

国元元赢四个月定期开放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:国元证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月31日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年10月28日起至2021年12月31日止

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	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.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
8.12 投资组合报告附注.....	42
§9 基金份额持有人信息.....	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	45
§10 开放式基金份额变动.....	45
§11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
11.8 其他重大事件.....	46
§12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划
基金简称	国元元赢四个月定开债
基金主代码	970070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月28日
基金管理人	国元证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	445,732,460.88份
基金合同存续期	3年

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求资产安全性的基础上，力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。
投资策略	<p>一、本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本集合计划债券资产的投资比例不受上述比例限制。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%。开放期内，本集合计划持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> <p>二、本集合计划的投资策略包括类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富(1-3年)指数（代码：CBA00121.

	CS) 收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。
--	----------------------------

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		国元证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张社平	张燕
	联系电话	0551-62207188	0755-83199084
	电子邮箱	zhangsheping@gyzq.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95578/4008888777	95555
传真		0551-62696501	0755-83195201
注册地址		安徽省合肥市梅山路18号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		230001	518040
法定代表人		俞仕新	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gyzq.com.cn/
基金年度报告备置地点	安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17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	本期2021年10月28日（基金合同生效日）- 2021年12月31日
本期已实现收益	3,410,791.71
本期利润	4,698,704.16
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.08%
本期基金份额净值增长率	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末
期末可供分配利润	14,199,357.79
期末可供分配基金份额利润	0.0319
期末基金资产净值	461,201,086.82
期末基金份额净值	1.0347
3.1.3 累计期末指标	2021年末
基金份额累计净值增长率	1.08%

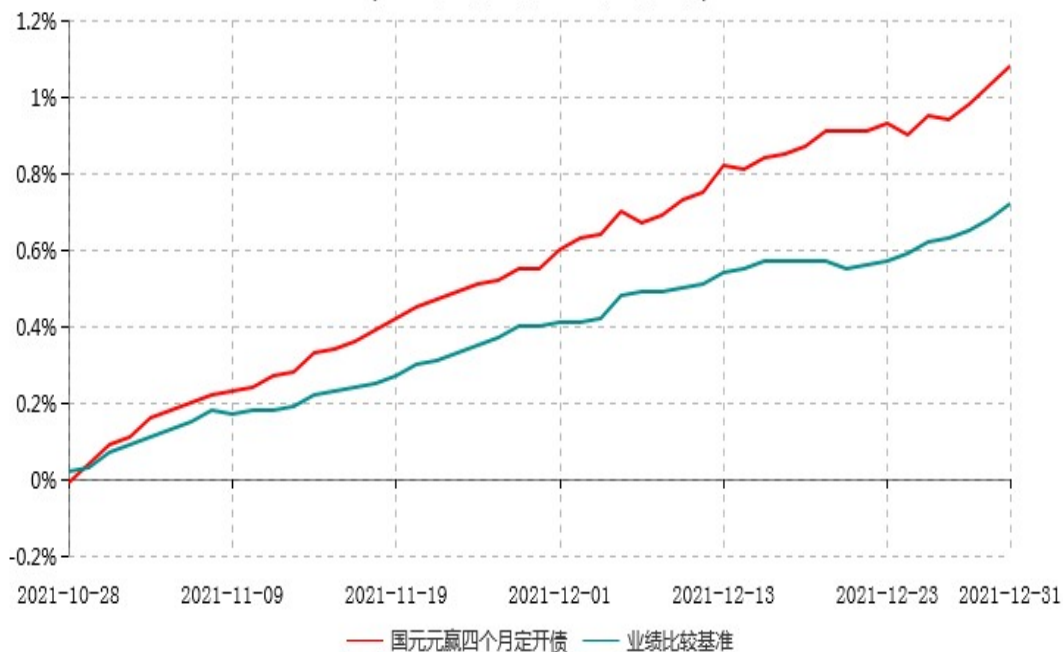
3.2 基金净值表现

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

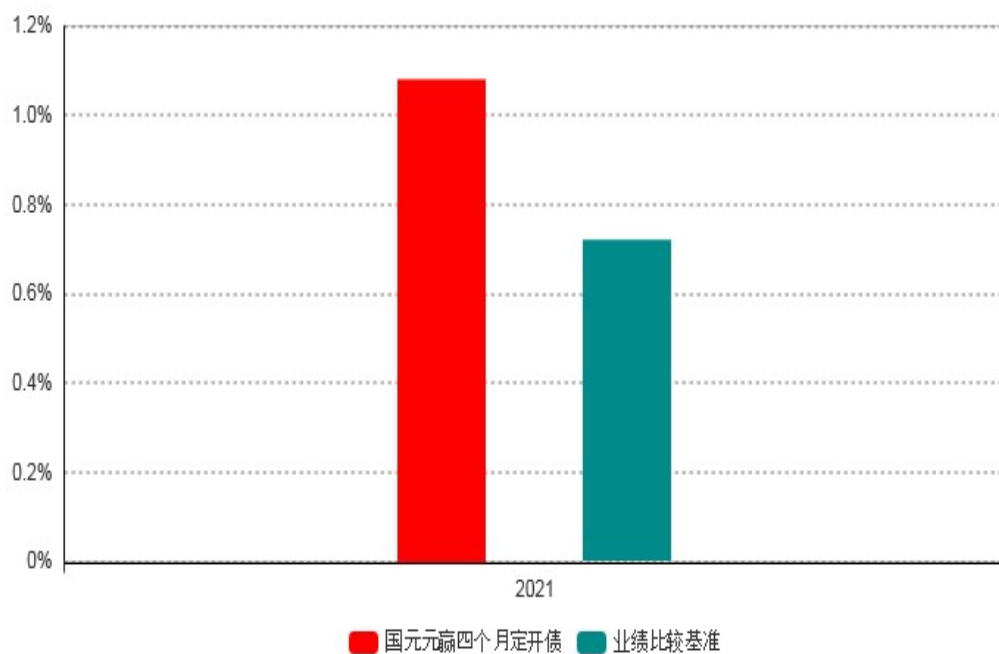
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.08%	0.02%	0.72%	0.01%	0.36%	0.01%

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

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年10月28日-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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效以来尚未进行利润分配。

§ 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

国元证券股份有限公司由原安徽省国际信托投资公司和原安徽省信托投资公司作为主发起人发起成立于2001年10月，并于2007年10月，公司借壳“北京化二”在深圳证券交易所成功上市，股票代码：000728。公司法人代表为俞仕新先生，目前公司注册资本43.64亿元人民币，注册地安徽省合肥市。国元证券根据《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》的要求对原大集合产品进行公募化改造，截至2021年12月31日，旗下已有1只大集合产品完成公募化改造，即本产品“国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏真辉	大集合产品投资经理	2013-05-29	-	14	中国科学技术大学金融学硕士。2008年2月加入国元证券客户资产管理总部，历任研究员、投资助理，现任国元元赢四个月定期开债、国元元赢六个月定期开债投资经理。
李雅婷	大集合产品投资经理	2019-11-08	-	12	南开大学金融学硕士。曾任职于中国工商银行安徽省分行营业部，2012年8月加入国元证券资管总部，历任投资助理，现任国元

					元赢一个月定开债、国元元赢四个月定开债、国元元增利投资经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

管理人声明：本报告期内，本管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法（2020修订）》，建立了科学、合理的投资决策体系，加强了对交易环节的内部控制，并通过风控系统对投资、交易环节的控制来保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本管理人一贯公平对待旗下管理的所有组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次。

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

本产品于2021年10月28日正式完成公募化改造。

债市回顾：国庆节后受大宗涨价、地方债提前完成发行传言等因素共振下，10年国债收益率一度向上突破3%的关键点位，后在多部委联合调控的行政干预下，通胀担忧得

到缓解，降准预期和12月初的降准推动收益率重回下行通道。但随着绝对收益率逐步逼近历史低点，12月市场在宽信用预期和基本面疲弱的观点之间来回震荡，最终10年国债收于2.7754%。

转债市场回顾：可转债继续高歌猛进，且涨幅高于主要A股指数，且体现出较强的抗跌性。12月以新能源为代表的高估值板块出现明显回调，带动相关转债出现下跌，而低估值转债表现亮眼，高弹性和低估值类转债向中枢收敛。

组合操作：我们继续严格遵照产品合同的相关约定，优化资产配置结构，提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢四个月定开债基金份额净值为1.0347元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.72%。

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1月新增社融和新增人民币贷款数据均创历史新高，显示出金融机构积极落实中央会议精神的决心和行动，但一季度历来是金融机构投放高峰，宽信用效果还需观察社融增量的持续性和其他政策的配合力度。

经历了永煤和房企违约事件冲击后，整个市场风险偏好依然未明显恢复，结构性资产荒依然存在，中高等级信用债仍稀缺，因此，策略上依然坚持安全性好的中高等级信用债为主，适时配置。

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，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。合规管理方面，面对新形势新挑战，公司紧跟最新法律法规要求，贯彻落实最新监管精神，通过合规审查、合规检查、合规咨询等多项措施，压实合规职责，提升内控质量，严格防范大集合业务可能出现的各类合规风险；以风险为导向实施差异化管理，对资管业务核心环节重点关注，加强合规检查，强化问题整改落实。同时，为提升员工合规意识，持续开展线上线下全方位、多角度的合规培训，如新员工合规培训、专项合规培训、法制专题宣传等，严把新员工入职的合规意识，并持续在员工执业过程中加强传导各项法律法规和监管政策精神，将合规文化贯穿于公司和每位员工的业务开展环节。风险管理方面，公司风险监管部立足职责定位，负责督促客户资产管理总部落实公司风险管理决策和 risk 管理制度，对投资及交易重点指标进行监控，对异常或违规行为进行调查和报告，确保大集合业务符合公司风险偏好。稽核方面，公司稽核审计部将公司大集合业务纳入公司整体稽核范畴，对大集合业务风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价，对资产管理业务不定期开展常规稽核工作，通过实施询问、观察、检查、

核对、分析性复核等必要的稽核程序，以监督、评价公司资产管理业务的经营业绩、内控制度的建立与执行、合规风控管理等情况。此外，公司内控部门每年度定期组织开展公司层面内部控制评价工作和合规管理有效性评估工作，检查范围包括资产管理业务内部控制情况、产品设计、投资者保护、推广募集、投资运作、投资顾问、估值核算、信息披露和公平交易等内容，不断提高资管业务内部控制和合规管理水平，加强稽核监督力量。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本产品自 2021 年 10 月 28 日合同生效以来暂无利润分配。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200、资产净值低于 5000 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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	容诚审字[2022]230Z1380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	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称元赢四个月定开债）的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年10月28日至2021年12月31日的利润表、所有者权益（计划净值）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企业会计准则的规定编制，公允反映了元赢四个月定开债2021年12月31日的财务状况以及2021年10月28日至2021年12月31日的经营成果和所有者权益（计划净值）变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于元赢四个月定开债，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>元赢四个月定开债管理人（以下简称管理人）对其他信息负责。其他信息包括元赢四个月定开债 2021 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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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，管理人负责评估元赢四个月定开债的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非管理人计划清算元赢四个月定开债、终止运营或别无其他现实的选择。管理人负责监督元赢四个月定开债的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导</p>

	<p>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，就可能对元赢四个月定开债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元赢四个月定开债不能持续经营。（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。我们与管理人就计划的审计范围、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。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪玉寿、陈雪、洪雁南
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26
审计报告日期	2022-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国元元赢四个月定期开放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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	1,723,837.01
结算备付金		3,449,926.24
存出保证金		10,722.00
交易性金融资产	7.4.7.2	453,343,762.95
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		428,298,762.95
资产支持证券投资		25,045,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	7.4.7.3	43,830,000.00
应收证券清算款		4,187,459.46
应收利息	7.4.7.4	10,039,299.41
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		516,585,007.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
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		55,000,000.00

应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		195,318.44
应付托管费		58,595.52
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.5	3,205.04
应交税费		61,441.94
应付利息		15,359.31
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	50,000.00
负债合计		55,383,920.25
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.7	445,732,460.88
未分配利润	7.4.7.8	15,468,625.94
所有者权益合计		461,201,086.82
负债和所有者权益总计		516,585,007.07

7.2 利润表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年10月28日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
一、收入		5,444,498.46
1. 利息收入		3,919,834.65
其中：存款利息收入	7.4.7.9	16,999.45
债券利息收入		3,269,149.35
资产支持证券利息收入		314,332.91

买入返售金融资产收入		319,352.94
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		236,751.36
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.4	236,757.17
资产支持证券投资收益	7.4.7.10.3	-5.81
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	1,287,912.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		745,794.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	387,686.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	116,653.91
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.12	3,268.20
5. 利息支出		200,741.95
其中：卖出回购金融资产支出		200,741.95
6. 税金及附加		12,146.32
7. 其他费用	7.4.7.13	25,297.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,698,704.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,698,704.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）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)	248,122,373.96	5,861,039.89	253,983,413.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,698,704.16	4,698,704.16
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)	197,610,086.92	4,908,881.89	202,518,968.81
其中：1. 基金申购款	211,622,545.77	5,256,888.61	216,879,434.38
2. 基金赎回款	-14,012,458.85	-348,006.72	-14,360,465.57
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)	445,732,460.88	15,468,625.94	461,201,086.82

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：

沈和付

吴边

司开铭

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

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由国元元赢2号债券分级集合资产管理计划变更而来。原集合计划为分级型限定性集合资产管理计划，是由国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）作为计划管理人，招商银行股份有限公司作为计划托管人的限定性集合资产管理计划。国元元赢2号债券分级集合资产管理计划自2013年5月16日起开始募集并于2013年5月23日结束募集，于2013年5月29日成立。中国证券业协会于2013年5月31日出具了备案确认函。

2020年7月15日，国元元赢2号债券分级集合资产管理计划变更为国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划，产品不再分级，仅有一类份额，每一份额共担风险、共享收益。

2021年10月28日，国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划变更为国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划，本集合计划自合同生效日起存续期不得超过3年，自合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。变更后本集合计划为契约型开放式。

投资范围：本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具。本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转债转股和可交换债券换股所形成的股票，必须在转股后10个交易日内卖出。

业绩比较基准：中债新综合财富(1-3年)指数（代码：CBA00121.CS）收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。

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（以下统称“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》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021年 12 月 31 日的财务状况以及 2021年10月28日至2021年12月31日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

7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本财务报表的实际编制期间自2021年10月28日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本集合计划目前以交易目的持有的债券投资、股票投资等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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（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。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划计价持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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，才可使用不可观察输入值。

（3）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，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：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；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。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计划份额总额在扣除损益平准金分摊部分后所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本计划申购确认日及本计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本计划转换所引起的转入本计划的实收基金增加和转出本计划的实收基金减少。

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在集合计划份额发生变动时，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集合计划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

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

基金红利收入按基金公司宣告的分红比例计算的金额确认。

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。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为本计划费用计入当年损益。

本计划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。

本计划的其他费用如不影响估值日本计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入本集合计划损益；如果影响本集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入本集合计划损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一计划份额享有同等的分配权；当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；分配收益后每份额净值不能低于发行面值；分红后集合计划总份额不得超过最高规模限制；在符合上述分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为12次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若本集合计划合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，通过管理人网站和推广网点通告委托人。

本集合计划的收益分配包括现金分红和红利转份额两种方式。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；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。若投资者选择现金红利转换为相应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日，且需满足相应类别持有期的规定。

7.4.4.12 外币交易

本报告期间本集合计划无需说明的外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、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。本集合计划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

本报告期间本集合计划无其他需要披露的重要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

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

增值税及附加税金

根据财政部和国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，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。此外，应按照增值税的7%计算城市建设维护税，按增值税的3%计算教育费附加，地方教育附加应按照本集合计划管理人所在地税务机关规定的比例计算。对资管产品在2018年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

所得税

本集合计划非所得税纳税主体。资产管理计划份额持有人从资产管理计划中获得的各项收益，由资产管理计划份额持有人根据国家的法律法规，自行申报并履行纳税义务。

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
活期存款	1,723,837.01
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	1,723,837.01

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	254,873,107.38	1,024,655.57
	银行间市场	172,556,833.80	-155,833.80
	合计	427,429,941.18	868,821.77
资产支持证券	25,119,750.00	25,045,000.00	-74,750.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	452,549,691.18	453,343,762.95	794,071.77

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	43,830,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	43,830,000.00	-

7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	585.70
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	1,709.08
应收债券利息	9,599,271.97
应收资产支持证券利息	333,904.11
应收买入返售证券利息	103,823.27
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.28
合计	10,039,299.41

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	3,205.04
合计	3,205.04

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	50,000.00
合计	50,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	248,122,373.96	248,122,373.96
本期申购	211,622,545.77	211,622,545.77
本期赎回（以“-”号填列）	-14,012,458.85	-14,012,458.85
本期末	445,732,460.88	445,732,460.88

7.4.7.8 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
基金合同生效日	5,932,081.17	-71,041.28	5,861,039.89
本期利润	3,410,791.71	1,287,912.45	4,698,704.16
本期基金份额交易产生的变动数	4,856,484.91	52,396.98	4,908,881.89
其中：基金申购款	5,200,828.16	56,060.45	5,256,888.61
基金赎回款	-344,343.25	-3,663.47	-348,006.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,199,357.79	1,269,268.15	15,468,625.94

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	活期存款利息收入	10,375.53
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	6,597.83
其他	26.09
合计	16,999.45

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）至2021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	236,757.17
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	236,757.17

7.4.7.10.2 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10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	90,829,923.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	88,188,530.06
减：应收利息总额	2,404,636.30
买卖债券差价收入	236,757.17

7.4.7.10.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	13,159,314.00
减：卖出资产支持证券成本总额	13,000,500.00
减：应收利息总额	158,819.81
资产支持证券投资收益	-5.81

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	1,287,912.45
——股票投资	-
——债券投资	1,362,662.45
——资产支持证券投资	-74,750.00
——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	1,287,912.45

7.4.7.12 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	443.20
银行间市场交易费用	2,825.00
合计	3,268.20

7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	15,035.01
信息披露费	-
TA服务费	10,262.32
帐户维护费	-
合计	25,297.33

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

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明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
国元证券股份有限公司	集合计划的管理人和销售机构
招商银行股份有限公司	集合计划的托管人
安徽国元金融控股集团有限责任公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
安徽国元信托有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
建安投资控股集团有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东

注：因管理人关联方过多，此处仅披露管理人、托管人及持有管理人5%以上股份的股东。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

本集合计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内无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10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
国元证券股份有限 公司	138,828,152.98	100.00%

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10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
国元证券股份有限 公司	1,347,748,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	387,686.59
其中：支付销售机构的客户维护费	-

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2021年10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	116,653.91

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

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

截至2021年12月31日，管理人运用固有资金持有的本集合计划份额余额为4,014,411.53份。

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

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10月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,723,837.01	10,375.53

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间本集合计划未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-29	-	新债未上市	100.00	100.00	4,440	444,000.00	444,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的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2021年12月31日，本集合计划从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为0。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至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清算款余额为55000000.00元，在2022年1月4日到期。该类交易要求集合计划转入质押库的债券，按照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

集合计划的管理人建立与实施内部控制，遵循下列原则：（一）全面性原则。内部控制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司的所有业务、部门和人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节和过程，确保不存在内部控制的重大空白或漏洞。

（二）重要性原则。内部控制应在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域。

（三）制衡性原则。内部控制应在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。（四）适应性原则。内部控制应符合国家

有关法律法规和中国证监会的有关规定，与公司经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，应权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制，并随着情况的变化及时加以调整。（五）独立性原则：承担内部控制监督检查职能的部门应当独立于公司其他部门；业务部门中后台岗位独立于业务操作岗位。

集合计划的管理人风险管理组织架构由四个层次构成，分别为：公司董事会及下设的风险管理委员会；经营管理层及下设的风控与合规委员会等非常设机构；包括风险监管部、内核办公室、合规法务部、审计监察部、信息技术总部、资金计划部、董事会办公室、运营总部等在内的履行风险管理相关职能的部门；各业务部门及内设的风险管理岗位。

集合计划的管理人董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，履行以下职责：（一）推进风险文化建设；（二）审议批准公司全面风险管理的基本制度；（三）审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；（四）审议公司定期风险评估报告；（五）任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；（六）建立与首席风险官的直接沟通机制；（七）公司章程规定的其他风险管理职责。董事会设立风险管理委员会，按照公司章程和董事会《风险管理委员会工作细则》的规定履行职责和义务。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。

集合计划的管理人监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

集合计划的管理人经营管理层对全面风险管理承担主要责任，履行以下职责：（一）制定风险管理制度，并适时调整；（二）建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；（三）制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实；对其进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；（四）定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；（五）建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；（六）建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制；（七）根据法律法规的要求和董事会授权的其他风险管理职责。

集合计划的管理人设立风控与合规委员会、信息技术治理委员会、财富管理业务委员会、固定收益业务领导小组、权益投资业务领导小组、资产管理业务领导小组、投行类业务内核领导小组、场外业务领导小组、信用业务审核小组等非常设机构，根据公司授权履行在各自的业务管理、决策范围内的风险管控职责和义务。

集合计划的管理人相关风险管理职能部门在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供全流程（尤其是事前与事中）的风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

7.4.13.2 信用风险

债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本集合计划面临信用风险。

集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在非集中交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划对不同信用等级的信用债投资比例有严格限制，债项评级AA信用债的投资比例不超过集合计划信用债资产的20%，债项评级AAA信用债的投资比例不低于集合计划信用债资产的50%，有效防范了信用风险的发生。

7.4.13.2.1 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
AAA	279,961,878.80
AAA以下	148,336,884.15
未评级	-
合计	428,298,762.95

7.4.13.2.2 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
AAA	-
AAA以下	25,045,000.00
未评级	-
合计	25,045,000.00

7.4.13.3 流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将债券买进或卖

出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售债券。

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具等，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

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。

本集合计划的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,723,837.01	-	-	-	-	-	1,723,837.01
结算备付金	3,449,926.24	-	-	-	-	-	3,449,926.24
存出保证金	10,722.00	-	-	-	-	-	10,722.00
交易性金融资产	36,343,200.00	13,372,956.50	98,756,865.18	176,452,000.00	128,418,741.27	-	453,343,762.95
买入返售金融资产	43,830,000.00	-	-	-	-	-	43,830,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,187,459.46	4,187,459.46

应收利息	-	-	-	-	-	10,039,299.41	10,039,299.41
资产总计	85,357,685.25	13,372,956.50	98,756,865.18	176,452,000.00	128,418,741.27	14,226,758.87	516,585,007.07
负债							
卖出回购金融资产款	55,000,000.00	-	-	-	-	-	55,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	195,318.44	195,318.44
应付托管费	-	-	-	-	-	58,595.52	58,595.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,205.04	3,205.04
应交税费	-	-	-	-	-	61,441.94	61,441.94
应付利息	-	-	-	-	-	15,359.31	15,359.31
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	55,000,000.00	-	-	-	-	383,920.25	55,383,920.25
利率敏感度缺口	30,357,685.25	13,372,956.50	98,756,865.18	176,452,000.00	128,418,741.27	13,842,838.62	461,201,086.82

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本集合计划资产净值将不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

无

7.4.13.4.3 其他价格风险

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	
	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	-	-
交易性金融资产—债券投资	428,298,762.95	92.87
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	25,045,000.00	5.43
合计	453,343,762.95	98.30

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

截至2021年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为428298762.95元，属于第二层次的余额为25045000.00元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	453,343,762.95	87.76
	其中：债券	428,298,762.95	82.91
	资产支持证券	25,045,000.00	4.85
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	43,830,000.00	8.48
	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	5,173,763.25	1.00
8	其他各项资产	14,237,480.87	2.76
9	合计	516,585,007.07	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无

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

无

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	329,354,238.60	71.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	70,600,000.00	15.31
7	可转债(可交换债)	28,344,524.35	6.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	428,298,762.95	92.87

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	184097	21六安债	400,000	40,520,000.00	8.79
2	152586	20蒙城债	300,000	30,666,000.00	6.65
3	2080102	20井开债	250,000	24,787,500.00	5.37

4	101901008	19铜陵建投MTN 001	200,000	20,618,000.00	4.47
5	152297	19张建发	200,000	20,372,000.00	4.42

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	146285	武夷优03	250,000	25,045,000.00	5.43

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

无

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

无

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体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。

8.12.2 本集合计划本报告期末未持有股票资产。

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	10,722.00
2	应收证券清算款	4,187,459.46
3	应收股利	-
4	应收利息	10,039,299.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,237,480.87

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	132011	17浙报EB	8,136,000.00	1.76
2	113011	XD光大转	2,484,875.20	0.54
3	113050	南银转债	1,449,175.00	0.31
4	132021	19中电EB	1,419,180.00	0.31
5	123077	汉得转债	1,148,930.00	0.25
6	127032	苏行转债	1,130,600.00	0.25
7	113044	大秦转债	1,094,400.00	0.24
8	113042	上银转债	1,055,300.00	0.23
9	110073	国投转债	984,470.00	0.21
10	113037	N紫银转	868,240.00	0.19
11	113584	家悦转债	722,327.00	0.16
12	128114	正邦转债	655,020.00	0.14
13	113623	凤21转债	629,150.00	0.14
14	110068	龙净转债	582,321.70	0.13

15	128105	长集转债	557,800.00	0.12
16	113589	天创转债	522,883.20	0.11
17	110080	N东湖转	503,235.00	0.11
18	128075	远东转债	496,204.80	0.11
19	127016	鲁泰转债	446,574.68	0.10
20	128083	新北转债	352,500.00	0.08
21	123064	万孚转债	346,590.00	0.08
22	113033	利群转债	334,966.50	0.07
23	128132	交建转债	323,195.40	0.07
24	113563	柳药转债	231,900.00	0.05
25	113036	宁建转债	227,540.00	0.05
26	123048	应急转债	210,780.00	0.05
27	110052	贵广转债	157,809.60	0.03
28	110056	亨通转债	131,950.00	0.03
29	128130	景兴转债	128,540.00	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

§ 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
2,830	157,502.64	28,453,938.01	6.38%	417,278,522.87	93.62%

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	6,316,610.38	1.42%
------------------	--------------	-------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年10月28日)基金份额总额	248,122,373.96
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	211,622,545.77
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,012,458.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	445,732,460.88

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

自2022年2月24日起，沈和付担任国元证券股份有限公司总经理职务，陈新先生不再担任国元证券股份有限公司总经理职位，于强先生不再担任国元证券股份有限公司副总经理的职位。

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所为容诚会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期应支付给容诚会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币50,000.00元。

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

1、本资管计划管理人国元证券于2021年11月26日收到中国证监会警示函,指出“公司存在资产管理产品运作不规范,投资决策不审慎,投资对象尽职调查和风险评估不到位等问题,违反了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第六十一条规定。”

2、本报告期内,基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国元证券	138,828,152.98	100.00%	1,347,748,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国元证券股份有限公司国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

12.3 查阅方式

上述文件可在国元证券网站上查阅，或者在营业时间内到国元证券查阅。
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国元证券股份有限公司。
客户服务中心电话：95578
网址：www.gyzq.com.cn

国元证券股份有限公司
二〇二二年三月三十一日