

# 中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自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	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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
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	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
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序的前五名债券投资明细	54
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	54
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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12	本报告期投资基金情况	54
8.13	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	58
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	59
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.9	其他重大事件	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	62
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§13	备查文件目录	62
13.1	备查文件目录	62
13.2	存放地点	62
13.3	查阅方式	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	中加安瑞平衡养老三年
基金主代码	008930
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年08月27日
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,046,951.13份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用成熟稳健的资产配置策略，优选基金投资组合，控制基金下行风险，追求基金长期稳健增值。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*50%+中证800指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对平衡的基金。

### 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	中加基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	刘凌	郭明
	联系电话	400-00-95526	010-66105799
	电子邮箱	service@bobbs.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-00-95526	95588
传真		010-83197627	010-66105798
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		100050	100140
法定代表人		夏英	陈四清

## 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.bobbs.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

## § 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08月27日(基金合同生效日)-202
---------------	-------	--------------------------

		0年12月31日
本期已实现收益	661,886.50	-63,007.56
本期利润	676,618.72	338,889.87
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0338
本期加权平均净值利润率	6.32%	3.37%
本期基金份额净值增长率	6.51%	3.38%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	598,520.42	-63,335.76
期末可供分配基金份额利润	0.0596	-0.0063
期末基金资产净值	11,063,083.34	10,380,128.86
期末基金份额净值	1.1011	1.0338
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	10.11%	3.38%

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

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

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

### 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	3.11%	0.36%	1.67%	0.36%	1.44%	0.00%
过去六个月	3.68%	0.47%	0.37%	0.47%	3.31%	0.00%
过去一年	6.51%	0.50%	2.55%	0.54%	3.96%	-0.04%
自基金合同生效起至今	10.11%	0.45%	7.07%	0.53%	3.04%	-0.08%

### 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

中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年08月27日-2021年12月31日)

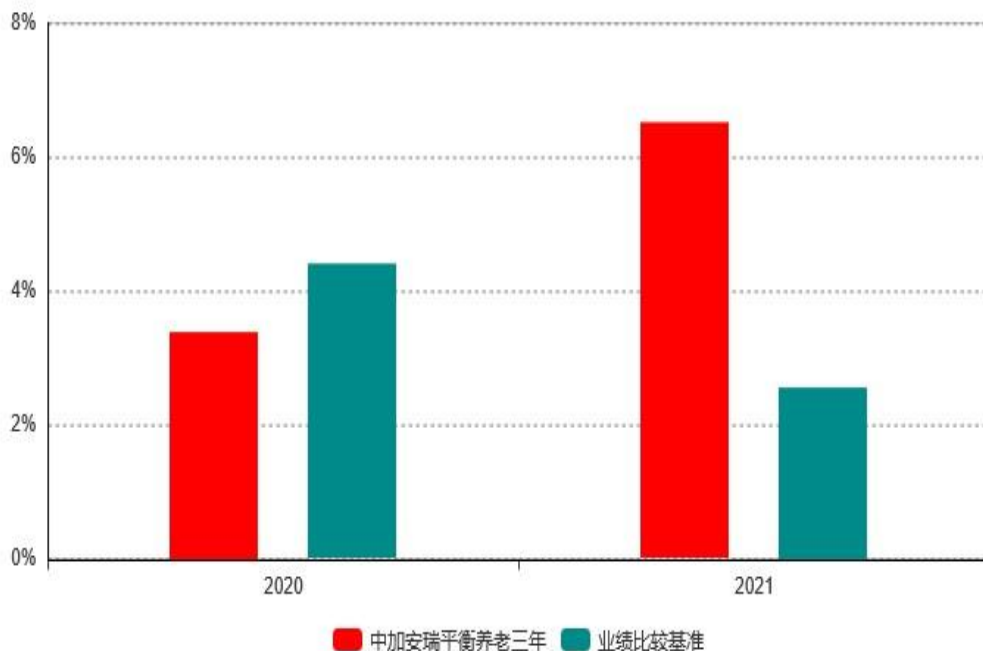


注：1. 本基金基金合同于2020年08月27日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效已满一年。

2. 根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金的基金合同生效已满6个月，建仓期已结束，建仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

### 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





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本公司共管理六十二只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发

起式证券投资基金(A/C)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金(A/C)、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金(A/C)、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金(A/C)、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金(A/C)、中加科盈混合型证券投资基金(A/C)、中加优享纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加瑞享纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金(A/C)、中加核心智造混合型证券投资基金(A/C)、中加优势企业混合型证券投资基金(A/C)、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金(A/C)、中加中证500指数增强型证券投资基金(A/C)、中加科享混合型证券投资基金(A/C)、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金(A/C)、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金(A/C)、中加消费优选混合型证券投资基金(A/C)、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭智	本基金基金经理	2020-	-	16	郭智女士, 金融学硕士,

		08-27			十六年金融行业从业经验。历任齐鲁证券研究员、天相投顾高级分析师、英大保险投资经理、恒天财富基金投资部总经理。2017年3月加入中加基金；现任中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理（2020年3月20日至今）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理（2020年8月27日至今），且未兼任其他非基金中基金的基金经理。
--	--	-------	--	--	---

- 1、任职日期说明：郭智女士的任职日期以本基金基金合同生效公告为准。
- 2、离任日期说明：无。
- 3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 4、本基金无基金经理助理。

#### 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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

#### 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

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

## 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

2021年养老FOF基金取得了较大发展。截止2021年12月31日，养老型FOF（包含主基金，下同）共152只，规模1063.29亿元，相比2020年底的590亿元和2021年中的761亿，规模分别增长了80%和40%。其中养老一年56只，规模811亿，养老三年74只，规模216亿，养老五年共21只，规模35亿。

中加安瑞平衡养老目标三年自2020年8月27日成立以来采取了平衡的投资策略，需要在收益性和波动性方面做出平衡，注重各因子的风险暴露，力争均衡配置，利用优秀投研平台的优秀基金经理的管理，获得稳健的alpha收益。

从产品成立以来，由于市场估值较高，中加安瑞平衡养老三年股票仓位在同业中处于低位，5月份开始逐步配置偏TMT、周期等估值尚属合理板块的基金，替换弹性较小的价值型基金，在保持仓位基本不变的情况下增加产品弹性。

三季度，A股市场整体调整，但周期、新能源等强势板块表现较好；9月份行情结构逆转，周期、新能源等前期强势板块等调整，市场震荡加大，调整充分板块、低估值板块有一定表现。三季度产品持仓向长期稳健型基金偏移。2021年全年产品绝对收益6.51%，在行业中处于前1/5，年化波动率较低，仅为7.86%，在同业中基本处于后1/5水平。

2022年开年市场调整幅度较大，今年降低收益预期，继续采取平衡的投资策略，等待下半年经济企稳时加配成长型基金的机会。偏股型基金注重各因子的风险暴露，力争

均衡配置，利用优秀投研平台的优秀基金经理的管理，获得稳健的alpha收益。在子基金的选择上，优选投研平台实力强、基金经理注重风险调整后收益、注重回撤控制的产品。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加安瑞平衡养老三年基金份额净值为1.1011元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.51%，同期业绩比较基准收益率为2.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年我们对经济的展望相对乐观，虽然目前PMI仍在低位，1月社融数据总量表现超预期，结构依旧偏弱但也可见小幅改善，开年宽信用基本落地。往后看，政府债券发行加速及政策主导下银行贷款投放的扩张有望延续，一季度社融增速有望继续回暖，但考虑到今年基建和房地产受到一定约束，本轮信用结构改善的节奏或会慢于以往。从通胀数据看，国内通胀压力正在持续缓解，预计未来将呈现PPI的温和下滑和CPI的温和回升，通胀压力难以对央行货币政策形成制约，且从CPI的回升弱于预期来看，内需仍未见明显好转迹象，本轮宽货币引导宽信用的动作可能延续时间较长，预计未来将会有更多促消费、兴基建、稳地产政策出台。此外，近期部分城市已经开始下调个人住房贷款首付比例，标志着在“房住不炒”和“因城施策”框架下，房地产政策局部调整逐步向需求端推进，后续地产需求端和融资端政策存在进一步因地制宜调整的可能，地产行业或会逐步走出政策修复-销售修复-信用修复的路径，带动经济在三季度企稳反弹。

对股市而言，考虑到本轮信用结构改善节奏或会慢于以往，经济基本面或会在三季度企稳回升，期间财政政策力度将相对积极，货币政策将延续宽松，房地产政策继续纠偏。在此背景下，权益市场系统性下跌的风险较低，预计在充分消化利空因素后，市场将逐步转为震荡，此时宜持仓等待反弹。若上半年充分回调，则或会在三季度有较好行情，此时外围流动性风险应也已有相对缓解。考虑到目前的市场估值水平和经济的逐步改善，股票类资产适宜中性配置。

对债市而言，短期内降息等利多因素已经兑现，而1月社融数据显现出宽信用效果，债市迎来预期校正的调整阶段，市场定价逐步转向宽信用，债市调整压力显现，需强化对信贷数据跟踪。长期看，预计本轮能源危机、全球供需缺口和通胀格局将持续到年中，成为2022年全球经济的重要特征，但数据显示国内通胀压力不大，不会对货币政策形成掣肘，货币政策仍会维持偏松状态。国内宽信用预期增强叠加宽货币政策的背景下，长债利率呈震荡格局。此后2-3季度，随着稳增长政策逐步带动经济企稳，货币政策或会有所收敛，叠加美联储加息，或会对债市造成一定压力。后续仍需重点观察宽信用效果、房地产下行斜率及出口回落情况，两会前后是观察股市和债市的重要时间窗口。

海外方面，美国面临中期选举压力，通胀“政治化”促使美联储货币政策转紧，从而引导美债打开收益率向上空间。对美股而言，10年期美债收益率继续向上突破，市场波动可能明显上升，面临估值和盈利预期双杀压力。港股方面，作为中美两国基本面与货币政策的重叠区域，中国经济见底回升和美国货币政策由松转紧的组合不利于市场整体表现，但好在港股过去两年表现偏弱，已经计入了大部分中国经济增长走弱相关的风险，目前港股市场估值相对合理，配置价值显现，但仍要提防美股在流动性收紧下“杀估值”可能带来的调整冲击。

综上，稳增长环境下经济的逐步改善相对利好股市，债券资产虽然收益率降低，但是在控制久期的情况下仍然可以带来稳定的票息，建议中性配置，落脚到基金组合配置中，偏股型基金优选投研平台实力雄厚、投资经理认知能力强、alpha能力较强的基金，同时注意规避规模较大的基金；债券型基金选择债券投研能力较强、投资经理业绩优秀的基金，目前债券收益率降低条件下，可以选择一定比例的贝塔较低的固收加资产作为替代。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人

人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

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验。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

1、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；

2、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；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；

5、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、自2021年1月1日至2021年12月31日止，本基金本期未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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，本基金的管理人—中加基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人依法对中加基金管理有限公司编制和披露的本基金2021年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2202391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	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“中加安瑞平衡基金”)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、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)



	和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中加安瑞平衡基金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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中加安瑞平衡基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	中加安瑞平衡基金管理人中加基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中加安瑞平衡基金2021年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表

	<p>时,基金管理人管理层负责评估中加安瑞平衡基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非中加安瑞平衡基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中加安瑞平衡基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。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)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中加安瑞平衡基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保</p>

	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中加安瑞平衡基金不能持续经营。(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。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	李砾、刘宇宁
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2022-03-29

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

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	774,006.07	57.07
结算备付金		5,838.89	-
存出保证金		157.71	26.98
交易性金融资产	7.4.7.2	10,328,714.85	10,407,025.53
其中：股票投资		-	-
基金投资		9,728,624.85	9,868,726.23
债券投资		600,090.00	538,299.30
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	-	-
应收证券清算款		-	25,000.00
应收利息	7.4.7.5	12,782.11	5,367.45
应收股利		-	291.48
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,121,499.63	10,437,768.51
<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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,182.97	6,523.84
应付托管费		1,233.32	1,115.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	50,000.00	50,000.00
负债合计		58,416.29	57,639.65
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.8	10,046,951.13	10,040,895.50
未分配利润	7.4.7.9	1,016,132.21	339,233.36

所有者权益合计		11,063,083.34	10,380,128.86
负债和所有者权益总计		11,121,499.63	10,437,768.51

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值人民币1.1011元，基金份额总额10,046,951.13份。

## 7.2 利润表

会计主体：中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

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 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		865,110.53	508,876.38
1. 利息收入		15,543.49	7,903.85
其中：存款利息收入	7.4.7.10	1,017.50	1,243.27
债券利息收入		14,170.40	3,930.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		355.59	2,729.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		834,834.82	99,075.10
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-	-
基金投资收益	7.4.7.12	707,148.63	69,138.64
债券投资收益	7.4.7.13	-1,082.15	-16.34
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	128,768.34	29,952.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	14,732.22	401,897.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		188,491.81	169,986.51
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	81,492.65	26,364.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,562.85	4,369.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	44,220.31	39,122.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	50,216.00	100,130.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		676,618.72	338,889.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		676,618.72	338,889.87

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

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
----	----

	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)	10,040,895.50	339,233.36	10,380,128.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	676,618.72	676,618.72
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)	6,055.63	280.13	6,335.76
其中：1. 基金申购款	6,055.63	280.13	6,335.76
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,046,951.13	1,016,132.21	11,063,083.34
项 目	上年度可比期间		
	2020年08月27日(基金合同生效日)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)	10,011,021.43	-	10,011,021.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	338,889.87	338,889.87

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)	29,874.07	343.49	30,217.56
其中:1.基金申购款	29,874.07	343.49	30,217.56
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,040,895.50	339,233.36	10,380,128.86

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:

夏英

陈昕

陈昕

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

中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2019年11月26日证监许可[2019]2538号文注册,由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式混合型基金中基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

本基金通过中加基金直销中心公开发售,募集期为2020年5月25日起至2020年8月24日。本基金于2020年8月27日成立,成立之日基金实收份额为10,011,021.43份(含利息



转份额11.53份)，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(含QDII基金)、香港互认基金、国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票)、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况、2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计相一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持

有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

#### 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

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(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；

(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。

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

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、基金、债券等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基

金，按所投资基金估值日的份额净值估值；对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

(b) 如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况下，本基金根据以下原则进行估值：

以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值；如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。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、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

#### 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]

85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股

期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	774,006.07	57.07
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	774,006.07	57.07
----	------------	-------

## 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	600,240.00	600,090.00
	银行间市场	-	-
	合计	600,240.00	600,090.00
资产支持证券	-	-	-
基金	9,311,845.20	9,728,624.85	416,779.65
其他	-	-	-
合计	9,912,085.20	10,328,714.85	416,629.65
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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	537,590.75	538,299.30
	银行间市场	-	-
	合计	537,590.75	538,299.30
资产支持证券	-	-	-
基金	9,467,537.35	9,868,726.23	401,188.88
其他	-	-	-
合计	10,005,128.10	10,407,025.53	401,897.43

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	66.12	1.82
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	2.86	-
应收债券利息	12,713.02	5,365.63
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.11	-
合计	12,782.11	5,367.45

注：其他为应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 其他负债

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-审计费	50,000.00	50,000.00
合计	50,000.00	50,000.00

#### 7.4.7.8 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	10,040,895.50	10,040,895.50
本期申购	6,055.63	6,055.63
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,046,951.13	10,046,951.13

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.9 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	-63,335.76	402,569.12	339,233.36
本期利润	661,886.50	14,732.22	676,618.72
本期基金份额交易产生的变动数	-30.32	310.45	280.13
其中：基金申购款	-30.32	310.45	280.13
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	598,520.42	417,611.79	1,016,132.21

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	973.98	618.87
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	42.81	178.86
其他	0.71	445.54
合计	1,017.50	1,243.27

注：其他包含存出保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期及上年度均无股票投资收益。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	25,484,519.32	14,910,329.28
减：卖出/赎回基金成本总额	24,777,370.69	14,841,190.64
基金投资收益	707,148.63	69,138.64

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日(基金合同生效 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	-1,082.15	-16.34

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	-1,082.15	-16.34

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生效日） 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	2,294,126.25	11,044.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,235,111.15	10,971.24
减：应收利息总额	60,097.25	90.06
买卖债券差价收入	-1,082.15	-16.34

注：本基金本报告期内无债转股业务。

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期内及上年度均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期及上年度均无衍生工具收益——其他投资收益。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	-	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	128,768.34	29,952.80
合计	128,768.34	29,952.80

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	14,732.22	401,897.43
——股票投资	-	-
——债券投资	-858.55	708.55
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	15,590.77	401,188.88
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	14,732.22	401,897.43

## 7.4.7.18 其他收入

本基金在本报告期及上年度均无其他收入。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	10.45	0.56
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	44,209.86	39,121.53
其中：申购费	3,413.44	2,163.14
赎回费	40,781.46	36,958.39
交易费	14.96	0.00
合计	44,220.31	39,122.09

## 7.4.7.19.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年01月0 1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基 金合同生效日）至20 20年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	13,106.00	7,452.71
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	74,750.13	21,364.85
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	14,293.37	4,250.05

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费及托管费等进行的估算，上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	-	50,000.00

证券出借违约金	-	-
汇划手续费	216.00	130.40
合计	50,216.00	100,130.40

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 7.4.9 关联方关系

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

本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。

##### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人股东
The Bank of Nova Scotia	基金管理人股东
有研科技集团有限公司	基金管理人股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人股东
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
中加国际资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

##### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度均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 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	81,492.65	26,364.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金对持有的基金管理人自身管理的基金部份不收取管理费。支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额的0.90%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额× 0.90%/当年天数

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,562.85	4,369.56

注：本基金对持有的基金托管人自身托管的基金部份不收取托管费。支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额的0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额×0.15%/当年天数。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 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

本基金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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年08月27日（基金 合同生效日）至2020年1 2月31日
基金合同生效日（2020年08月27日）持有的基金份额	0.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.53%	99.59%

#### 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年08月27日（基金合同生效日） 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
中国工商银行股份有限公司	774,006.07	973.98	57.07	618.87

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2021年12月31日的相关余额为人民币5,996.60元（2020年12月31日：人民币26.98元）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于2021年12月31日，本基金持有基金管理人中加基金管理有限公司的公开募集证券投资基金合计1,619,417.48元，（2020年12月31日：1,611,805.83元），占本基金资产净值的14.64%（2020年12月31日：15.53%）。

##### 7.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用	上年度可比期间
----	------	---------

	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年08月27日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	110.86
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,590.93	2,106.40
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,647.82	526.65

注：当期持有基金产生的应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 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

无。

#### 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

于2021年12月31日，本基金未有因认购新发/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

于2021年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，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，基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款。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

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的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控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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工商银行股份有限公司和信用风险较低的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券（不含被投资基金的基金份额），其市值不超过基金资产净值的10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含被投资基金的基金份额），不超过该证券的10%。

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

## 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	300,060.00	538,299.30
合计	300,060.00	538,299.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

## 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

## 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

## 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	-	-
AAA以下	-	-
未评级	300,030.00	-
合计	300,030.00	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票。

3. 以上数据不含同业存单及资产支持证券。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。

于2021年12月31日，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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金的流动性风险管理，按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	774,006.07	-	-	-	774,006.07
结算备付金	5,838.89	-	-	-	5,838.89
存出保证金	157.71	-	-	-	157.71
交易性金融资产	600,090.00	-	-	9,728,624.85	10,328,714.85
应收利息	-	-	-	12,782.11	12,782.11
资产总计	1,380,092.67	-	-	9,741,406.96	11,121,499.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,182.97	7,182.97
应付托管费	-	-	-	1,233.32	1,233.32
预提费用	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	58,416.29	58,416.29
利率敏感度缺口	1,380,092.67	-	-	9,682,990.67	11,063,083.34
上年度末 2020年1 2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	57.07	-	-	-	57.07
存出保证金	26.98	-	-	-	26.98
交易性金融资产	538,299.30	-	-	9,868,726.23	10,407,025.53
应收证券清算款	-	-	-	25,000.00	25,000.00
应收利息	-	-	-	5,367.45	5,367.45
应收股利	-	-	-	291.48	291.48
资产总计	538,383.35	-	-	9,899,385.16	10,437,768.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,523.84	6,523.84
应付托管费	-	-	-	1,115.81	1,115.81
预提费用	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	57,639.65	57,639.65
利率敏感度缺口	538,383.35	-	-	9,841,745.51	10,380,128.86

注：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 (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
	市场利率下降25个基点	135.02	713.25
	市场利率上升25个基点	-135.02	-713.25

#### 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。本基金主要投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金以及证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	9,728,624.85	87.94	9,868,726.23	95.07
交易性金融资产—债券投资	600,090.00	5.42	538,299.30	5.19
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	10,328,714.85	93.36	10,407,025.53	100.26
----	---------------	-------	---------------	--------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较标准以外的其他市场变量保持不变；		
	Beta系数是根据成立以来的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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
	业绩比较基准上升5%	370,539.21	-
	业绩比较基准下降5%	-370,539.21	-

于2020年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 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) 以公允价值计量的资产和负债

以下描述了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币10,328,714.85元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币9,728,624.85元，均为基金投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币600,090.00元，均为债券投资；属于第三层次的交易性金融资产为零。

于2020年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量的资产总额为人民币10,407,025.53元，属于第一层次的交易性金融资产为人民币9,868,726.23元，均为基金投资；属于第二层次的交易性金融资产为人民币538,299.30元，均为债券投资；属于第三层次的交易性金融资产为零。

于2021年12月31日及2020年12月31日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(a) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 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	9,728,624.85	87.48
3	固定收益投资	600,090.00	5.40
	其中：债券	600,090.00	5.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	779,844.96	7.01

8	其他各项资产	12,939.82	0.12
9	合计	11,121,499.63	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	600,090.00	5.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	600,090.00	5.42

## 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	019649	21国债01	3,000	300,060.00	2.71
2	019628	20国债02	3,000	300,030.00	2.71

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

本基金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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用目标风险策略，权益类资产的配置比例中性水平50%，下限40%，上限55%；在确定的配置比例内，优选相应类型基金进行配置；产品风险收益特征可类比平衡混合型基金。报告期内，本基金资产配置比例在策略范围内，子基金运作良好，产品风险收益特征符合预期。

### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000914	中加纯债	契约型 开放式	1,553,398.06	1,619,417.48	14.64	是
2	002246	泰康稳健增利C	契约型 开放式	399,352.13	569,875.49	5.15	否
3	004235	中欧价值智选回报C	契约型 开放式	106,369.75	569,716.38	5.15	否
4	001388	中融新经济C	契约型 开放式	181,288.82	543,141.30	4.91	否
5	011309	富国消费主题C	契约型 开放式	169,388.81	524,258.37	4.74	否
6	002036	安信优势增长C	契约型 开放式	166,202.40	502,280.27	4.54	否
7	012815	宝盈新兴产业C	契约型 开放式	342,896.90	429,512.66	3.88	否
8	512200	地产ETF	契约型 开放式	500,000.00	402,000.00	3.63	否
9	590010	中邮稳定收益C	契约型 开放式	362,976.40	400,725.95	3.62	否
10	012772	信达澳银精华C	契约型 开放式	270,453.01	387,829.62	3.51	否
11	000628	大成高新技术产业A	契约型 开放式	94,289.78	382,439.35	3.46	否
12	003031	安信新目标C	契约型 开放式	260,585.84	368,390.20	3.33	否
13	519714	交银消费新	契约型	146,703.7	306,317.3	2.77	否

		驱动	开放式	3	9		
14	005739	富国转型机遇	契约型 开放式	111,471.3 4	275,345.3 6	2.49	否
15	003231	创金合信医疗保健行业C	契约型 开放式	82,131.48	248,924.0 9	2.25	否
16	550009	信诚中小盘	契约型 开放式	42,280.75	242,945.1 9	2.20	否
17	006003	工银瑞信医药健康C	契约型 开放式	83,584.38	236,978.4 3	2.14	否
18	011726	安信新常态沪港深精选C	契约型 开放式	138,178.8 0	210,639.7 6	1.90	否
19	160514	博时稳健回报C	契约型 开放式	123,533.0 5	202,964.8 0	1.83	否
20	007418	泰康信用精选C	契约型 开放式	195,293.4 3	200,878.8 2	1.82	否
21	007838	国寿安保尊耀纯债C	契约型 开放式	182,448.4 6	200,729.8 0	1.81	否
22	004826	平安惠悦	契约型 开放式	185,157.1 7	200,506.7 0	1.81	否
23	007985	博时富悦纯债	契约型 开放式	184,490.5 2	200,227.5 6	1.81	否
24	161216	国投瑞银双债增利A	契约型 开放式	159,235.1 6	190,286.0 2	1.72	否
25	217011	招商安心收益C	契约型 开放式	77,249.23	132,490.1 5	1.20	否
26	011066	大成高新技术产业C	契约型 开放式	22,570.21	91,183.65	0.82	否
27	013621	华安智能生活C	契约型 开放式	33,972.27	88,620.06	0.80	否

### 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。



8.13.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.13.3 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	157.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,782.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,939.82

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
10	1,004,695.11	10,000,000.00	99.53%	46,951.13	0.47%

## 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	11,021.43	0.11%

## 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

本公司高级管理人员、基金投资研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	99.53%	10,000,000.00	99.53%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	99.53%	10,000,000.00	99.53%	3年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月27日)基金份额总额	10,011,021.43
本报告期期初基金份额总额	10,040,895.50
本报告期基金总申购份额	6,055.63
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,046,951.13

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，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

基金管理人的重大人事变动：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内应支付审计费50,000元，目前已提供审计服务的年限为2年。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	单元数量		票成交总额的比		金总量的比例	
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2. 券商及交易单元的选择流程如下：

- (1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- (2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；
- (3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核部门负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3. 投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	2,317,789.40	100.00%	3,900,000.00	100.00%	-	-	374,000.00	100.00%

### 11.9 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	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2020年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21

2	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2020年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
3	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2021年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
4	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
5	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-02
6	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
7	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-07
8	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2021年第二季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
9	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2021年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
10	中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2021年第三季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-26

## § 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	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	99.53%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

## 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、中国证监会批准中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)设立的文件
- 2、《中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》
- 3、《中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区复兴门内大街55号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司  
二〇二二年三月三十日