

# 广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理 计划

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 3 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于 2019 年 10 月 31 日合同变更生效。本集合计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准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 1 月 1 日起至 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.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4	管理人报告.....	11
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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..	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 5	托管人报告.....	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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....	17
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.....	17
§ 6	审计报告.....	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	19
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注.....	24
§ 8	投资组合报告.....	49
8.1	期末基金资产组合情况.....	49
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	<b>错误!未定义书签。</b>
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.....	51
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	53
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	54
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	54

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	54
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
8.11	投资组合报告附注 .....	55
§ 9	基金份额持有人信息 .....	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	<b>错误!未定义书签。</b>
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 10	开放式基金份额变动 .....	57
§ 11	重大事件揭示 .....	58
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4	基金投资策略的改变 .....	58
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8	其他重大事件 .....	59
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
§ 13	备查文件目录 .....	61
13.1	备查文件目录 .....	61
13.2	存放地点 .....	61
13.3	查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	广发资管乾利一年持有期债券	
基金主代码	872003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 31 日	
基金管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,646,031,678.23 份	
基金合同存续期	自本集合计划合同变更生效之日起 3 年，期限届满后按照中国证监会有关规定执行	
下属分级基金的基金简称	广发资管乾利一年持有期 债券 A	广发资管乾利一年持有期 债券 C
下属分级基金的交易代码	870008	872014
报告期末下属分级基金的份额总额	564,924,153.90 份	1,081,107,524.33 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过管理人积极主动的投资管理，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。
投资策略	通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、股票、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，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	广发证券资产管理（广东）有限	中国银行股份有限公司

		公司	
信息披露 负责人	姓名	吴顺虎	许俊
	联系电话	020-66336029	010-66596688
	电子邮箱	xuyz@gf.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95575	95566
传真		020-87553363	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-285	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市天河区马场路26号 广发证券大厦30-32楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510075	100818
法定代表人		秦力	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfam.com.cn
基金年度报告备置地点	广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	广发证券资产管理（广东）有限公司	天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼

## § 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	2021 年	2020 年	2019 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31
------------------	--------	--------	---

标					日	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
本期已实现收益	41,760,581.24	124,768,016.95	41,114,762.05	161,817,726.38	3,455,498.75	4,659,959.76
本期利润	8,489,829.18	102,514,509.87	40,223,314.08	144,159,536.02	4,715,599.60	6,649,351.01
加权平均基金份额本期利润	0.0149	0.0458	0.0374	0.0301	0.0063	0.0052
本期加权平均净值利润率	1.37%	4.28%	3.63%	2.91%	0.63%	0.52%
本期基金份额净值增长率	2.76%	2.46%	3.82%	3.51%	0.49%	0.44%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
期末可供分配利润	43,710,809.60	76,198,776.44	24,270,522.68	215,210,503.78	10,578,477.14	16,563,339.68
期末可供分配基金份额利润	0.0774	0.0705	0.0485	0.0448	0.0099	0.0094
期末基金资产净值	608,634,963.50	1,157,306,300.77	525,043,354.64	5,016,323,945.05	1,083,449,470.17	1,773,327,705.52
期末基金份额净值	1.0774	1.0705	1.0485	1.0448	1.0099	1.0094
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
基金份额	7.21%	6.52%	4.33%	3.97%	0.49%	0.44%

额 累 计 净 值 增 长 率						
-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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损益。

（3）期末可供分配利润，为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

##### 广发资管乾利一年持有期债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.02%	0.31%	0.71%	0.09%	-3.73%	0.22%
过去六个月	-2.12%	0.35%	0.79%	0.11%	-2.91%	0.24%
过去一年	2.76%	0.28%	1.50%	0.13%	1.26%	0.15%
自基金合同生效起至今	7.21%	0.19%	5.66%	0.13%	1.55%	0.06%

##### 广发资管乾利一年持有期债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.10%	0.31%	0.71%	0.09%	-3.81%	0.22%
过去六个月	-2.26%	0.35%	0.79%	0.11%	-3.05%	0.24%
过去一年	2.46%	0.28%	1.50%	0.13%	0.96%	0.15%
自基金合同生效起至今	6.52%	0.19%	5.66%	0.13%	0.86%	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

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2019 年 10 月 31 日至 2021 年 12 月 31 日）

### 广发资管乾利一年持有期债券 A

(2019 年 10 月 31 日至 2021 年 12 月 31 日)



### 广发资管乾利一年持有期债券 C

(2019 年 10 月 31 日至 2021 年 12 月 31 日)

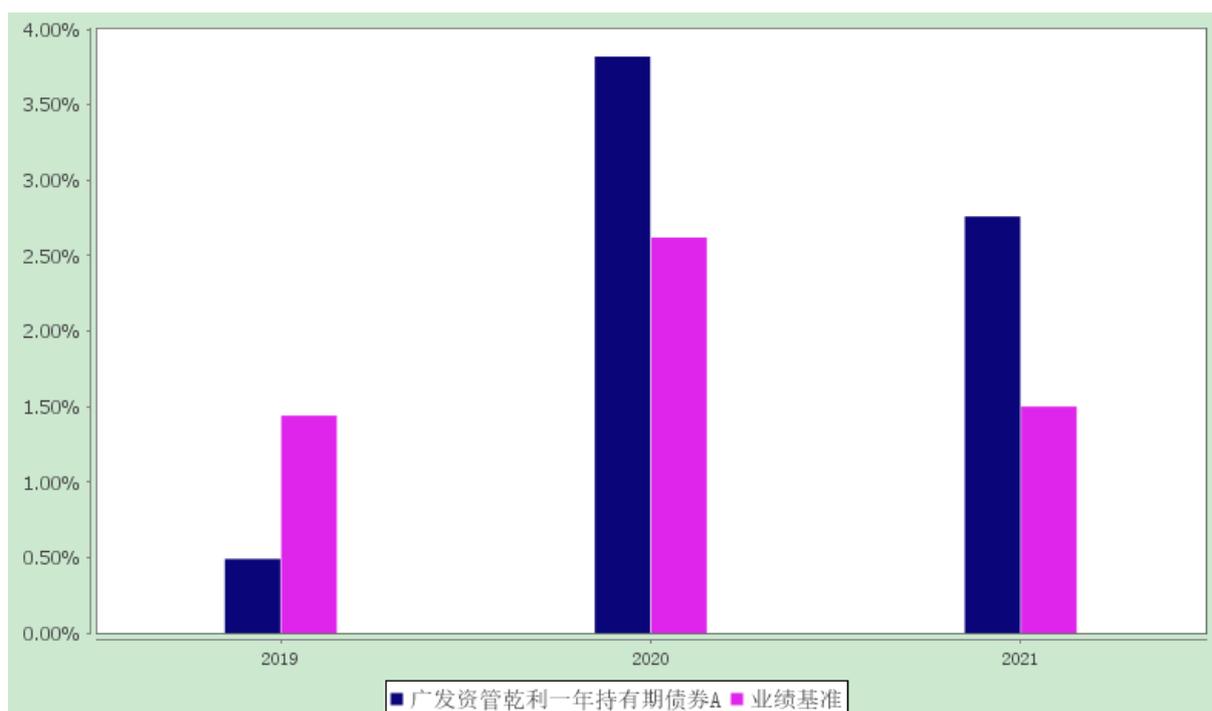


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

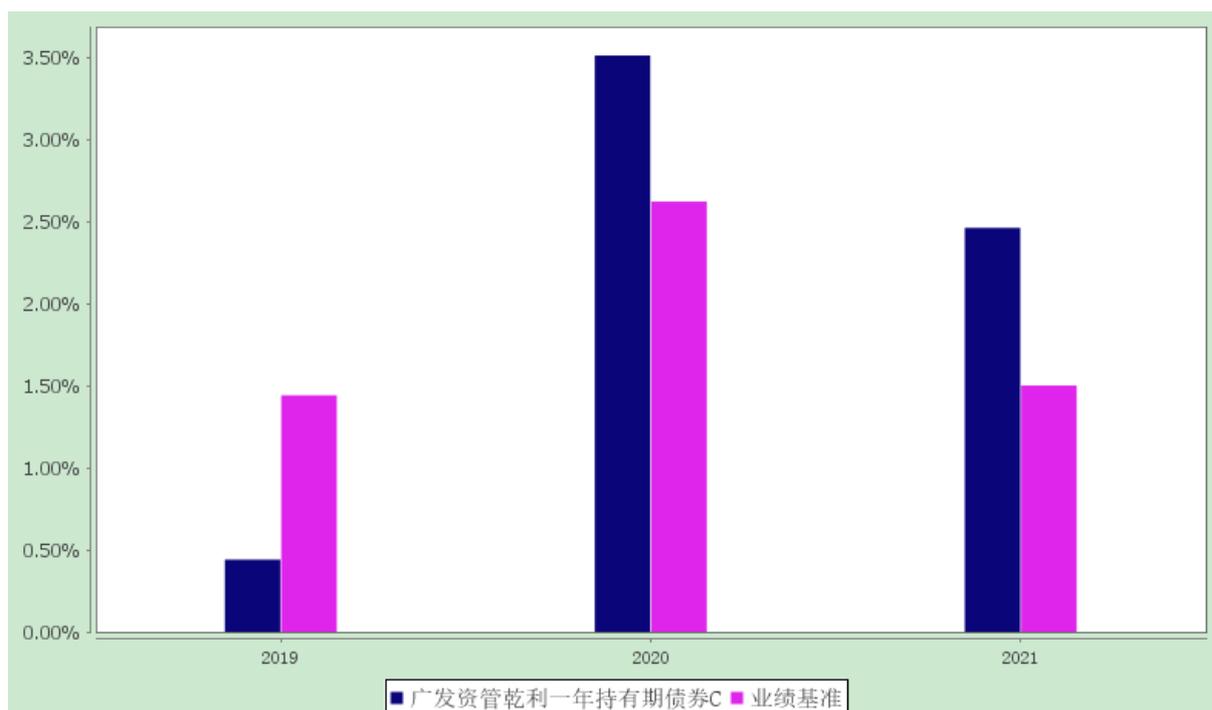
广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

### 广发资管乾利一年持有期债券 A



### 广发资管乾利一年持有期债券 C



注：本集合计划合同变更生效日为 2019 年 10 月 31 日，相关数据和指标按实际存续期计算，未按自然年度计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、广发资管乾利一年持有期债券 A

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
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年 10 月 31 日（合同变更生效日）至 2019 年 12 月 31 日	2.236	1,724,157.32	23,568.62	1,747,725.94	-
合计	2.236	1,724,157.32	23,568.62	1,747,725.94	-

2、广发资管乾利一年持有期债券 C

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
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年 10 月 31 日（合同变更生效日）至 2019 年 12 月 31 日	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 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

经中国证监会《关于核准广发证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2013〕1610 号）批准，广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“广发资管”）于 2014 年 1 月 2 日成立，系广发证券股份有限公司旗下全资子公司，全面承继了广发证券原资产管理部的相关业务，业务范围为证券资产管理业务。

广发资管始终秉持“知识图强，求实奉献；客户至上，合作共赢”的核心价值观，贯彻执行“稳健经营，持续创新；绩效导向，协同高效”的经营管理理念，以持续完善的全面风险管理体系、卓

越的投资管理能力及优质的客户服务水平，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，自成立以来始终是中国资本市场具有重要影响力的证券资产管理机构。广发资管具有证券资产管理业务经营许可、合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务（QDII）资格、中国银行间市场交易商协会会员资格、投资管理人受托管理保险资金资格等业务资格，透过集合资产管理计划（含大集合）、单一资产管理计划和专项资产管理计划在固定收益、主动权益、指数量化、海外投资、资产证券化等领域全面布局。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司资产管理总规模达到 4,932.44 亿元；其中，集合资产管理规模 3,525.61 亿元；单一资产管理规模 1,297.97 亿元。根据中国证券投资基金业协会的统计，公司私募主动管理资产月均规模（2021 年四季度）4,748.97 亿元，行业排名第三，公司各项指标稳定保持在券商资管的第一梯队。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日颁布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，并经中国证监会的批准，截至 2021 年 12 月 31 日，广发资管已有 8 只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。后续，广发资管将持续有其他大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
冯国生	本集合计划投资经理	2019-10-31	-	10 年	硕士研究生，2011 年加入广发证券，曾任广发证券风险管理部业务助理，2014 年加入广发证券资产管理（广东）有限公司固定收益部，曾任广发金管家多添利集合资产管理计划投资经理，现任广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划、广发资管睿利 3 年定期开放债券型集合资产管理计划投资经理。
刘淑生	本集合计划投资经理	2020-09-04	-	7 年	硕士研究生，曾先后任职于元大宝来证券投资信托股份有限公司、国金证券股份有限公司等；2014 年加入兴业证券股份有限公司担任高级研究员；2015 年 8 月加入汇丰晋信基金管理有限公司，先后担任高级研究员、研

					究副总监、基金经理。2020 年 7 月加入广发证券资产管理（广东）有限公司权益产品部，现任广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划、广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划投资经理。
石磊	本集合计划投资经理助理	2021-05-11	2022-03-03	5 年	硕士研究生，2015 年 12 月加入广发证券资产管理（广东）有限公司中央交易室任债券交易员，2021 年 5 月起加入固收投资部，任广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划投资经理助理。
骆霖苇	本集合计划投资经理助理	2022-01-24	-	6 年	硕士研究生，2015 年加入广发证券，曾任广发证券风险管理部业务助理，2018 年加入广发证券资产管理（广东）有限公司，曾任交易室债券交易员、固定收益部广发金管家多添利集合资产管理计划投资经理助理，现任广发金管家现金增利集合资产管理计划、广发资管昭利中短债债券型集合资产管理计划、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划、广发资管睿利 3 年定期开放债券型集合资产管理计划投资经理助理。

注：1、任职日期是指公司决定聘任投资经理管理本集合计划的日期；

2、证券从业的含义遵从《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

报告期内，管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及本集合计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。报告期，本集合计划运作合法合规，不存在违法违规或未履行本集合计划合同承诺的情形，不存在损害计划持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，结合本公司实际情况，制定了《公募产品公平交易及异常交易管理规定》，内容主要包括公平交易的管理组织的职责与分工、交易执行的内部控制、行为监控和分析、报告和

信息披露、检查和评价等内容。公平交易制度所规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等与投资管理活动相关的各个环节，也包括事后的检查分析和信息披露。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：①设立交易室，将交易执行职能独立于投资管理职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并在投资交易系统中设置公平交易模块，严格执行公平的交易分配制度。②根据交易所公开竞价交易、债券一级市场申购、非公开发行股票申购、以及银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的不同特点，分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待。③对特殊情况需要发生的交易，需要经过严格的公平性审核，相关投资经理应提供决策依据，通过内部请示提交部门负责人及合规部门和风控部门审批后方可执行。④建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核。对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司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。公司在交易系统设置不同投资组合之间同日反向交易的风控指标。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，相关投资经理应提供决策依据，通过内部审批及合规部门和风控部门审批后方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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 5% 的交易。

本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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 年总体呈现紧信用的格局，社融增速从年初的 13%最低下滑至 10%，制造业 PMI 从年初的 51.3%一度跌破 50%的荣枯线，四季度 PPI 同比增速也从高位回落，国内工业品通胀压力缓解。年内地方政府专项债发行后置，财政支出力度下降，基建增速逐步下滑；在三道红线和贷款集中度指标的压制下，房地产销售、投资和新开工全面转为负增长。为对冲经济下行，央行年内先后实施两次降准，调降一年期 LPR 报价 5bp。在宽货币紧信用的政策环境下，全年利率整体下行，尤其是临近年底降息预期上升，市场利率呈现加速探底的走势，10 年期国债收益率从一季度 3.3%的高位最低下行至 2.76%。2021 年股指呈现 W 型窄幅震荡，上证指数全年累计上涨 4.8%，振幅仅 12%，远低于过去两年。高景气赛道如新能源、半导体等新兴行业涨幅较大，煤炭、钢铁、化工等传统周期行业亦有明显超额收益。本集合计划的债券部分灵活运用久期策略，积极加仓银行二级资本债和偏债型转债等低风险品种，季末久期在 3 年左右的中性略高水平；股票仓位保持稳定，上半年重点挖掘了纺织服装等低估值消费股，下半年适当参与赛道类股票的趋势性机会，并注重控制仓位和止盈止损。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划的净值数据和同期业绩比较基准数据详见本报告“3 主要财务指标和基金净值表现”的披露内容。

#### 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，宏观经济政策重回稳增长的基调，但是在地产缺席的情况下经济企稳回升的难度较大、需要的时间也会更长，宽信用政策的力度需要继续加强；另一方面，虽然美联储将会加速缩减 QE 并可能在年内持续加息，但是国内货币政策在稳增长的背景下继续坚持以我为主的概率较大，上半年仍存在降准降息的空间。本集合计划将继续运用久期策略，在调整持仓结构的同时利用长久期利率债积极把握交易性行情。股票方面，在宏观经济有托底和流动性整体中性的环境下，股市不存在系统性风险，本集合计划坚持稳中求进的投资思路，继续以绝对收益为核心目标，继续挖掘并持有估值合理且基本面向上的优质个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

作为从事证券资产管理业务的证券公司，本集合计划管理人参照公募基金运作管理本集合计划，建立并持续完善相关参照公募基金运作的制度、流程、系统、机制等，确保本集合计划依法依规规范运作。除此以外，本集合计划管理人还须按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证

券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等运作管理私募资产管理计划。

本报告期内，管理人以维护集合计划份额持有人利益为宗旨，持续加强合规与风险管理工作。管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，通过法规解读、监管精神传达、合规培训，以及相关制度、流程、机制、系统的建立、健全和优化完善、合规审核与检查、系统监控、信息披露等方式，严守合规底线、排查防控重大风险，不断推进合规文化建设与员工执业与投资行为管理；母公司稽核部根据外部监管的要求及管理人年度稽核工作计划开展稽核项目，包括基金销售、关联交易、投资经理离任审查、信息技术等，关注内部控制的健全性和有效性，促进完善公司内控机制。管理人通过前述各项措施，有效保障了本集合计划及公司各项业务合法合规、稳健有序开展。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障本集合计划份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本集合计划合同要求以及本集合计划实际运作情况，本集合计划本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）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、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

安永华明（2022）审字第 61103118\_G08 号

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划全体份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度会计期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 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，我们独立于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划，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。

## 6.3 其他信息

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划管理人对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理人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。

在编制财务报表时，管理人负责评估广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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) 评价管理人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) 对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,452,077.56	538,461.05
结算备付金		25,119,129.19	11,213,708.21
存出保证金		184,154.23	429,973.86
交易性金融资产	7.4.7.2	2,050,628,826.01	6,343,127,348.03
其中：股票投资		354,900,404.51	336,016,528.17
基金投资		-	-
债券投资		1,672,655,421.50	5,601,230,519.86
资产支持证券投资		23,073,000.00	405,880,300.00
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	-	-
应收证券清算款		16,110,116.67	24,000,000.00
应收利息	7.4.7.5	29,679,257.80	116,665,379.17
应收股利		-	-
应收申购款		98,331.05	2,065,098.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,123,271,892.51</b>	<b>6,498,039,969.24</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		333,964,752.47	896,082,000.04
应付证券清算款		13,725,448.92	-

应付赎回款		5,651,162.59	54,570,028.18
应付管理人报酬		986,609.93	2,953,183.28
应付托管费		246,652.46	738,295.81
应付销售服务费		2,147,488.36	1,325,216.51
应付交易费用	7.4.7.7	28,966.60	70,252.60
应交税费		154,732.80	504,113.87
应付利息		230,814.11	235,579.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,000.00	194,000.00
<b>负债合计</b>		<b>357,330,628.24</b>	<b>956,672,669.55</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,646,031,678.23	5,301,886,273.23
未分配利润	7.4.7.10	119,909,586.04	239,481,026.46
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,765,941,264.27</b>	<b>5,541,367,299.69</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,123,271,892.51</b>	<b>6,498,039,969.24</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类份额净值人民币 1.0774 元，份额总额 564,924,153.90 份；C 类份额净值人民币 1.0705 元，份额总额 1,081,107,524.33 份；集合计划份额总额 1,646,031,678.23 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>155,138,612.29</b>	<b>255,485,341.07</b>
1.利息收入		126,135,080.14	217,519,860.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	471,322.63	1,338,136.26

债券利息收入		115,541,369.39	194,419,347.30
资产支持证券利息收入		9,529,441.35	18,937,452.67
买入返售金融资产收入		592,946.77	2,824,924.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		84,527,791.29	56,515,118.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	82,531,597.76	59,186,213.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-9,906,443.11	-9,255,456.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-39,156.04	-552,678.77
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-25,873.79	-
股利收益	7.4.7.15	11,967,666.47	7,137,040.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-55,524,259.14	-18,549,638.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>44,134,273.24</b>	<b>71,102,490.97</b>
1. 管理人报酬		18,316,586.91	36,250,901.64
2. 托管费		4,579,146.66	9,062,725.41
3. 销售服务费		7,297,616.56	14,777,637.22
4. 交易费用	7.4.7.18	1,452,316.22	2,679,762.86
5. 利息支出		11,483,013.93	7,222,253.80
其中：卖出回购金融资产支出		11,483,013.93	7,222,253.80
6. 税金及附加		673,384.31	775,605.30
7. 其他费用	7.4.7.19	332,208.65	333,604.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>111,004,339.05</b>	<b>184,382,850.10</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>111,004,339.05</b>	<b>184,382,850.10</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 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）	5,301,886,273.23	239,481,026.46	5,541,367,299.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	111,004,339.05	111,004,339.05
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）	-3,655,854,595.00	-230,575,779.47	-3,886,430,374.47
其中：1.基金申购款	1,013,510,962.80	98,893,525.35	1,112,404,488.15
2.基金赎回款	-4,669,365,557.80	-329,469,304.82	-4,998,834,862.62
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）	1,646,031,678.23	119,909,586.04	1,765,941,264.27
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 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）	2,829,635,358.87	27,141,816.82	2,856,777,175.69

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	184,382,850.10	184,382,850.10
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）	2,472,250,914.36	27,956,359.54	2,500,207,273.90
其中：1.基金申购款	4,467,909,473.42	109,365,701.32	4,577,275,174.74
2.基金赎回款	-1,995,658,559.06	-81,409,341.78	-2,077,067,900.84
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,301,886,273.23	239,481,026.46	5,541,367,299.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：秦力，主管会计工作负责人：李卉，会计机构负责人：梁杰锋

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2012 年 6 月 4 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）（证监许可[2012]749 号）核准设立，于 2012 年 9 月 20 日正式成立。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 337,103,564.21 元（含利息转份额），折合 337,103,564.21 份集合计划份额，上述资金经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验。原集合计划原管理人为广发证券股份有限公司，后变更为广发证券资产管理（广东）有限公司，托管人为中国银行股份有限公司。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中国证监会已完

成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自 2019 年 10 月 31 日起,《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式大集合产品,系管理人依据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划。

本集合计划主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券(含次级债券、混合资本债)、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含分离交易可转债、可交换债券)、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具(含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单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固定收益类证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。其中企业债、公司债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债券)、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于 AA,短期融资券债项评级不低于 A-1。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度会计期间的经营成果和资产净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本集合计划根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

##### （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本集合计划初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将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的公允价值变动计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本集合计划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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）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，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；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。

与上述投资品种相同，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将该限制作为特征考虑。本集合计划管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，本集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本集合计划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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。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的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并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入账；

（9）公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

（10）其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流

入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对集合计划合同约定费率和计算方法的费用，本集合计划在费用涵盖期间按合同约定进行确认。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按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关本集合计划分红条件的前提下，由管理人根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本集合计划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份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 本集合计划收益分配后某类集合计划份额的份额净值不能低于面值；即本集合计划收益分配日的某类份额的份额净值减去每单位该类份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于集合计划费用的不同，不同类别的份额在收益分配数额方面可能有所不同，管理人可对各类别份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收

率缴纳增值税，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,452,077.56	538,461.05
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	1,452,077.56	538,461.05

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	337,219,719.93	354,900,404.51	17,680,684.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	1,117,410,195.65	1,050,052,421.50	-67,357,774.15
	银行间市场	637,142,016.80	622,603,000.00	-14,539,016.80
	合计	1,754,552,212.45	1,672,655,421.50	-81,896,790.95
资产支持证券		29,682,300.00	23,073,000.00	-6,609,300.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,121,454,232.38	2,050,628,826.01	-70,825,406.37
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		333,059,336.87	336,016,528.17	2,957,191.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,781,338,324.56	1,772,850,019.86	-8,488,304.70
	银行间市场	3,837,227,123.83	3,828,380,500.00	-8,846,623.83
	合计	5,618,565,448.39	5,601,230,519.86	-17,334,928.53
资产支持证券		406,803,710.00	405,880,300.00	-923,410.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,358,428,495.26	6,343,127,348.03	-15,301,147.23

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 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

本集合计划本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末及上年度末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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,258.90	3,913.34
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	11,220.58	5,038.99
应收债券利息	29,355,339.25	108,717,940.69
应收资产支持证券利息	310,356.17	7,938,292.75
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	82.90	193.40
合计	29,679,257.80	116,665,379.17

#### 7.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,442.71	8,047.21
银行间市场应付交易费用	26,523.89	62,205.39
合计	28,966.60	70,252.60

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	194,000.00	194,000.00

合计	194,000.00	194,000.00
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

广发资管乾利一年持有期债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	500,772,831.96	500,772,831.96
本期申购	482,814,393.49	482,814,393.49
本期赎回（以“-”号填列）	-418,663,071.55	-418,663,071.55
本期末	564,924,153.90	564,924,153.90

广发资管乾利一年持有期债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,801,113,441.27	4,801,113,441.27
本期申购	530,696,569.31	530,696,569.31
本期赎回（以“-”号填列）	-4,250,702,486.25	-4,250,702,486.25
本期末	1,081,107,524.33	1,081,107,524.33

#### 7.4.7.10 未分配利润

广发资管乾利一年持有期债券 A

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	38,468,379.56	-14,197,856.88	24,270,522.68
本期利润	41,760,581.24	-33,270,752.06	8,489,829.18
本期基金份额交易产生的变动数	2,841,875.24	8,108,582.50	10,950,457.74
其中：基金申购款	53,784,342.85	-5,360,113.95	48,424,228.90
基金赎回款	-50,942,467.61	13,468,696.45	-37,473,771.16

本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,070,836.04	-39,360,026.44	43,710,809.60

广发资管乾利一年持有期债券 C

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	351,313,354.85	-136,102,851.07	215,210,503.78
本期利润	124,768,016.95	-22,253,507.08	102,514,509.87
本期基金份额交易产生的变动数	-324,874,273.49	83,348,036.28	-241,526,237.21
其中：基金申购款	55,259,346.46	-4,790,050.01	50,469,296.45
基金赎回款	-380,133,619.95	88,138,086.29	-291,995,533.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	151,207,098.31	-75,008,321.87	76,198,776.44

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	155,022.90	1,087,364.91
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	311,896.26	246,420.91
其他	4,403.47	4,350.44
合计	471,322.63	1,338,136.26

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,132,655,837.57	1,934,955,101.42
减：卖出股票成本总额	1,050,124,239.81	1,875,768,887.48

买卖股票差价收入	82,531,597.76	59,186,213.94
----------	---------------	---------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1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	9,689,530,956.17	13,409,996,269.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,532,315,870.56	13,206,957,056.14
减：应收利息总额	167,121,528.72	212,294,669.62
买卖债券差价收入	-9,906,443.11	-9,255,456.57

#### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	425,240,345.68	680,212,340.61
减：卖出资产支持证券成本总额	414,349,805.62	661,826,678.77
减：应收利息总额	10,929,696.10	18,938,340.61
资产支持证券投资收益	-39,156.04	-552,678.77

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
国债期货投资收益	-25,873.79	-

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,967,666.47	7,137,040.29
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	11,967,666.47	7,137,040.29
----	---------------	--------------

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-55,524,259.14	-18,647,093.03
——股票投资	14,723,493.28	2,957,191.30
——债券投资	-64,561,862.42	-20,533,449.67
——资产支持证券投资	-5,685,890.00	-1,070,834.66
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-97,454.70
合计	-55,524,259.14	-18,549,638.33

#### 7.4.7.17 其他收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,378,434.02	2,554,137.86
银行间市场交易费用	73,815.00	125,625.00
期货市场交易费用	67.20	-
合计	1,452,316.22	2,679,762.86

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	74,000.00	74,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	93,008.65	105,404.74
账户管理费	36,000.00	33,000.00
其他	9,200.00	1,200.00
合计	332,208.65	333,604.74

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“广发资管”）	本集合计划管理人、集合计划销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	本集合计划托管人
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	本集合计划管理人母公司
广发期货有限公司（以下简称“广发期货”）	与集合计划管理人受同一控制

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

广发证券	2,196,432,178.97	100.00%	4,149,525,161.88	100.00%
------	------------------	---------	------------------	---------

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	3,891,573,127.02	24.73%	5,654,958,041.69	18.29%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	43,157,813,000.00	66.19%	27,755,338,000.00	42.25%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	43,024.68	100.00%	2,442.71	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	238,627.37	100.00%	8,047.21	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结

算有限责任公司收取的托管费和经手费的净额列示。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,316,586.91	36,250,901.64
其中：支付销售机构的客户维护费	8,333,646.05	17,242,559.29

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,579,146.66	9,062,725.41

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发资管乾利一年持有期债 券 A	广发资管乾利一年持有期债 券 C	合计
广发资管	-	7,297,616.56	7,297,616.56
合计	-	7,297,616.56	7,297,616.56
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发资管乾利一年持有期债 券 A	广发资管乾利一年持有期债 券 C	合计
广发资管	-	14,777,637.22	14,777,637.22
合计	-	14,777,637.22	14,777,637.22

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.3%。各类集合计划份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为每日该类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为前一日该类集合计划份额的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，管理人与基金销售机构按照销售协议的约定分配。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间无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。

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31日	
	广发资管乾利一年持有期债券A	广发资管乾利一年持有期债券C	广发资管乾利一年持有期债券A	广发资管乾利一年持有期债券C
报告期初持有的基金份额	213,784,920.73	-	213,784,920.73	-
报告期间申购/买入总份额	71,028,506.49	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	213,778,033.00	-	-	-
报告期末持有的基金份额	71,035,394.22	-	213,784,920.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.32%	-	4.03%	-

注：1、本集合计划管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本集合计划份额变动的相关费用按资产管理合同等相关法律文件有关规定支付。

2、本表中占基金总份额比例的计算中，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

3、申购总份额含红利再投、转换入份额，赎回总份额含转换出份额。

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

本报告期末和上年度末本集合计划管理人之外的其他关联方不存在投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1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
中国银行	1,452,077.56	155,022.90	538,461.05	1,087,036.14

注：本集合计划的上述银行存款由托管人中国银行股份有限公司广东省分行保管，按银行同业

利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内通过广发期货有限公司进行期货交易（上年度可比期间无），该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

#### 7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

#### 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

截至本报告期末，本集合计划无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本集合计划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 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 95,059,752.47 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
190202	19 国开 02	2022-01-04	100.04	800,000.00	80,032,000.00
210014	21 付息国债 14	2022-01-04	103.85	170,000.00	17,654,500.00
合计				970,000.00	97,686,500.00

###### 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，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，于 2022 年 1 月 4 日至 2022 年 1 月 6 日（先后）到期。该类交易要求本集合计划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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为债券型集合产品，集合计划的风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险投资品种。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定范围之内。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人奉行全面风险管理的理念，公司实行“董事会—高级管理层（风险控制委员会）—风险管理部—各业务部门与各职能部门”的四级风险管理组织体系，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，超过权限需报上一级风险管理组织和人员决策。董事会是公司风险管理的最高决策机构，履行一级风险防范的职能；高级管理层及下设的风险控制委员会履行二级风险防范的职能。风险控制委员会协助高级管理层确定、调整公司风险容忍度及业务风险限额，评估和决策重大风险事项，并监督公司的风险管理状况；公司风险管理部作为风险管理工作的职能部门，负责监测、评估、报告公司整体风险水平，并负责协助、指导和检查各部门风险管理工作，公司其他职能部门根据各自职责分工，履行相应风险管理职责。公司各业务部门履行直接的风险管理职责，承担本部门风险管理的第一责任。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对本集合计划资产造成的损失。为了防范信用风险，本集合计划针对投资标的和交易对手分别建立了准入标准及风险限额，在投资前需履行相应的尽职调查和内部审批程序。本集合计划在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	541,695,528.07
A-1 以下	-	-

未评级	92,635,989.04	560,690,843.44
合计	92,635,989.04	1,102,386,371.51

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,143,780,339.09	1,781,943,440.28
AAA 以下	392,390,298.00	1,505,649,421.45
未评级	73,204,134.62	1,319,969,227.31
合计	1,609,374,771.71	4,607,562,089.04

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括期限大于一年的国债、政策性金融债和央行票据。

3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	23,383,356.17	308,763,122.62
AAA 以下	-	73,674,506.85
未评级	-	31,380,963.28
合计	23,383,356.17	413,818,592.75

注：1. 资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.资产支持证券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划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，有效保障集合计划持有人利益。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划管理人通过设置久期、VaR 等指标对利率风险进行管理。

本集合计划主要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 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	1,452,077.56	-	-	-	1,452,077.56
结算备付金	25,119,129.19	-	-	-	25,119,129.19
存出保证金	184,154.23	-	-	-	184,154.23
交易性金融资产	219,136,862.40	970,168,504.40	506,423,054.70	354,900,404.51	2,050,628,826.01
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	16,110,116.67	16,110,116.67
应收利息	-	-	-	29,679,257.80	29,679,257.80
应收申购款	-	-	-	98,331.05	98,331.05
资产总计	245,892,223.38	970,168,504.40	506,423,054.70	400,788,110.03	2,123,271,892.51
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	333,964,752.47	-	-	-	333,964,752.47
应付证券清算款	-	-	-	13,725,448.92	13,725,448.92
应付赎回款	-	-	-	5,651,162.59	5,651,162.59
应付管理人报酬	-	-	-	986,609.93	986,609.93
应付托管费	-	-	-	246,652.46	246,652.46
应付销售服务费	-	-	-	2,147,488.36	2,147,488.36
应付交易费用	-	-	-	28,966.60	28,966.60
应交税费	-	-	-	154,732.80	154,732.80
应付利息	-	-	-	230,814.11	230,814.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	333,964,752.47	-	-	23,365,875.77	357,330,628.24
利率敏感度缺口	-88,072,529.09	970,168,504.40	506,423,054.70	377,422,234.26	1,765,941,264.27
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	538,461.05	-	-	-	538,461.05
结算备付金	11,213,708.21	-	-	-	11,213,708.21
存出保证金	429,973.86	-	-	-	429,973.86
交易性金融资产	1,797,579,729.40	2,928,269,227.46	1,281,261,863.00	336,016,528.17	6,343,127,348.03
应收证券清算款	-	-	-	24,000,000.00	24,000,000.00
应收利息	-	-	-	116,665,379.17	116,665,379.17
应收申购款	-	-	-	2,065,098.92	2,065,098.92
资产总计	1,809,761,872.52	2,928,269,227.46	1,281,261,863.00	478,747,006.26	6,498,039,969.24
负债					
卖出回购金融资产款	896,082,000.04	-	-	-	896,082,000.04
应付赎回款	-	-	-	54,570,028.18	54,570,028.18
应付管理人报酬	-	-	-	2,953,183.28	2,953,183.28
应付托管费	-	-	-	738,295.81	738,295.81
应付销售服务费	-	-	-	1,325,216.51	1,325,216.51
应付交易费用	-	-	-	70,252.60	70,252.60
应交税费	-	-	-	504,113.87	504,113.87
应付利息	-	-	-	235,579.26	235,579.26
其他负债	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	896,082,000.04	-	-	60,590,669.51	956,672,669.55
利率敏感度缺口	913,679,872.48	2,928,269,227.46	1,281,261,863.00	418,156,336.75	5,541,367,299.69

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	市场利率上升 25 个基点	-6,867,614.42	-41,979,946.58
	市场利率下降 25 个基点	7,118,213.93	43,149,814.82

#### 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。本集合计划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

其他价格风险是指以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

为对市场风险进行有效的管理，本集合计划管理人建立了市场风险指标管理体系，针对权益价格风险，设置了净值增长率、波动率、预警线、止损线、VaR 等指标。同时，制定各指标相应的风险限额，并持续跟踪限额执行情况和市场变化，对其进行动态调整。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	354,900,404.51	20.10	336,016,528.17	6.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	615,925,769.80	34.88	472,719,567.46	8.53
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	970,826,174.31	54.97	808,736,095.63	14.59

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	各板块市场指数上涨 5%	15,426,170.24	16,536,117.33
	各板块市场指数下跌 5%	-15,426,170.24	-16,536,117.33

#### 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

###### (1) 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，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 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

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 970,826,174.31 元，属于第二层次的余额为人民币 1,079,802,651.70 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 679,071,666.23 元，属于第二层次的余额为人民币 5,664,055,681.80 元，无属于第三层次的余额）。

###### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划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	354,900,404.51	16.71
	其中：股票	354,900,404.51	16.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,695,728,421.50	79.86
	其中：债券	1,672,655,421.50	78.78
	资产支持证券	23,073,000.00	1.09
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	26,571,206.75	1.25
8	其他各项资产	46,071,859.75	2.17
9	合计	2,123,271,892.51	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

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	343,940,404.51	19.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,960,000.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	354,900,404.51	20.10

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002154	报喜鸟	21,667,300.00	108,986,519.00	6.17
2	601339	百隆东方	9,712,308.00	57,205,494.12	3.24
3	603339	四方科技	3,545,890.00	48,755,987.50	2.76
4	603518	锦泓集团	3,715,600.00	44,847,292.00	2.54
5	603908	牧高笛	950,552.00	39,447,908.00	2.23
6	601882	海天精工	606,830.00	15,031,179.10	0.85
7	300750	宁德时代	25,000.00	14,700,000.00	0.83
8	600018	上港集团	2,000,000.00	10,960,000.00	0.62
9	002594	比亚迪	30,000.00	8,043,600.00	0.46
10	603313	梦百合	399,909.00	6,922,424.79	0.39

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601339	百隆东方	147,477,481.71	2.66
2	002154	报喜鸟	87,547,931.00	1.58
3	002120	韵达股份	65,249,969.21	1.18

4	603518	锦泓集团	60,106,241.00	1.08
5	601229	上海银行	43,866,193.35	0.79
6	601939	建设银行	43,070,871.98	0.78
7	601818	光大银行	41,596,559.00	0.75
8	603339	四方科技	38,268,152.13	0.69
9	601166	兴业银行	36,577,840.00	0.66
10	603908	牧高笛	34,963,513.92	0.63
11	300343	联创股份	33,951,808.86	0.61
12	300750	宁德时代	28,683,718.00	0.52
13	603589	口子窖	27,874,928.00	0.50
14	002507	涪陵榨菜	24,954,935.58	0.45
15	300132	青松股份	24,215,970.20	0.44
16	002285	世联行	23,181,425.00	0.42
17	600507	方大特钢	21,449,365.27	0.39
18	000725	京东方 A	20,713,433.00	0.37
19	000036	华联控股	17,334,464.70	0.31
20	601088	中国神华	16,730,172.00	0.30

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括集合计划二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601339	百隆东方	141,065,946.37	2.55
2	002120	韵达股份	64,954,801.00	1.17
3	002154	报喜鸟	61,957,389.00	1.12
4	300343	联创股份	56,644,034.00	1.02
5	601939	建设银行	45,827,019.22	0.83
6	601229	上海银行	45,217,357.20	0.82
7	601818	光大银行	41,305,696.00	0.75
8	002014	永新股份	39,090,179.57	0.71
9	601166	兴业银行	35,358,063.00	0.64
10	603339	四方科技	34,201,256.08	0.62
11	603589	口子窖	30,934,412.50	0.56
12	002285	世联行	30,580,468.06	0.55
13	002304	洋河股份	24,081,774.00	0.43

14	601398	工商银行	23,000,619.68	0.42
15	002867	周大生	22,883,100.23	0.41
16	600507	方大特钢	21,706,076.32	0.39
17	000725	京东方 A	21,640,013.00	0.39
18	002507	涪陵榨菜	21,121,401.00	0.38
19	600048	保利发展	19,715,379.00	0.36
20	300132	青松股份	18,262,819.40	0.33

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,051,808,674.93
卖出股票收入（成交）总额	1,132,655,837.57

#### 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	72,695,000.00	4.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	343,741,000.00	19.47
	其中：政策性金融债	90,036,000.00	5.10
4	企业债券	544,945,651.70	30.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	95,348,000.00	5.40
7	可转债（可交换债）	615,925,769.80	34.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,672,655,421.50	94.72

#### 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	110059	浦发转债	1,524,890.00	161,013,135.10	9.12

2	113042	上银转债	1,523,200.00	160,743,296.00	9.10
3	113021	中信转债	1,265,710.00	137,164,992.70	7.77
4	113044	大秦转债	1,148,470.00	125,688,556.80	7.12
5	190202	19 国开 02	900,000.00	90,036,000.00	5.10

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	168326	融信 03 优	300,000.00	23,073,000.00	1.31

#### 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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本集合计划本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本集合计划本报告期末未持有股指期货。

（2）本集合计划本报告期内未进行股指期货交易。

#### 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

本集合计划在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货定价原理，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲一定情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以达到降低投资组合整体风险的目的。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-25,873.79
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

通过对宏观经济的全面分析和债券市场的趋势研究，本集合计划在本报告期内以套期保值为主

要目的进行了国债期货投资，较好的对冲了利率风险和流动性风险对本集合计划的影响，降低了净值波动，符合既定的投资政策和投资目的。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本集合计划投资前十名证券的发行主体在本报告期内未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。但部分发行主体的分支机构在报告编制日前一年内受到一单或多单处罚情形，具体如下：

(1) 上海浦东发展银行杭州分行等分支机构因未按规定履行客户身份识别义务等违规行为被中国人民银行杭州支行等处处以罚款等行政处罚；

(2) 中信银行重庆分行等分支机构因信贷业务违规、内部管理与控制制度不健全或执行监督不力、未经批准设立金融机构、分支机构等违规行为被重庆银保监局处以警告、罚款等行政处罚；

(3) 兴业银行济南分行在 2021 年 11 月 23 日因对二手房按揭贷款业务审查不到位，对房地产开发贷款资金使用管理不尽职等情形被山东银保监局处以罚款等行政处罚；

(4) 国家开发银行大连市分行、新疆分行分别在 2021 年 8 月 23 日和 2021 年 9 月 3 日因信贷业务违规等情形被大连银保监局、新疆银保监局处以罚款等行政处罚；

上述处罚均系本集合计划投资前十名证券的发行主体的分支机构在日常业务运作过程中受到的监管机构处罚，本集合计划投资上述标的均基于对标的基本面研究和二级市场判断，上述投资的决策程序和流程均符合公司投资管理制度的相关规定和程序。

8.12.2 本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出合同规定的备选股票库。

### 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	184,154.23
2	应收证券清算款	16,110,116.67
3	应收股利	-
4	应收利息	29,679,257.80
5	应收申购款	98,331.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	46,071,859.75
---	----	---------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	161,013,135.10	9.12
2	113042	上银转债	160,743,296.00	9.10
3	113021	中信转债	137,164,992.70	7.77
4	113044	大秦转债	125,688,556.80	7.12
5	113619	世运转债	19,279,758.70	1.09
6	128136	立讯转债	12,036,030.50	0.68

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
广发资管乾利一 年持有期债券 A	20,028	28,206.72	78,571,385.53	13.91%	486,352,768.37	86.09%
广发资管乾利一 年持有期债券 C	34,282	31,535.72	3,901,528.47	0.36%	1,077,205,995. 86	99.64%
合计	53,687	30,659.78	82,472,914.00	5.01%	1,563,558,764. 23	94.99%

注：1、本表中，分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分份额基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下述分级基金份额的合计数（即期末

基金份额总数)。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总数/期末持有人户数合计。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发资管乾利一年持有期债券 A	2,246,310.63	0.40%
	广发资管乾利一年持有期债券 C	148,659.93	0.01%
	合计	2,394,970.56	0.15%

注：本表中，从业人员持有份额占基金总份额比例的计算中，对分份额基金，分母“基金总份额”采用各自级别的份额；对合计数，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

### 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	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	广发资管乾利一年持有期债券 A	>100
	广发资管乾利一年持有期债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发资管乾利一年持有期债券 A	0~10
	广发资管乾利一年持有期债券 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
本报告期期初基金份额总额	500,772,831.96	4,801,113,441.27
本报告期基金总申购份额	482,814,393.49	530,696,569.31
减：本报告期基金总赎回份额	418,663,071.55	4,250,702,486.25

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	564,924,153.90	1,081,107,524.33

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

### 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，本集合计划管理人于 2021 年 7 月 7 日发布公告，叶秋彬先生因内部退休，自 2021 年 7 月 6 日起离任公司副总经理、首席信息官职务，公司聘请柯学先生自 2021 年 7 月 6 日起担任公司首席信息官；于 2021 年 7 月 24 日发布公告，孔维成先生因工作安排自 2021 年 7 月 22 日离任公司总经理职务，由公司董事长杨龙先生代为履行总经理职务；于 2021 年 11 月 26 日发布公告，钟沁昇先生因个人原因自 2021 年 11 月 25 日离任公司副总经理职务；于 2021 年 12 月 31 日发布公告，杨龙先生因工作安排自 2021 年 12 月 30 日离任公司董事长、总经理职务，公司聘请秦力先生自 2021 年 12 月 30 日起担任公司董事长、总经理职务。除此之外，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划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

本集合计划自合同变更生效以来聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为 7.4 万元，已提供审计服务年限为 3 年。

### 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，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	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	
广发证券	2	2,196,432,178.97	100.00%	43,024.68	100.00%	-

注：佣金指本集合计划通过单一券商的交易单元进行股票、债券、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
广发证券	3,891,573,127.02	100.00%	43,157,813,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发证券资产管理（广东）有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-12-31
2	关于旗下部分集合资产管理计划 2022 年非港股通交易日暂停申购（含定期定额申购）、赎回等业务的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-12-28
3	广发证券资产管理（广东）有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-11-26
4	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年第 3 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-26
5	关于旗下集合资产管理计划（参照公募基金运作）2021 年第三季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-10-26
6	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 C）更新（图数据更新）基金产品资料概要 2021-10-15	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-15
7	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 A）更新（图数据更新）基金产品资料概要 2021-10-15	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-15

8	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（年度更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-15
9	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年中期报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-08-27
10	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年中期报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-08-27
11	关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划增加侧袋机制等并修改集合合同、托管协议和招募说明书的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-29
12	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-24
13	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年第 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-20
14	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第二季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-07-20
15	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-07
16	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（重大事项更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2021-05-17
17	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 C）基金产品资料概要更新	基金电子披露网站及管理人网站	2021-05-17
18	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 A）基金产品资料概要更新	基金电子披露网站及管理人网站	2021-05-17
19	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-05-14
20	关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划调整赎回申请最低份额、交易账户最低份额余额的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-05-11
21	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第一季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-04-20
22	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-04-20
23	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2020 年年度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-03-30
24	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2020 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-03-30
25	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2020 年第四季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-01-20
26	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-01-20

## § 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

本报告期内，本集合计划未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过本集合计划总份额20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、《关于准予广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2019]2356号)；

2、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划合同生效公告；

3、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；

4、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；

5、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书；

6、管理人业务资格批件和营业执照。

### 13.2 存放地点

广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼。

### 13.3 查阅方式

1、书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

2、网络查阅：管理人网站：[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二二年三月二十九日