
嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期: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、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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金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 | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 11 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 12 |
| 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 | 14 |
| 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 | 17 |
| 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 | 17 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 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真实、准确和完整发表意见 | 18 |
| §6 审计报告 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 18 |
| §7 年度财务报表 | 21 |
| 7.1 资产负债表 | 21 |
| 7.2 利润表 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 24 |
| 7.4 报表附注 | 26 |
| §8 投资组合报告 | 55 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 55 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 56 |
| 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 | 56 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 56 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 56 |
| 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 | 57 |
| 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 | 57 |
| 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 | 58 |
| 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 | 58 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 58 |

| | |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 58 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 58 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 59 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 59 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 60 |
| 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..... | 60 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 61 |
| §11 重大事件揭示..... | 61 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 62 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 62 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 62 |
| 11.8 其他重大事件..... | 63 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 66 |
| 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..... | 66 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 66 |
| §13 备查文件目录..... | 66 |
| 13.1 备查文件目录..... | 66 |
| 13.2 存放地点..... | 66 |
| 13.3 查阅方式..... | 66 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------------|---------------|
| 基金名称 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 嘉合慧康63个月定开债券 | |
| 基金主代码 | 009673 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020年08月04日 | |
| 基金管理人 | 嘉合基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 7,999,034,347.66份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009673 | 009674 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,999,027,678.28份 | 6,669.38份 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| | | |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

| | | | |
|---------|---------------------|------------------------|----------------------|
| 名称 | 嘉合基金管理有限公司 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 崔为中 | 田东辉 |
| | 联系电话 | 021-60168288 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | cuiweizhong@haoamc.com | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话 | 400-0603-299 | 95580 | |
| 传真 | 021-65015077 | 010-68858120 | |
| 注册地址 | 上海市虹口区广纪路738号1幢329室 | 北京市西城区金融大街3号 | |
| 办公地址 | 上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼 | 北京市西城区金融大街3号A座 | |
| 邮政编码 | 200082 | 100808 | |
| 法定代表人 | 金川 | 张金良 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.haoamc.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

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) | 上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼 |
| 注册登记机构 | 嘉合基金管理有限公司 | 上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼 |

§ 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04日（基金合同生效日）-2020年12月31日 | |
|---------------|------------------|---------------|----------------------------------|---------------|
| | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C |
| 本期已实现收益 | 287,738,386.69 | 232.37 | 104,083,388.64 | 83.81 |
| 本期利润 | 287,738,386.69 | 232.37 | 104,083,388.64 | 83.81 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0360 | 0.0348 | 0.0130 | 0.0126 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.57% | 3.46% | 1.29% | 1.25% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.64% | 3.52% | 1.30% | 1.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021年末 | | 2020年末 | |
| 期末可供分配利润 | 39,864,557.26 | 22.80 | 40,091,167.18 | 30.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0050 | 0.0034 | 0.0050 | 0.0046 |
| 期末基金资产净值 | 8,038,892,235.54 | 6,692.18 | 8,039,118,842.31 | 6,699.13 |
| 期末基金份额净值 | 1.0050 | 1.0034 | 1.0050 | 1.0046 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021年末 | | 2020年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 4.99% | 4.83% | 1.30% | 1.26% |

注：1、本基金合同生效日为2020年8月4日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

3、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉合慧康63个月定开债券A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.92% | 0.01% | 0.82% | 0.01% | 0.10% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.84% | 0.01% | 1.64% | 0.01% | 0.20% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.64% | 0.01% | 3.25% | 0.01% | 0.39% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.99% | 0.01% | 4.58% | 0.01% | 0.41% | 0.00% |

嘉合慧康63个月定开债券C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.89% | 0.01% | 0.82% | 0.01% | 0.07% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.79% | 0.01% | 1.64% | 0.01% | 0.15% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.52% | 0.01% | 3.25% | 0.01% | 0.27% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.83% | 0.01% | 4.58% | 0.01% | 0.25% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉合慧康63个月定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年08月04日-2021年12月31日)



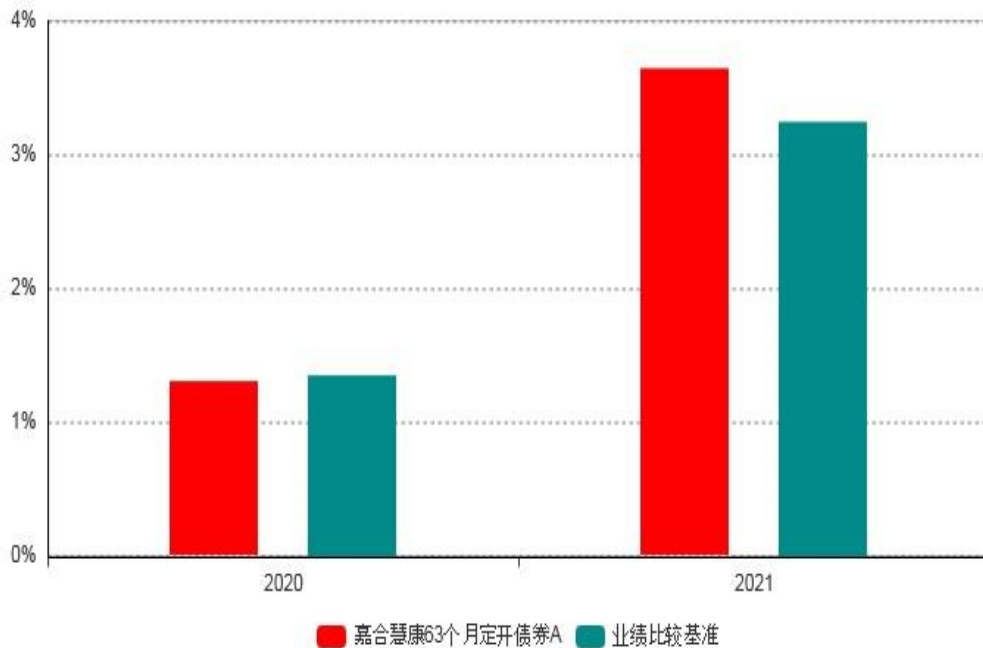
注：本基金基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效，按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

嘉合慧康63个月定开债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年08月04日-2021年12月31日)

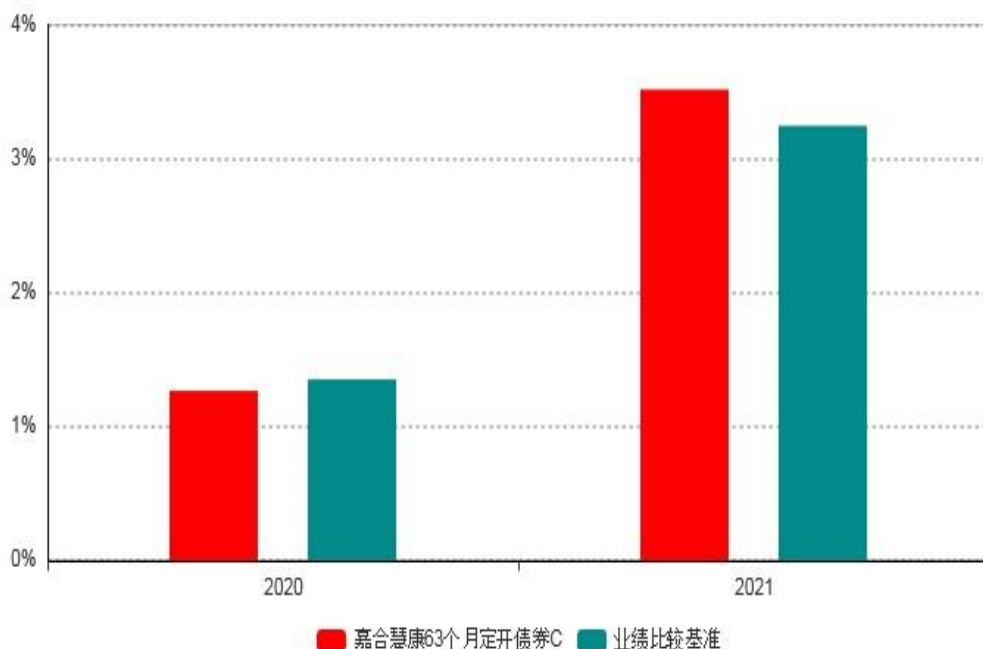


注：本基金基金合同于 2020 年 08 月 04 日生效，按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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



注：图中列示的 2020 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。



注：图中列示的 2020 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

嘉合慧康63个月定开债券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 | 0.360 | 287,964,993.46 | 3.15 | 287,964,996.61 | - |
| 2020年 | 0.080 | 63,992,221.38 | 0.08 | 63,992,221.46 | - |
| 合计 | 0.440 | 351,957,214.84 | 3.23 | 351,957,218.07 | - |

嘉合慧康63个月定开债券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 | 0.360 | 239.32 | 0.72 | 240.04 | - |
| 2020年 | 0.080 | 53.34 | - | 53.34 | - |
| 合计 | 0.440 | 292.66 | 0.72 | 293.38 | - |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”或“公司”）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2021年12月31日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2021年12月31日，嘉合基金旗下共管理21只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合消费升级混合型发起式证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合医疗健康混合型发起式证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|-----|--|
| 季慧娟 | 嘉合货币市场基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。 | 2020-08-04 | - | 14年 | 上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士，拥有14年金融行业从业经验。曾任华宝信托有限责任公司交易员，德邦基金管理有限公司债券交易员兼研究员，中欧基金管理有限公司债券交易员。2014年加入嘉合基金管理有限公司。 |
|-----|--|------------|---|-----|--|

注：1、季慧娟的“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《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，制定了《嘉合基金管理有限公司公平交易制度》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告公司管理层。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年，新冠病毒多次变异，传播速度加快，疫情继续影响全球。供应链瓶颈导致欧美各国通胀持续冲高，美联储开始缩减QE。2021年国内宏观经济整体逐步走弱，上半年经济延续修复态势，工业生产和出口强劲。下半年，随地产投资的回落，能耗双控，疫情多发等负面影响，经济下行压力持续增大。全球大宗商品价格上涨，PPI同比读数明显走高，CPI温和上涨。

2021年货币政策灵活精准、合理适度，前瞻性、稳定性、自主性进一步提升。央行综合运用多种货币政策工具投放流动性，增加结构性货币政策工具。2021年7月下调存款准备金率0.5个百分点，12月再次下调存款准备金率0.5个百分点，同月20日，下调1年期LPR 5个基点至3.80%。除此之外，通过每日公开市场操作和中期借贷便利（MLF）灵活调整，及时对冲市场因素。除1月底和11月底流动性紧张外，整年大部分时间市场流动性均处于宽松状态。

2021年债券市场呈现震荡上涨走势，10年国债、国开收益率全年分别下行约40BP和50BP，整体来说中长端好于短端，政金债好于国债。全年最大的回调来自于1月下旬资金紧张带来对货币政策转向的担忧，债券收益率快速上行。随后在资金宽松和机构欠配背景下，债券收益率缓慢下行。6月受通胀因素影响，市场行情有所波动，6月初市场调整较快，随着央媒表态和中长期存款利率下降后，债市重新反转叠加超预期降准，债券收益率快速下行。10月进一步宽松预期落空，市场快速大幅调整，随后在工业品价格高位回落，央行大幅投放和年末降准降息的作用下，收益率迅速下行，除一年期限外，其他期限均创下年内新低。

本基金在报告期内，增配了期限匹配的政策性金融债，提高了账户杠杆率，动态调整融资期限机构和融资场所尽量降低融资成本。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券A基金份额净值为1.0050元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.64%，同期业绩比较基准收益率为3.25%；截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券C基金份额净值为1.0034元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.52%，同期业绩比较基准收益率为3.25%。

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，中央经济工作会议指出，当前我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重压力。除供给冲击在政策纠偏下情况有所缓解外，需求收缩和预期转弱压力仍然较大，且分部门来看可发力点较少。出口虽仍保持韧性，但从领先指标来看出口持续收缩，随着全球疫情的逐渐恢复，出口对于经济的拉动作用可能削弱。“宽信用”政策发力面临城投债务扩张的约束、地产有“房住不炒”底线的刚性，“宽信用”生效也面临一定难度，未来稳增长的主体尚不明晰，路径不太明确。经济预期普遍偏弱下，宏观政策的总基调为“稳字当头、稳中求进”，继续做好“六稳”、“六保”工作，在稳增长基调下，积极的财政政策要保证财政支出强度，加快支出进度，适当超前开展基础设施建设，加快实物投放量。

央行四季度货币政策报告也强调了我国经济面临的三重压力，外部环境更趋复杂严峻和不确定。在稳增长强烈需求下，货币政策也将坚持稳字当头、稳中求进，为保持经济运行在合理区间营造适宜的货币金融环境，发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能，注重充足、精准、靠前发力，因此货币政策预计将较长一段时间保持流动性合理充裕，不过也看到央行对于发达经济体货币政策调整的关注，结构性货币政策更有空间。

经济下行压力加大，经济转型、稳增长背景下货币政策相对平稳，房地产去金融化和城投隐形债务管控持续化，理财净值化延续，结构性欠配仍然存在。但债券整体收益率相对较低，与2020年疫情低点空间缩窄，债市震荡纠结。关注宽信用政策见效力度和出口数据，做好各种预期差的准备。广义基金的资产需求和市场谨慎的态度可能使债市线条拉长，波动增大且反应速度较快。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人以保障基金份额持有人的利益为宗旨，为了保证公司合规运作、加强内部控制，防范经营风险，公司监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用日常检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司合规管理及内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层及上级监管部门。

本基金管理人开展的主要工作包括：

- (1) 加强合规宣导与培训，构建合规文化建设的长效机制

通过组织全体员工开展对法律法规、监管动态、最新案例等的学习，使员工从思想上提高合规理念，从实践中增强合规操作，确保其行为守法合规、严格自律、恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 修订管理制度，完善各项业务流程

根据监管的最新法规政策要求，结合公司业务的发展，及时更新公司各项管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范合规风险。

(3) 认真开展基金信息披露工作

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，不断规范完善信息披露流程，明确各条线的职责分工，及时履行信息披露工作，确保信息披露的真实性、准确性、及时性和完整性。

(4) 稳步做好各项法律合规管理工作

针对公司新产品、新业务，及时提供合规咨询，并进行合规审查和合规建议；认真审核公司及产品各项法律文件，严控法律风险；结合业务的风险点，定期/不定期开展合规检查工作，提出整改建议，提升公司合规管理水平。

(5) 积极履行反洗钱义务

根据中国人民银行及中国证监会的最新监管要求，完善公司反洗钱管理制度，优化反洗钱工作流程，并对反洗钱相关信息系统进行升级改造，加强客户身份识别工作，认真甄别分析可疑交易。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产、不断提高投资管理工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金于2021年3月18日，2021年06月21日，2021年09月16日和2021年12月10日实施利润分配。于2021年3月18日嘉合慧康63个月定开债券A每10份基金份额派发红利0.100元，嘉合慧康63个月定开债券C每10份基金份额派发红利0.100元；于2021年06月21日嘉合慧康63个月定开债券A每10份基金份额派发红利0.080元，嘉合慧康63个月定开债券C每10份基金份额派发红利0.080元；于2021年09月16日嘉合慧康63个月定开债券A每10份基金份额派发红利0.100元，嘉合慧康63个月定开债券C每10份基金份额派发红利0.100元；于2021年12月10日嘉合慧康63个月定开债券A每10份基金份额派发红利0.080元，嘉合慧康63个月定开债券C每10份基金份额派发红利0.080元。

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

本报告期内无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金共进行利润分配28796.523665万元。

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、投资组合报告等数据真实、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2200097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 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了后附的嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“嘉合慧康63个月定开债券基金”）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，公允反映了嘉合慧康63个月定开债券基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果及基金净值变动情况。 |
| 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，我们独立于嘉合慧康 |

| | |
|-----------------|---|
| | 63个月定开债券基金，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 | 嘉合慧康63个月定开债券基金管理人嘉合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括嘉合慧康63个月定开债券基金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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉合慧康63个月定开债券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，除非嘉合慧康63个月定开债券基金计划进行清算、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嘉合慧康63个月定开债券基金的财务报告过程。 |
| 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，就可能对嘉合慧康63个月定期开放债券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嘉合慧康63个月定期开放债券基金不能持续经营。（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 | 张楠 | 欧梦澈 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼 | |
| 审计报告日期 | 2022-03-30 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年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 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 1,262,658.89 | 4,286,395.31 |
| 结算备付金 | | 47,503,536.52 | - |
| 存出保证金 | | 31,827.50 | 109,344.73 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 110,829,059.67 | 100,000,000.00 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 161,331,909.59 | 147,882,018.29 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | 12,595,325,198.03 | 10,953,803,933.94 |
| 资产总计 | | 12,916,284,190.20 | 11,206,081,692.27 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | 4,763,510,421.28 | 3,064,607,275.11 |
| 应付证券清算款 | | 111,335,912.32 | 100,089,424.65 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,025,157.61 | 1,022,630.87 |
| 应付托管费 | | 341,719.21 | 340,876.96 |
| 应付销售服务费 | | 0.62 | 0.62 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 156,865.74 | 115,711.55 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 806,185.70 | 649,231.07 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 209,000.00 | 131,000.00 |
| 负债合计 | | 4,877,385,262.48 | 3,166,956,150.83 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 7,999,034,347.66 | 7,999,034,343.79 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 39,864,580.06 | 40,091,197.65 |
| 所有者权益合计 | | 8,038,898,927.72 | 8,039,125,541.44 |
| 负债和所有者权益总计 | | 12,916,284,190.20 | 11,206,081,692.27 |

注：1. 报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0050元，A类基金份额净值1.0050元，C类基金份额净值1.0034元，基金份额总额7,999,034,347.66份，其中A类基金份额

7,999,027,678.28份，C类基金份额6,669.38份。

2. 资产负债表中其他资产分类为持有至到期投资的债券投资。

7.2 利润表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年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04日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日 |
|-----------------------|----------------|-----------------------------------|---|
| 一、收入 | | 394,849,152.02 | 122,898,258.95 |
| 1. 利息收入 | | 394,849,152.02 | 122,898,258.95 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 592,071.31 | 2,869,884.55 |
| 债券利息收入 | | 394,257,080.71 | 116,026,458.54 |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | - | 4,001,915.86 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-” 填列） | | - | - |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 7.4.7.14. 5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 | 7.4.7.18 | - | - |

| | | | |
|-----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 失以“-”号填列) | | | |
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | 7.4.7.19 | - | - |
| 减: 二、费用 | | 107,110,532.96 | 18,814,786.50 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 12,085,788.24 | 4,908,746.36 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 4,028,596.05 | 1,636,248.83 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 7.30 | 2.98 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.20 | 435.54 | - |
| 5. 利息支出 | | 90,777,705.83 | 12,136,888.33 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 90,777,705.83 | 12,136,888.33 |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.21 | 218,000.00 | 132,900.00 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | 287,738,619.06 | 104,083,472.45 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | 287,738,619.06 | 104,083,472.45 |

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2021年01月01日至2021年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 | 7,999,034,343.79 | 40,091,197.65 | 8,039,125,541.44 |

| | | | |
|--|----------------------------------|-----------------|------------------|
| 益(基金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 287,738,619.06 | 287,738,619.06 |
| 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) | 3.87 | - | 3.87 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 3.87 | - | 3.87 |
| 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) | - | -287,965,236.65 | -287,965,236.65 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 7,999,034,347.66 | 39,864,580.06 | 8,038,898,927.72 |
| 项 目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020年08月04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) | 7,999,034,343.71 | - | 7,999,034,343.71 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 104,083,472.45 | 104,083,472.45 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值 | 0.08 | - | 0.08 |

| | | | |
|--|------------------|----------------|------------------|
| 减少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 0.08 | - | 0.08 |
| 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） | - | -63,992,274.80 | -63,992,274.80 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 7,999,034,343.79 | 40,091,197.65 | 8,039,125,541.44 |

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：

金川

沈珂

陈若

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]945号)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2020年8月4日生效。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额为人民币7,999,034,343.71元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。根据《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》的相关规定,本基金以63个月为一个封闭期,本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起至63个月后的对应日的前一日止,首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起至63个月后的对应日的前一日止。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日(包括该日)起进入开放期,每个开放期不

少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内期间可以办理申购与赎回业务。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“中国邮政储蓄银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，本基金开放期开始前 3 个月、开放期以及开放期结束后的 3 个月内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。在开放期内，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为同期三年期银行定期存款基准利率（税后）+0.5%。

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、自2021年1月1日至2021年12月31日止期间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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。

本基金采用买入并持有至到期的投资策略，因此将所持有的债券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。持有至到期投资按照摊余成本进行计量，在其他资产中进行核算。

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：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项及持有至到期投资以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

以摊余成本计量的金融资产按下述原则评估减值损失：

- 本基金在资产负债表日对以摊余成本计量的金融资产的账面价值进行检查，有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备；

- 当以摊余成本计量的金融资产的预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本基金将该以摊余成本计量的金融资产的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益；

- 在以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本基金将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

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：

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

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

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。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际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。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，

即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同，但本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。持有至到期投资已发生减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生严重财务困难；
- 债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- 因发行方发生重大财务困难，该金融资产无法在活跃市场继续交易。

在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内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[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号文《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：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

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

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

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

(c) 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。

(d) 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 | 1,262,658.89 | 4,286,395.31 |
| 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 | 1,262,658.89 | 4,286,395.31 |

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何交易性金融资产。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均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 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 18,445.61 | 860.84 |
| 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 | 23,514.26 | - |
| 应收债券利息 | 161,289,933.99 | 147,881,103.33 |
| 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 | 15.73 | 54.12 |
| 合计 | 161,331,909.59 | 147,882,018.29 |

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

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 |
|----|--------------------|---------------------|
| | | |

| | | |
|---------|-------------------|-------------------|
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 持有至到期债券 | 12,595,325,198.03 | 10,953,803,933.94 |
| 合计 | 12,595,325,198.03 | 10,953,803,933.94 |

注：2021年本基金持有的持有至到期投资均为债券投资，其中持有交易所市场债券 2,798,134,144.62 元，持有银行间市场债券9,797,191,053.41元。于2021年12月31日，上述持有至到期投资无需计提减值准备。（2020年本基金持有的持有至到期投资均为债券投资，其中持有交易所市场债券1,510,510,966.14元，持有银行间市场债券9,443,292,967.80元。于2020年12月31日，上述持有至到期投资无需计提减值准备。）

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 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 156,865.74 | 115,711.55 |
| 合计 | 156,865.74 | 115,711.55 |

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 | 209,000.00 | 131,000.00 |
| 合计 | 209,000.00 | 131,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 嘉合慧康63个月定开债券A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| (嘉合慧康63个月定开债券A) | 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 | 7,999,027,675.13 | 7,999,027,675.13 |
| 本期申购 | 3.15 | 3.15 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 7,999,027,678.28 | 7,999,027,678.28 |

7.4.7.9.2 嘉合慧康63个月定开债券C

金额单位：人民币元

| 项目 (嘉合慧康63个月定开债券C) | 本期 2021年01月01日至2021年12月31日 | |
|-----------------------|-------------------------------|----------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 6,668.66 | 6,668.66 |
| 本期申购 | 0.72 | 0.72 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 6,669.38 | 6,669.38 |

注：1. 此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》的相关规定，本基金以63个月为一个封闭期，本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起至63个月后的对应日的前一日止，首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起至63个月后的对应日的前一日止。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日（包括该日）起进入开放期，每个开放期不少于5个工作日并且最长不超过20个工作日。开放期内期间可以办理申购与赎回业务。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

| 项目 (嘉合慧康63个月定开 债券A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | 40,091,167.18 | - | 40,091,167.18 |

| | | | |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| 本期利润 | 287,738,386.69 | - | 287,738,386.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -287,964,996.61 | - | -287,964,996.61 |
| 本期末 | 39,864,557.26 | - | 39,864,557.26 |

7.4.7.10.2 嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

| 项目 (嘉合慧康63个月定开 债券C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------------|---------|-------|---------|
| 上年度末 | 30.47 | - | 30.47 |
| 本期利润 | 232.37 | - | 232.37 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -240.04 | - | -240.04 |
| 本期末 | 22.80 | - | 22.80 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年08月04日(基金合同生效 日)至2020年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 活期存款利息收入 | 93,225.95 | 476,156.94 |
| 定期存款利息收入 | - | 575,833.33 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 498,045.66 | 1,817,322.46 |
| 其他 | 799.70 | 571.82 |

| | | |
|----|------------|--------------|
| 合计 | 592,071.31 | 2,869,884.55 |
|----|------------|--------------|

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.20 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04日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 交易所市场交易费用 | - | - |
| 银行间市场交易费用 | 435.54 | - |
| 合计 | 435.54 | - |

7.4.7.21 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04日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------------------|---|
| 审计费用 | 80,000.00 | 72,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 50,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 汇划手续费 | - | - |
| 中债登 | 18,000.00 | 6,000.00 |
| 上清所 | 0.00 | 4,500.00 |
| 其他费用 | - | 400.00 |
| 合计 | 218,000.00 | 132,900.00 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《嘉合慧康63个月定期开放债券型基金基金合同》、《嘉合慧康63个月定期开放债券型基金招募说明书》、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金第一次分红公告》规定，基金管理人嘉合基金管理有限公司于2022年3月18日(权益登记日)，对本基金进行了分红除权。分红结果如下：权益登记日2022年3月18日，除息日2022年3月18日，现金红利发放日2022年3月22日，每10份嘉合慧康基金份额分红人民币0.1元，共发放红利79,990,343.55元，其中以现金形式发放人民币79,990,341.02元，以红利再投资形式发放人民币2.53元。

7.4.9 关联方关系

本基金本报告不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------|---------------------|
| 嘉合基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 中航信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 广东万和集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海慧弘实业集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 福建圣农控股集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 北京智勇仁信投资咨询有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 山东通汇资本投资集团有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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04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 | 12,085,788.24 | 4,908,746.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 226,642.59 | 115,459.30 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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04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 | 4,028,596.05 | 1,636,248.83 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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01月01日至2021年12月31日 | | |
|----------------|---|---------------|------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C | 合计 |
| 嘉合基金管理有限公司 | 0.00 | 3.65 | 3.65 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 3.65 | 3.65 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020年08月04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销售服务费 | | |
| | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C | 合计 |
| 嘉合基金管理有限公司 | 0.00 | 1.49 | 1.49 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 1.49 | 1.49 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。
计算公式如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

单位：人民币元

| 本期 2021年01月01日至2021年12月31日 | | | | | | |
|-------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|------------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 104,500,000.00 | 1,889.59 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 199,500,000.00 | 221,909.59 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 199,500,000.00 | 206,058.90 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 209,000,000.00 | 10,306.85 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 100,000,000.00 | 14,869.32 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 170,000,000.00 | 8,428.27 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 250,000,000.00 | 97,549.32 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 200,000,000.00 | 79,792.33 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 100,000,000.00 | 6,797.53 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 300,000,000.00 | 15,316.44 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 300,000,000.00 | 18,246.58 |
| 中国邮政储蓄银行 | - | - | - | - | 400,000,000.00 | 241,64 |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|--------------------|---------------|
| 银行 | | | | | 00.00 | 3.84 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 54,79 4.52 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 400,000,0 00.00 | 33,24 2.74 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 14,38 3.56 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 40,68 4.93 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 13,80 8.22 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 15,86 3.01 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 17,09 5.89 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 14,79 4.52 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 15,93 0.41 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 11,67 1.23 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 51,04 1.10 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 14,03 1.78 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 14,21 9.18 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 46,26 9.86 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 16,32 1.64 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 100,000,0 00.00 | 40,53 8.63 |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|--------------------|---------------|
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 12,21 9.18 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 51,86 4.66 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 93,97 2.60 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 12,54 9.59 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 219,840,0 00.00 | 36,13 8.08 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 300,000,0 00.00 | 42,16 4.38 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 172,900,0 00.00 | 36,38 0.05 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 11,23 2.88 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 12,05 4.79 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 30,08 2.19 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 31,23 2.88 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 9,424. 66 |
| 中国邮政储蓄 银行 | - | - | - | - | 200,000,0 00.00 | 9,095. 89 |

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

嘉合慧康63个月定开债券A

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

| | | | | |
|--------------------|--|--|--|--|
| 资本投资 集团有限 公司 | | | | |
|--------------------|--|--|--|--|

嘉合慧康63个月定开债券C

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

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 2021年01月01日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间 2020年08月04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 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 1,262,658.89 | 93,225.95 | 4,286,395.31 | 476,156.94 |

注：本基金通过“中国邮政储蓄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，于2021年12月31日的相关余额为人民币 47,503,536.52元。（2020年12月31日：人民币0.00元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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

嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | 每10份基金 份额分红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1 | 2021-03-18 | 2021-03-18 | 0.100 | 79,990,276.74 | 0.10 | 79,990,276.84 | - |
| 2 | 2021-06-21 | 2021-06-21 | 0.080 | 63,992,221.38 | 0.08 | 63,992,221.46 | - |
| 3 | 2021-09-16 | 2021-09-16 | 0.100 | 79,990,275.64 | 1.20 | 79,990,276.84 | - |
| 4 | 2021-12-10 | 2021-12-10 | 0.080 | 63,992,219.70 | 1.77 | 63,992,221.47 | - |

| | | | | | | | |
|----|--|--|-------|----------------|------|----------------|---|
| 合计 | | | 0.360 | 287,964,993.46 | 3.15 | 287,964,996.61 | - |
|----|--|--|-------|----------------|------|----------------|---|

嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-------------|----------|-----------|----------|----|
| 1 | 2021-03-18 | 2021-03-18 | 0.100 | 66.48 | 0.20 | 66.68 | - |
| 2 | 2021-06-21 | 2021-06-21 | 0.080 | 53.18 | 0.16 | 53.34 | - |
| 3 | 2021-09-16 | 2021-09-16 | 0.100 | 66.48 | 0.20 | 66.68 | - |
| 4 | 2021-12-10 | 2021-12-10 | 0.080 | 53.18 | 0.16 | 53.34 | - |
| 合计 | | | 0.360 | 239.32 | 0.72 | 240.04 | - |

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币2,925,702,421.28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 |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 150314 | 15进出14 | 2022-01-04 | 101.78 | 1,000,000 | 101,780,000.00 |
| 150314 | 15进出14 | 2022-01-04 | 101.78 | 1,230,000 | 125,189,400.00 |
| 200315 | 20进出15 | 2022-01-05 | 100.40 | 1,550,000 | 155,620,000.00 |

| | | | | | |
|--------|--------|------------|--------|------------|------------------|
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 1,050,000 | 101,199,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 1,000,000 | 96,380,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 2,156,000 | 207,795,280.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 2,000,000 | 192,760,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-06 | 96.38 | 3,160,000 | 304,560,800.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-07 | 96.38 | 200,000 | 19,276,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-07 | 96.38 | 2,800,000 | 269,864,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-06 | 96.38 | 4,220,000 | 406,723,600.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 4,000,000 | 385,520,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-12 | 96.38 | 1,000,000 | 96,380,000.00 |
| 200408 | 20农发08 | 2022-01-06 | 99.88 | 1,060,000 | 105,872,800.00 |
| 200408 | 20农发08 | 2022-01-04 | 99.88 | 500,000 | 49,940,000.00 |
| 150314 | 15进出14 | 2022-01-04 | 101.78 | 1,000,000 | 101,780,000.00 |
| 150314 | 15进出14 | 2022-01-04 | 101.78 | 1,000,000 | 101,780,000.00 |
| 200405 | 20农发05 | 2022-01-04 | 96.38 | 2,000,000 | 192,760,000.00 |
| 合计 | | | | 30,926,000 | 3,015,180,880.00 |

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，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 1,837,808,000.00元，于2022年01月04日，2022年01月07日，2022年01月11日，2022年1月13日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，以保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单及其他货币市场工具。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。同时，本基金亦可

以通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款及其他资产等。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，按照企业会计准则的要求评估金融资产是否发生减值。如有确凿证据表明本基金在封闭期内买入持有至到期的投资策略发生变化或其他原因，导致按原有摊余成本法估值不能客观反映上述资产或负债于开放期内的公允价值的，本基金管理人可根据具体情况与本基金托管人商定后，按最能反映上述资产或负债于开放期内的公允价值的方法估值。因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

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 | 1,262,658.89 | - | - | - | - | - | 1,262,658.89 |
| 结算备付金 | 47,503,536.52 | - | - | - | - | - | 47,503,536.52 |
| 存出保证金 | 31,827.50 | - | - | - | - | - | 31,827.50 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 110,829,059.67 | 110,829,059.67 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 161,331,909.59 | 161,331,909.59 |
| 其他资产 | - | - | - | 12,595,325,198.03 | - | - | 12,595,325,198.03 |

嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告

| | | | | | | | |
|---------------------|-------------------|-------|--------|-------------------|------|----------------|-------------------|
| 资产总计 | 48,798,022.91 | - | - | 12,595,325,198.03 | - | 272,160,969.26 | 12,916,284,190.20 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 4,763,510,421.28 | - | - | - | - | - | 4,763,510,421.28 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 111,335,912.32 | 111,335,912.32 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,025,157.61 | 1,025,157.61 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 341,719.21 | 341,719.21 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 0.62 | 0.62 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 156,865.74 | 156,865.74 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 806,185.70 | 806,185.70 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 209,000.00 | 209,000.00 |
| 负债总计 | 4,763,510,421.28 | - | - | - | - | 113,874,841.20 | 4,877,385,262.48 |
| 利率敏感度缺口 | -4,714,712,398.37 | - | - | 12,595,325,198.03 | - | 158,286,128.06 | 8,038,898,927.72 |
| 上年度末 2020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 | 4,286,395.31 | - | - | - | - | - | 4,286,395.31 |
| 存出保证金 | 109,344.73 | - | - | - | - | - | 109,344.73 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 147,882,018.29 | 147,882,018.29 |
| 其他资产 | - | - | - | 10,953,803,933.94 | - | - | 10,953,803,933.94 |
| 资产总计 | 4,395,740.04 | - | - | 10,953,803,933.94 | - | 247,882,018.29 | 11,206,081,692.27 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 3,064,607,275.11 | - | - | - | - | - | 3,064,607,275.11 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 100,089,424.65 | 100,089,424.65 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,022,630.87 | 1,022,630.87 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 340,876.96 | 340,876.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 0.62 | 0.62 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 115,711.55 | 115,711.55 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 649,231.07 | 649,231.07 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 131,000.00 | 131,000.00 |
| 负债总计 | 3,064,607,275.11 | - | - | - | - | 102,348,875.72 | 3,166,956,150.83 |
| 利率敏感度缺口 | -3,060,211,535.07 | - | - | 10,953,803,933.94 | - | 145,533,142.57 | 8,039,125,541.44 |

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本年末，本基金采用买入并持有至到期的投资策略并采用摊余成本计量金融资产和金融负债，因此市场利率的波动对于本基金资产净值无重大影响。

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，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本年末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下表列示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。

(a) 持续的以公允价值计量的金融工具

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

(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）。

7.4.14.2 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持有至到期投资、应收款项和卖出回购金融资产。于2021年12月31日，除下表中列示的持有至到期投资以外，本基金持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异：

本期末（2021年12月31日）交易所市场债券账面价值为人民币 2,798,134,144.62 元，公允价值为人民币 2,846,172,098.30 元；银行间市场债券账面价值为人民币 9,797,191,053.41元，公允价值为人民币10,011,227,000.00元；资产支持证券账面价值为0，公允价值为0（2020年12月31日交易所市场债券账面价值为人民币 1,510,510,966.14元，公允价值为人民币1,515,287,398.70元；银行间市场债券账面价值为人民币9,443,292,967.80元，公允价值为人民币9,511,818,000.00元；资产支持证券账面价值为0，公允价值为0）。

除特别声明外，本基金按下述原则确认公允价值：

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。

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。

§ 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 | 12,595,325,198.03 | 97.52 |
| | 其中：债券 | 12,595,325,198.03 | 97.52 |

| | | | |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| | 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 | 48,766,195.41 | 0.38 |
| 8 | 其他各项资产 | 272,192,796.76 | 2.11 |
| 9 | 合计 | 12,916,284,190.20 | 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投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 12,595,325,198.03 | 156.68 |
| | 其中：政策性金融债 | 12,595,325,198.03 | 156.68 |
| 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 | 12,595,325,198.03 | 156.68 |

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 | 150314 | 15进出14 | 35,500,000 | 3,613,197,195.24 | 44.95 |
| 2 | 200405 | 20农发05 | 33,000,000 | 3,180,481,424.93 | 39.56 |
| 3 | 018017 | 国开2007 | 11,501,000 | 1,151,728,908.05 | 14.33 |
| 4 | 200315 | 20进出15 | 10,600,000 | 1,064,270,398.05 | 13.24 |
| 5 | 018083 | 农发2001 | 8,803,180 | 878,308,675.90 | 10.93 |

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；中国农业发展银行、国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。

注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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 | 31,827.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 110,829,059.67 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 161,331,909.59 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 272,192,796.76 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 |
| 嘉合慧康63个月 | 142 | 56,331,180.83 | 7,999,022,000.00 | 100.00% | 5,678.28 | 0.00% |

| | | | | | | |
|-------------------------------|-----|-------------------|----------------------|-------------|-----------|-------------|
| 定开 债券A | | | | | | |
| 嘉合 慧康6 3个月 定开 债券C | 75 | 88.93 | 0.00 | 0.00% | 6,669.38 | 100.0 0% |
| 合计 | 217 | 36,861,909. 44 | 7,999,022,000. 00 | 100.0 0% | 12,347.66 | 0.00% |

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

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 | 嘉合慧康63个月定 开债券A | 1,220.92 | 0.00% |
| | 嘉合慧康63个月定 开债券C | 850.44 | 12.75% |
| | 合计 | 2,071.36 | 0.00% |

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 | 嘉合慧康63个月定 开债券A | 0~10 |
| | 嘉合慧康63个月定 开债券C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 嘉合慧康63个月定 开债券A | 0~10 |
| | 嘉合慧康63个月定 开债券C | 0 |

| | | |
|--|----|------|
| | 合计 | 0~10 |
|--|----|------|

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金A份额和C份额的总量均在0~10万份(含)之间。

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 嘉合慧康63个月定开债券A | 嘉合慧康63个月定开债券C |
|----------------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日(2020年08月04日)基金份额总额 | 7,999,027,675.05 | 6,668.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,999,027,675.13 | 6,668.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3.15 | 0.72 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,999,027,678.28 | 6,669.38 |

注：总申购份额含转换入份额，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

本报告期内，本基金管理人发生以下重大人事变动：

1、自2021年4月2日起，郝艳芬女士代任公司总经理职务，徐进先生不再担任公司总经理职务。

2、自2021年9月23日起，周健男先生担任公司董事长职务，郝艳芬女士不再担任公司董事长职务。

3、自2021年9月23日起，金川先生担任公司总经理职务，郝艳芬女士不再代任公司总经理职务。

4、自2021年9月23日起，魏超先生担任公司副总经理职务。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | - | - | - | - | - |

注：1、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

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 | 成交金额 | 占当期债券回购成 | 成交金额 | 占当期权证成交总 | 成交金额 | 占当期基金成交总 |

| | | 额的比例 | | 交总额的 比例 | | 额的比例 | | 额的比例 |
|----------|--------------------|-------------|-----------------------|-------------|---|------|---|------|
| 国元 证券 | 905,721,4 93.57 | 100.0 0% | 86,262,473, 000.00 | 100.0 0% | - | - | - | - |

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 | 嘉合基金管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站 | 2021-01-22 |
| 2 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2020年第四季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-22 |
| 3 | 嘉合基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-24 |
| 4 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第一次分红公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-17 |
| 5 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2020年年度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-31 |
| 6 | 嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站 | 2021-03-31 |
| 7 | 嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（总经理）变更的公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-03 |
| 8 | 嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证 | 2021-04-22 |

| | | | |
|----|--|---|------------|
| | 告提示性公告 | 券日报》、基金管理人网站 | |
| 9 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年第一季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-22 |
| 10 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第二次分红公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-18 |
| 11 | 嘉合基金管理有限公司旗下基金2021年第二季度报告提示性公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站 | 2021-07-21 |
| 12 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年第二季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-21 |
| 13 | 关于修订嘉合基金管理有限公司旗下16只基金的基金合同等法律文件的公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 14 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 15 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 16 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1号） | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 17 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 18 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 19 | 嘉合基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告提示性 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证 | 2021-08-31 |

| | | | |
|----|--|--|------------|
| | 公告 | 券日报》、基金管理人网站 | |
| 20 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年中期报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-31 |
| 21 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第三次分红公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-15 |
| 22 | 嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（董事长）变更的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-24 |
| 23 | 嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（副总经理）变更的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-24 |
| 24 | 嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（总经理）变更的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-24 |
| 25 | 嘉合基金管理有限公司关于终止旗下基金在资舟基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-20 |
| 26 | 嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告提示性公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站 | 2021-10-27 |
| 27 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年第三季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-27 |
| 28 | 嘉合基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、基金电子披露网站 | 2021-11-24 |
| 29 | 嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年度第四次分红公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-09 |

§ 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 | 2,398,999,000.00 | - | - | 2,398,999,000.00 | 29.99% |
| | 2 | 20210101 - 20211231 | 1,599,999,000.00 | - | - | 1,599,999,000.00 | 20.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人办公场所、托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司
二〇二二年三月三十一日