的关系      |
|------------|--------------|
| 国盛证券有限责任公司 | 本基金管理人股东。    |
| 江信基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |

|              |              |
|--------------|--------------|
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
|--------------|--------------|

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本期本基金无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,640,125.99                  | 1,601,287.94                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 456.54                        | 737.36                             |

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|----|-------------------------------|------------------------------------|
|----|-------------------------------|------------------------------------|

|                |            |            |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 546,708.61 | 533,762.71 |
|----------------|------------|------------|

注：基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提，基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

#### 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

本报告期，本基金无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |           |
|--------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 中国光大银行股份有限公司 | 987,728.98                    | 16,305.55 | 318,208.21                         | 23,986.23 |

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11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

本报告期本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021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

本期末本基金未因认购新发/增发而持有流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末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

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021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29,400,000.00元，于2022年1月4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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人风险管理组织体系由三级构成：第一级次为董事会层面的合规与风险管理委员会、督察长；第二级次为经营层面的总经理、风险控制委员会、风控稽核总部；第三级次为公司各业务部门对各自部门的风险控制负责。

本基金的基金管理人主要采取定量和定性相结合的方法。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人风险管理组织体系由三级构成：第一级次为董事会层面的合规与风险管理委员会、督察长；第二级次为经营层面的总经理、风险控制委员会、风控稽核总部；第三级次为公司各业务部门对各自部门的风险控制负责。

本基金的基金管理人主要采取定量和定性相结合的方法。

#### 7.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制信用风险。通过内部信用评级制度，结合外部信用评级，进行信用风险管理；根据交易对手的资质、交易记录、信用记录和交收违约记录等因素对交易对手进行信用评级。

于2021年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为75.73%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 121,442,000.00     | 177,993,600.00      |
| AAA以下  | 305,177,000.00     | 120,520,000.00      |
| 未评级    | 0.00               | —                   |
| 合计     | 426,619,000.00     | 298,513,600.00      |

长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中无国债、政策性金融债及央行票据等。

##### 7.4.13.2.3按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | 19,606,000.00       |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | -                  | 19,606,000.00       |

#### 7.4.13.3流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放期内投资人的连续大量赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

##### 7.4.13.3.1报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在开放期内为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的10%。因此除附注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，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

截至本报告期末，除卖出回购金融资产款余额中有29,400,000.00元将在1个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一

个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是由于市场条件（包括但不限于利率、汇率、股票价格和商品价格等因素）发生不利变化，给公司或客户投资带来损失的风险。其中利率水平的变动，将直接影响到基金拟投资债券、利率及债券衍生品等投资品种的价格波动，进而影响基金的收益水平。股票、商品的市场价格变化，将直接作用于股票及股票衍生金融工具、商品及商品衍生工具的市场价格。而当所投资基金在持有的资产组合或金融工具暴露于某外汇币种的情形下，将会可能受到外汇价格变化导致的折价损失，即汇率风险。

##### 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。

本基金部分投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年12月31日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计             |
|--------------------|----------------|------|------|---------------|----------------|
| 资产                 |                |      |      |               |                |
| 银行存款               | 987,728.98     | -    | -    | -             | 987,728.98     |
| 结算备付金              | 967,746.24     | -    | -    | -             | 967,746.24     |
| 存出保证金              | 5,386.67       | -    | -    | -             | 5,386.67       |
| 交易性金融资产            | 487,505,000.00 | -    | -    | -             | 487,505,000.00 |
| 买入返售金融资产           | 90,900,405.00  | -    | -    | -             | 90,900,405.00  |
| 应收利息               | -              | -    | -    | 12,729,611.19 | 12,729,611.19  |
| 资产总计               | 580,366,266.89 | 0.00 | 0.00 | 12,729,611.19 | 593,095,878.08 |
| 负债                 |                |      |      |               |                |
| 卖出回购金融资产款          | 29,400,000.00  | -    | -    | -             | 29,400,000.00  |
| 应付证券清算款            | -              | -    | -    | 20,781.29     | 20,781.29      |
| 应付管理人报酬            | -              | -    | -    | 143,067.88    | 143,067.88     |
| 应付托管费              | -              | -    | -    | 47,689.29     | 47,689.29      |
| 应付交易费用             | -              | -    | -    | 1,430.00      | 1,430.00       |
| 应交税费               | -              | -    | -    | 42,458.74     | 42,458.74      |

|                     |                |                |                |               |                |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 应付利息                | -              | -              | -              | -10,390.64    | -10,390.64     |
| 其他负债                | -              | -              | -              | 140,000.00    | 140,000.00     |
| 负债总计                | 29,400,000.00  | -              | -              | 385,036.56    | 29,785,036.56  |
| 利率敏感度缺口             | 173,957,266.89 | 377,009,000.00 | 0.00           | 12,344,574.63 | 563,310,841.52 |
| 上年度末<br>2020年12月31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上           | 不计息           | 合计             |
| 资产                  |                |                |                |               |                |
| 银行存款                | 318,208.21     | -              | -              | -             | 318,208.21     |
| 结算备付金               | 2,394,001.18   | -              | -              | -             | 2,394,001.18   |
| 存出保证金               | 1,510.18       | -              | -              | -             | 1,510.18       |
| 交易性金融资产             | 147,980,600.00 | 285,253,500.00 | 242,905,081.60 | -             | 676,139,181.60 |
| 买入返售金融资产            | 19,600,149.40  | -              | -              | -             | 19,600,149.40  |
| 应收证券清算款             | -              | -              | -              | 925,985.26    | 925,985.26     |
| 应收利息                | -              | -              | -              | 13,018,460.41 | 13,018,460.41  |
| 资产总计                | 170,294,468.97 | 285,253,500.00 | 242,905,081.60 | 13,944,445.67 | 712,397,496.24 |
| 负债                  |                |                |                |               |                |
| 卖出回购金融资产款           | 177,000,649.32 | -              | -              | -             | 177,000,649.32 |
| 应付管理人报酬             | -              | -              | -              | 135,169.84    | 135,169.84     |
| 应付托管费               | -              | -              | -              | 45,056.61     | 45,056.61      |
| 应付交易费用              | -              | -              | -              | 5,535.99      | 5,535.99       |
| 应交税费                | -              | -              | -              | 15,182.71     | 15,182.71      |
| 应付利息                | -              | -              | -              | 312,168.31    | 312,168.31     |
| 其他负债                | -              | -              | -              | 140,000.00    | 140,000.00     |
| 负债总计                | 177,000,649.32 | -              | -              | 653,113.46    | 177,653,762.78 |
| 利率敏感度缺口             | -6,706,180.35  | 285,253,500.00 | 242,905,081.60 | 13,291,332.21 | 534,743,733.46 |

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

#### 7.4.13.4.1.2利率风险的敏感性分析

| 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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2021年12月31日              | 上年度末<br>2020年12月31日 |

|  |               |               |               |
|--|---------------|---------------|---------------|
|  | 市场利率上升25.00bp | -2,501,862.12 | -5,523,919.21 |
|  | 市场利率下降25.00bp | 2,526,105.62  | 5,606,635.97  |

#### 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。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，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不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他价格风险敞口。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2021年12月31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，属于第二层级的余额为487,505,000.00元，无属于第一层级、第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本报告期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | —              | —             |
|    | 其中：股票             | —              | —             |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 487,505,000.00 | 82.20         |
|    | 其中：债券             | 487,505,000.00 | 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          | 90,900,405.00  | 15.33         |
|    | 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      | 1,955,475.22   | 0.33          |
| 8  | 其他各项资产            | 12,734,997.86  | 2.15          |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 593,095,878.08 | 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

本期末，本基金未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本期末，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

本期末，本基金未持有股票。

## 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

本期末，本基金未持有股票。

### 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

本期末，本基金未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本期末，本基金未持有股票。

## 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      | 40,004,000.00  | 7.10         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 172,492,000.00 | 30.62        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,882,000.00  | 3.71         |
| 4  | 企业债券      | 214,352,000.00 | 38.05        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 60,657,000.00  | 10.77        |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -            |

|    |      |                |       |
|----|------|----------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -              | -     |
| 9  | 其他   | -              | -     |
| 10 | 合计   | 487,505,000.00 | 86.54 |

#### 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  | 2180083   | 21家庐陵债      | 500,000 | 51,740,000.00 | 9.18         |
| 2  | 2180180   | 21合盛债01     | 500,000 | 50,935,000.00 | 9.04         |
| 3  | 102000572 | 20新庐陵MTN001 | 500,000 | 50,525,000.00 | 8.97         |
| 4  | 152149    | 19井冈债       | 400,000 | 40,700,000.00 | 7.23         |
| 5  | 1980295   | 19萍昌盛债      | 400,000 | 40,452,000.00 | 7.18         |

#### 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

本报告期本基金无资产支持证券投资。

#### 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

本期末本基金未持有贵金属。

#### 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

本期末本基金未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本期末本基金未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本期末本基金未持有股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本期末本基金未持有国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本期末本基金未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本期末本基金未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金持有的19交通银行02（代码：1928037.IB）的发行主体交通银行股份有限公司于2021年07月13日受到银保监会的行政处罚（银保监罚决字（2021）28号），于2021年08月13日受到中国人民银行的行政处罚（银罚字（2021）23号）。本报告期内，除上述证券外，本基金投资的前十名其他证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，本基金前十名股票中不存在投资于超出基金合同规定被选股票库之外的情形。

### 8.12.3 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   | 5,386.67      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 12,729,611.19 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,734,997.86 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(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 |
| 253      | 2,008,634.59 | 506,146,184.64 | 99.6%  | 2,038,365.63 | 0.4%   |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 62,762.81 | 0.01%    |

### 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情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年12月07日)基金份额总额 | 200,220,107.98 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 506,543,042.82 |
| 本报告期基金总申购份额                | 2,258,396.82   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 616,889.37     |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 508,184,550.27 |

## § 11 重大事件揭示

**11.1 基金份额持有人大会决议**

在本报告期内，本基金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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，本基金管理人于2021年5月聘任付明先生担任首席信息官职务。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金基金托管业务的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金于2021年6月改聘会计师事务所，由中喜会计师事务所（特殊普通合伙）变更为大华会计师事务所（特殊普通合伙），变更事项已经江信基金管理有限公司董事会审议通过，并按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

本基金聘请的大华会计师事务所（特殊普通合伙）为第一年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的审计费为人民币陆万（60,000.00）元整。

**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**

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**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 |    |
| 民族证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |

## 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     |                          | 基金交易     |                          |
|--------|----------------|--------------------------|----------------|--------------------------------|----------|--------------------------|----------|--------------------------|
|        | 成交金额           | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额           | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 | 成交<br>金额 | 占当期<br>权证成<br>交总额<br>的比例 | 成交金<br>额 | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例 |
| 民族证券   | -              | -                        | -              | -                              | -        | -                        | -        | -                        |
| 中银国际证券 | 97,330,843.00  | 27.32%                   | 941,300,000.00 | 28.61%                         | -        | -                        | -        | -                        |
| 长城证券   | -              | -                        | 291,500,000.00 | 8.86%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 广发证券   | 50,138,100.00  | 14.07%                   | 100,000.00     | 0.00%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 国盛证券   | 70,544,254.00  | 19.80%                   | 17,900,000.00  | 0.54%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 恒泰证券   | -              | -                        | 24,000,000.00  | 0.73%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 华西证券   | -              | -                        | 330,000,000.00 | 10.03%                         | -        | -                        | -        | -                        |
| 上海证券   | 102,612,312.70 | 28.80%                   | 808,100,000.00 | 24.56%                         | -        | -                        | -        | -                        |
| 中信建投证券 | 35,657,485.80  | 10.01%                   | 877,400,000.00 | 26.67%                         | -        | -                        | -        | -                        |

## 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  | 关于江信基金终止与北京电盈基金销售有限公司合作关系的公告 | 网站、证券日报 | 2021-01-12 |
| 2  | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2020年第四季度报告   | 网站      | 2021-01-20 |
| 3  | 江信基金2020年第四季度报告提示性公告         | 证券日报    | 2021-01-20 |
| 4  | 江信基金2020年年度报告提示性公告           | 证券日报    | 2021-03-29 |
| 5  | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2020年年度报告     | 网站      | 2021-03-31 |

|    |                                           |         |            |
|----|-------------------------------------------|---------|------------|
| 6  | 江信洪福2020年年度报告提示性公告                        | 证券日报    | 2021-03-31 |
| 7  | 江信洪福基金合同（2021年4月更新）                       | 网站      | 2021-04-16 |
| 8  | 江信洪福托管协议（2021年4月更新）                       | 网站      | 2021-04-16 |
| 9  | 江信基金管理有限公司关于旗下8只基金修改基金合同等法律文件的公告          | 网站、证券日报 | 2021-04-16 |
| 10 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金招募说明书更新（2021年第1号）          | 网站      | 2021-04-16 |
| 11 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（2021年第1次）       | 网站      | 2021-04-16 |
| 12 | 江信基金关于提醒投资者防范不法分子利用虚假的“江信app”进行诈骗活动的提示性公告 | 网站      | 2021-04-19 |
| 13 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2021年第一季度报告                | 网站      | 2021-04-20 |
| 14 | 江信基金管理有限公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告          | 证券日报    | 2021-04-20 |
| 15 | 江信基金管理有限公司关于以公司固有资金购买旗下基金风险资产的公告          | 网站、证券日报 | 2021-04-29 |
| 16 | 江信基金管理有限公司首席信息官变更公告                       | 网站、证券日报 | 2021-05-13 |
| 17 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金改聘会计师事务所公告                 | 网站、证券日报 | 2021-06-30 |
| 18 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2021年第二季度报告                | 网站      | 2021-07-20 |
| 19 | 江信基金2021年第二季度报告提示性公告                      | 证券日报    | 2021-07-20 |
| 20 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2021年中期报告                  | 网站      | 2021-08-27 |
| 21 | 江信基金2021年中期报告提示性公告                        | 证券日报    | 2021-08-27 |
| 22 | 江信洪福纯债债券型证券投资基金2021年第三季度报告                | 网站      | 2021-10-26 |
| 23 | 江信基金2021年第三季度报告提示性                        | 证券日报    | 2021-10-26 |

|  |    |  |  |
|--|----|--|--|
|  | 公告 |  |  |
|--|----|--|--|

## § 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              | 20210101-20211231      | 506,146,184.64 | 0.00 | 0.00 | 506,146,184.64 | 99.60% |
| 产品特有风险                                        |                |                        |                |      |      |                |        |
| 本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。 |                |                        |                |      |      |                |        |

### 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

- 1、《江信洪福纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《江信洪福纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《江信洪福纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.jxfund.cn>。

### 13.3查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

江信基金管理有限公司  
二〇二二年三月二十九日