

---

**嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金  
(FOF)**

**2021 年年度报告**

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 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。

基金托管人中国工商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	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	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	17
§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	22
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	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 本报告期投资基金情况.....	61
8.13 投资组合报告附注.....	63
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	66
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	67
§11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4 基金投资策略的改变.....	68
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	68
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.9 其他重大事件.....	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§13 备查文件目录.....	74
13.1 备查文件目录.....	74
13.2 存放地点.....	74
13.3 查阅方式.....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）	
基金主代码	007933	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月09日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,251,671.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	007933	007934
报告期末下属分级基金的份额总额	10,104,140.37份	147,530.66份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过自上而下的资产配置和资产内部子基金精选的方式谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金基于宏观基本面确定资产配置，通过量化指标精选优质子基金，在控制风险的前提下获取稳定的业绩。</p> <p>本基金的核心策略包括两部分：一是自上而下基于经济周期、货币周期、信用周期以及估值比价等确定大类资产的配置比例以及整体仓位；二是通过量化指标优选子基金，以获取超额收益。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券

	型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金。
--	-------------------------------

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔为中	郭明
	联系电话	021-60168288	(010) 66105799
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-0603-299	95588
传真		021-65015077	(010) 66105798
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1幢329室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		200082	100140
法定代表人		金川	陈四清

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	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05月09日（基金合同生效 日）-2020年12月31日	
	嘉合永泰优选 三个月持有混 合（FOF）A	嘉合永泰优选 三个月持有混 合（FOF）C	嘉合永泰优选 三个月持有混 合（FOF）A	嘉合永泰优选 三个月持有混 合（FOF）C
本期已实 现收益	1,260,468.60	136,631.28	-116,632.29	-53,912.11
本期利润	45,953.32	280,764.61	754,857.94	374,176.00
加权平均 基金份额 本期利润	0.0045	0.5845	0.0428	0.0393
本期加权 平均净值 利润率	0.45%	55.73%	4.30%	3.96%
本期基金 份额净值 增长率	0.11%	-0.06%	7.15%	7.01%
3.1.2 期末 数据和指 标	2021年末		2020年末	
期末可供 分配利润	55,730.32	349.79	19,826.92	3,559.52
期末可供 分配基金 份额利润	0.0055	0.0024	0.0019	0.0006
期末基金 资产净值	10,159,870.69	147,880.45	11,136,804.22	6,145,216.04
期末基金 份额净值	1.0055	1.0024	1.0715	1.0701

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	0.55%	0.24%	7.15%	7.01%

注：1、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。

2、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。

3、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

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	1.80%	0.66%	1.37%	0.48%	0.43%	0.18%
过去六个月	-1.46%	0.79%	-2.17%	0.61%	0.71%	0.18%
过去一年	0.11%	0.85%	-1.79%	0.70%	1.90%	0.15%
自基金合同生效起至今	7.27%	0.75%	17.07%	0.73%	-9.80%	0.02%

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	1.76%	0.66%	1.37%	0.48%	0.39%	0.18%
过去六个月	-1.56%	0.79%	-2.17%	0.61%	0.61%	0.18%
过去一年	-0.06%	0.85%	-1.79%	0.70%	1.73%	0.15%



自基金合同生效起至今	6.95%	0.75%	17.07%	0.73%	-10.12%	0.02%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

### 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变动的比较

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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05月09日-2021年12月31日)



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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05月09日-2021年12月31日)

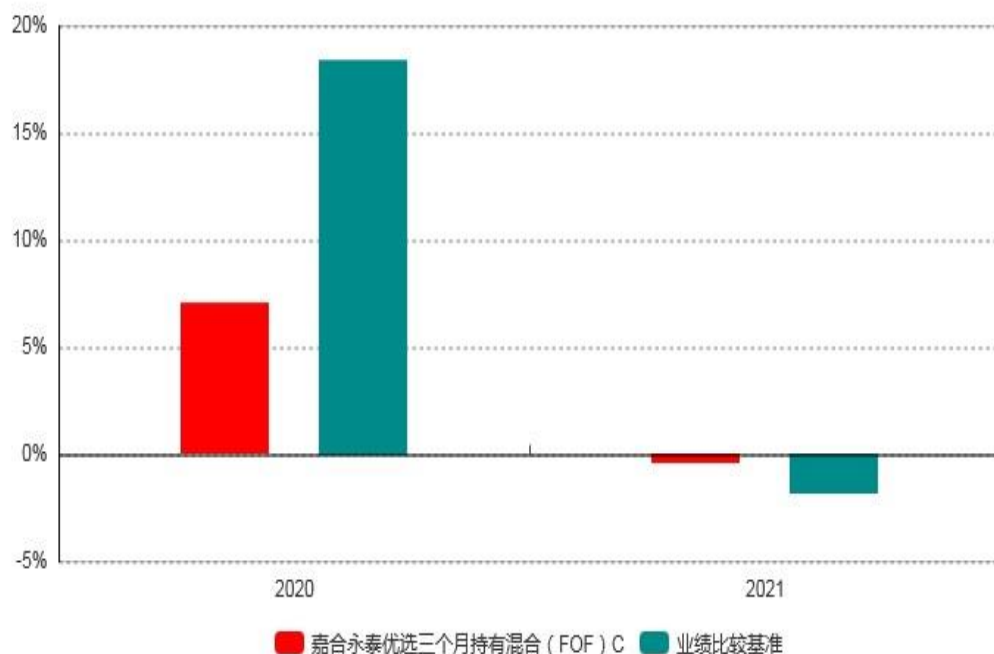


注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	0.700	712,797.13	470.64	713,267.77	-
合计	0.700	712,797.13	470.64	713,267.77	-

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	0.700	32,371.17	2,677.58	35,048.75	-
合计	0.700	32,371.17	2,677.58	35,048.75	-

## § 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		
梁凯	嘉合永泰优选三个月持有	2020-	2021-	6	复旦大学金融工程管理硕

	期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理	05-09	01-27	年	士，6年金融从业经验。曾任上海凯石益正资产管理有限公司另类投资部研究员，珠海盈米财富管理有限公司 FOF 研究院研究员，2017 年加入嘉合基金管理有限公司。
张亦博	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。	2021-01-27	-	11 年	澳大利亚莫纳什大学风险管理硕士，辽宁大学管理学学士。曾任德邦证券有限责任公司研究所研究员、东吴证券股份有限公司资产管理部投资经理助理、华宝证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理、财通基金管理有限公司固定收益部基金经理、蜂巢基金管理有限公司资产管理部副总监，2020 年加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、梁凯的“任职日期”为基金合同生效日。张亦博的“任职日期”为公告确定的聘任日期。梁凯的“离任日期”为公告确定的离任日期。

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

本报告期，本基金管理人通过自上而下的大类资产配置策略，对权益和债券的比例进行适当调整，同时依据中观行业配置策略，对权益部分进行了行业轮动调整。本报告期内，有效参与了煤炭、有色、农业等周期行业配置。基金选择方面，完善了基金筛选模型，着重考量了回撤控制、换手率等指标，并进一步完善了对基金管理人的评价方法，使基金筛选更加有效。本产品在资产配置和基金选择方面，均重视回撤控制、波动率控制等风险指标，注重为持有人带来良好的投资回报和投资体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A基金份额净值为1.0055元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.11%，同期业绩比较基准收益率为-1.79%；截至报告期末嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C基金份额净值为1.0024元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准收益率为-1.79%。

#### 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年依旧是经济下行压力较大的一年，也是投资难度较大的一年。首先，从库存周期的视角看，上半年处于从被动补库存到主动去库存过渡的阶段，通常，该阶段的权益市场表现难如人意。第二，开年俄乌战争的爆发给全球资本市场带来了巨大扰动，极大影响了全球资金的风险偏好。第三，由于俄乌是重要的资源品、农产品出口国，战争进一步推高上游资源品价格，给全球性的通胀带来了更大的压力。第四，美国恰处于疫情后货币政策收紧阶段，原油、天然气及金属等原材料价格的超预期上涨恐会影响美联储货币政策收紧的节奏。第五，国内仍面临较大的经济压力，房地产销售持续下滑，出口在高基数的影响下难以保持高增长，消费又受到疫情反复的压制。

面对严峻的投资环境，我们会更加审慎地执行投资策略，更加灵活地依据大类资产配置策略调整权益和债券的仓位，更加注重基金的回撤和波动率控制，行业及风格配置方面也会更加均衡。

总体来看，2022年仍有三大投资机会值得关注。一是稳增长的投资机会。龙头地产将受益于房地产政策放松和融资成本的下降，行业将进一步向头部集中。基建投资方面，关注估值低的央企新能源、电网工程投资主体。二是高端装备制造投资仍将保持两位数高增长。新能源汽车产业链方面，高端汽车零部件、汽车智能化将是今年关注的重点。同时，新能源领域的绿电运营商、电网智能化改造、核电等方向也面临政策扶持和景气向好的投资机会。军工产业链主要受到军费支出增长、军民融合、空军装备更新加速以及地缘政治扰动等影响。龙头军工企业的成长性和盈利性已经受到市场机构投资者的认可，市场将加大这部分的布局。芯片半导体相关行业仍然受益于国产化替代、汽车芯片短缺压力缓解和元宇宙市场需求的不断提升。三是把握2022年的涨价逻辑以及后疫情时代困境反转的机会。2022年的价格上涨的压力将从上游向下游传导。价格上涨的主线将集中在必选消费品和猪周期两个方向。

#### 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、定期检查和不定期的检查相结合的方式，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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金于2021年2月3日实施利润分配，A级每10份基金份额派发红利0.700元，C级每10份基金份额派发红利0.700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，本基金托管人在对嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的管理人—嘉合基金管理有限公司在嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）未进行利润分配。

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

本托管人依法对嘉合基金管理有限公司编制和披露的嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2021年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2200092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	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）”）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，公允反映了嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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，我们独立于嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF），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	<p>嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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。其他信息包括嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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>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永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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，除非嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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</p>

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，就可能对嘉合永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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永泰优选三个月持有混合基金（FOF）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：嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,661.45	1,083,456.39
结算备付金		16,999.51	122,480.68
存出保证金		1,677.45	6,470.56
交易性金融资产	7.4.7.2	10,306,337.44	16,396,645.49
其中：股票投资		1,075,464.00	-
基金投资		8,559,125.44	16,396,645.49
债券投资		671,748.00	-
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		13,176.39	-
应收利息	7.4.7.5	13,039.87	185.00
应收股利		-	-
应收申购款		99.88	111.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	337.58	-

资产总计		10,357,329.57	17,609,349.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2021年12月31日	<b>上年度末</b> 2020年12月31日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,052.85	-
应付赎回款		8,779.81	186,042.61
应付管理人报酬		5,008.96	8,511.59
应付托管费		1,036.32	1,739.28
应付销售服务费		26.26	1,008.92
应付交易费用	7.4.7.7	3,672.62	-
应交税费		0.39	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	30,001.22	130,027.32
负债合计		49,578.43	327,329.72
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	10,251,671.03	16,136,104.96
未分配利润	7.4.7.10	56,080.11	1,145,915.30
所有者权益合计		10,307,751.14	17,282,020.26
负债和所有者权益总计		10,357,329.57	17,609,349.98

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0055元，A类基金份额净值1.0055元，C类基金份额净值1.0024元，基金份额总额10,251,671.03份，其中A类基金份额10,104,140.37份，C类基金份额147,530.66份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		546,636.20	1,466,657.13
1. 利息收入		16,427.66	51,878.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,139.75	10,930.55
债券利息收入		14,261.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		26.10	40,948.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,598,658.89	109,647.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-39,373.82	-
基金投资收益	7.4.7.13	1,378,890.01	97,078.08
债券投资收益	7.4.7.14	36,585.16	-
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	222,557.54	12,569.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-1,070,381.95	1,299,578.34
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	1,931.60	5,552.44

<b>减：二、费用</b>		219,918.27	337,623.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	59,713.88	103,092.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,537.17	17,657.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,042.00	12,193.61
4. 交易费用	7.4.7.20	115,204.37	73,109.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.00	-
7. 其他费用	7.4.7.21	31,419.85	131,570.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		326,717.93	1,129,033.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		326,717.93	1,129,033.94

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	16,136,104.96	1,145,915.30	17,282,020.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	326,717.93	326,717.93



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）	-5,884,433.93	-668,236.60	-6,552,670.53
其中：1. 基金申购款	91,805.42	4,455.55	96,260.97
2. 基金赎回款	-5,976,239.35	-672,692.15	-6,648,931.50
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）	-	-748,316.52	-748,316.52
五、期末所有者权益（基金净值）	10,251,671.03	56,080.11	10,307,751.14
项 目	上年度可比期间		
	2020年05月09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）	31,617,153.48	-	31,617,153.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,129,033.94	1,129,033.94
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）	-15,481,048.52	16,881.36	-15,464,167.16
其中：1. 基金申购款	674,554.32	-1,353.53	673,200.79
2. 基金赎回款	-16,155,602.84	18,234.89	-16,137,367.95
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）	16,136,104.96	1,145,915.30	17,282,020.26

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

嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会下发的《关于准予嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可[2019]1475号）注册，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》等相关法规和《嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》发售，基金合同于2020年5月9日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币31,617,153.48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。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和《嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含QDII基金、香港互认基金）、国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、银行存款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）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于证券投资基金基金份额的比例不低于本基金资产的80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金占基金资产的比例不低于60%；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5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相

同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 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

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

股利收益包括股票投资产生的股利收益及基金投资产生的股利收益。股票投资产生的股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。基金投资产生的股利收益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。

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基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、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

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金每一基金份额享有同等分配权，法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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。

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

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

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

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

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

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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



(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股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)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。

(g)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	5,661.45	1,083,456.39
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	5,661.45	1,083,456.39

## 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		1,079,220.98	1,075,464.00	-3,756.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	666,500.73	671,748.00	5,247.27
	银行间市场	-	-	-
	合计	666,500.73	671,748.00	5,247.27
资产支持证券		-	-	-
基金		8,331,419.34	8,559,125.44	227,706.10
其他		-	-	-
合计		10,077,141.05	10,306,337.44	229,196.39
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		15,097,067.15	16,396,645.49	1,299,578.34
其他		-	-	-
合计		15,097,067.15	16,396,645.49	1,299,578.34

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产期末余额。

##### 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	1.04	121.20
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	8.36	60.61
应收债券利息	13,029.70	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	0.77	3.19
合计	13,039.87	185.00

#### 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	337.58	-
待摊费用	-	-
合计	337.58	-

#### 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	3,672.62	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,672.62	-

#### 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	1.22	27.32
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	130,000.00
合计	30,001.22	130,027.32

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合永泰优选三个月持有混 合 (FOF) A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	10,393,605.50	10,393,605.50
本期申购	58,795.73	58,795.73
本期赎回 (以“-”号填列)	-348,260.86	-348,260.86
本期末	10,104,140.37	10,104,140.37

## 7.4.7.9.2 嘉合永泰优选三个月持有混合 (FOF) C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合永泰优选三个月持有混 合 (FOF) 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	5,742,499.46	5,742,499.46
本期申购	33,009.69	33,009.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,627,978.49	-5,627,978.49
本期末	147,530.66	147,530.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 嘉合永泰优选三个月持有混合 (FOF) A

单位：人民币元

项目 (嘉合永泰优选三个月 持有混合 (FOF) A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,826.92	723,371.80	743,198.72
本期利润	1,260,468.60	-1,214,515.28	45,953.32
本期基金份额交易产 生的变动数	-16,642.04	-3,511.91	-20,153.95
其中：基金申购款	2,116.93	1,530.73	3,647.66
基金赎回款	-18,758.97	-5,042.64	-23,801.61
本期已分配利润	-713,267.77	-	-713,267.77

本期末	550,385.71	-494,655.39	55,730.32
-----	------------	-------------	-----------

## 7.4.7.10.2 嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C

单位：人民币元

项目 (嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,559.52	399,157.06	402,716.58
本期利润	136,631.28	144,133.33	280,764.61
本期基金份额交易产生的变动数	-97,579.05	-550,503.60	-648,082.65
其中：基金申购款	2,099.05	-1,291.16	807.89
基金赎回款	-99,678.10	-549,212.44	-648,890.54
本期已分配利润	-35,048.75	-	-35,048.75
本期末	7,563.00	-7,213.21	349.79

## 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05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,655.91	7,167.32
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	414.42	3,734.44
其他	69.42	28.79
合计	2,139.75	10,930.55

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效
----	--------------------	-------------------------------

	2021年12月31日	日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,995,804.00	-
减：卖出股票成本总额	2,035,177.82	-
买卖股票差价收入	-39,373.82	-

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	53,781,992.94	54,321,725.51
减：卖出/赎回基金成本总额	52,403,102.93	54,224,647.43
基金投资收益	1,378,890.01	97,078.08

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券 （、债转股及债券到期兑付） 差价收入	36,585.16	-
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	36,585.16	-

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日）
----	------------------------	---------------------------------

	年12月31日	至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,133,017.08	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,051,701.55	-
减：应收利息总额	44,730.37	-
买卖债券差价收入	36,585.16	-

#### 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

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05月09日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	-	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	222,557.54	12,569.34



合计	222,557.54	12,569.34
----	------------	-----------

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,070,381.95	1,299,578.34
——股票投资	-3,756.98	-
——债券投资	5,247.27	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-1,071,872.24	1,299,578.34
——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	-1,070,381.95	1,299,578.34

## 7.4.7.19 其他收入

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05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	61.84	4,386.10
其他	1,869.76	1,166.34
合计	1,931.60	5,552.44

注：赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

## 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05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	6,203.98	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	109,000.39	73,109.45
其中：申购费	23,333.88	10,207.01
赎回费	83,568.80	60,725.67
交易费	2,097.71	2,176.77
合计	115,204.37	73,109.45

## 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年01月0 1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基 金合同生效日）至20 20年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,625.46	31,777.88
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	109,889.24	84,206.75
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	20,211.62	18,384.62

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

## 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05月09日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00

信息披露费	-	100,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,419.85	1,170.83
其他费用	-	400.00
合计	31,419.85	131,570.83

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	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05月09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	59,713.88	103,092.15
其中：支付销售机构的客户维护费	1,385.87	5,861.49

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%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	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
----	----------------------------------	---

	日	
当期发生的基金应支付的托管费	12,537.17	17,657.15

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%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		
	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	399.74	399.74
合计	0.00	399.74	399.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年05月09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		
	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	9,761.54	9,761.54
合计	0.00	9,761.54	9,761.54

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按前一日C类基金份额资产净值的0.20%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提，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金合同生效日（2020年05月09日）持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	97.63%	62.03%

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日

	月31日	2月31日
基金合同生效日（2020年05月09日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,661.45	1,655.91	1,083,456.39	7,167.32

注：除上表列示的金额外，本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，2021年12月31日的相关余额为人民币16,999.51元（2020年12月31日：人民币122,480.68元）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人嘉合基金管理有限公司所管理的基金合计人民币471,712.74元，占本基金资产净值的比例为4.5763%。

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

项目	本期费用 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年05月09日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	4,465.10	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,869.76	1,144.47
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	9,672.26	1,166.34
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,712.19	291.59

注：上述费用为本基金交易及持有基金管理人所管理基金产生的费用，其中申购费、赎回费是实际产生的费用，销售服务费、管理费和托管费为估算费用。

#### 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

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	2021-02-05	2021-02-03	0.700	712,797.13	470.64	713,267.77	-
合计			0.700	712,797.13	470.64	713,267.77	-

嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）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	2021-02-05	2021-02-03	0.700	32,371.17	2,677.58	35,048.75	-
合计			0.700	32,371.17	2,677.58	35,048.75	-



#### 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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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，本基金无因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。

###### 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，本基金无因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。

##### 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工商银行股份有限公司，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发行的证券，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年12月31日	2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	107,635.20	-
未评级	-	-
合计	107,635.20	-

- 1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。
- 2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。
- 3、未评级为短期融资券等无信用评级的债券。

#### 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或基金的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券或基金的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。本基金所持基金标的均为开放式基金标的，所持有的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中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含QDII基金、香港互认基金）；具有良好流动性的金融工具，包括中国证券监督管理委员会依法发行的包括交易所及银行间交易的债券等固定收益类工具，同时固定收益类投资基本为期限一年以内（含一年）的投资标的，保证了组合较高的流动性，不易发生变现困难等情况。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。

本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金不超过基金资产净值的10%。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上市公司发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不超过该上市公司可流通股股票的15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不超过该上市公司可流通股股票的30%。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。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 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
<b>资产</b>							
银行存款	5,661.45	-	-	-	-	-	5,661.45
结算备付金	16,999.51	-	-	-	-	-	16,999.51
存出保证金	1,677.45	-	-	-	-	-	1,677.45
交易性金融资产	564,112.80	-	107,635.20	-	-	9,634,589.44	10,306,337.44
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,176.39	13,176.39
应收利息	-	-	-	-	-	13,039.87	13,039.87
应收申购款	-	-	-	-	-	99.88	99.88
其他资产	-	-	-	-	-	337.58	337.58
资产总计	588,451.21	-	107,635.20	-	-	9,661,243.16	10,357,329.57
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,052.85	1,052.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,779.81	8,779.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,008.96	5,008.96
应付托管费	-	-	-	-	-	1,036.32	1,036.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26.26	26.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,672.62	3,672.62
应交税费	-	-	-	-	-	0.39	0.39
其他负债	-	-	-	-	-	30,001.22	30,001.22
负债总计	-	-	-	-	-	49,578.43	49,578.43
利率敏感度缺口	588,451.21	-	107,635.20	-	-	9,611,664.73	10,307,751.14
<b>上年度末 2020年12月31 日</b>							
<b>资产</b>							
银行存款	1,083,456.39	-	-	-	-	-	1,083,456.39
结算备付金	122,480.68	-	-	-	-	-	122,480.68
存出保证金	6,470.56	-	-	-	-	-	6,470.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	16,396,645.49	16,396,645.49
应收利息	-	-	-	-	-	185.00	185.00
应收申购款	-	-	-	-	-	111.86	111.86
资产总计	1,212,407.63	-	-	-	-	16,396,942.35	17,609,349.98
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	186,042.61	186,042.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,511.59	8,511.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,739.28	1,739.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,008.92	1,008.92
其他负债	-	-	-	-	-	130,027.32	130,027.32
负债总计	-	-	-	-	-	327,329.72	327,329.72
利率敏感度缺口	1,212,407.63	-	-	-	-	16,069,612.63	17,282,020.26

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

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		<table border="1"> <tr> <td>本期末</td> <td>上年度末</td> </tr> </table>
本期末	上年度末	

		2021年12月31日	2020年12月31日
	市场利率平行下降25个基点	1,603.42	-
	市场利率平行上升25个基点	-1,603.42	-

#### 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

本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时监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,075,464.00	10.43	-	-
交易性金融资产—基金投资	8,559,125.44	83.04	16,396,645.49	94.88
交易性金融资产—债券投资	671,748.00	6.52	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,306,337.44	99.99	16,396,645.49	94.88

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	392,035.88	352,757.95
	业绩比较基准下降5%	-392,035.88	-352,757.95

#### 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 公允价值

##### 7.4.14.1.1 以公允价值计量的资产和负债

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。

2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币9,742,224.64元，属于第二层次的余额为564,112.80元，属于第三层次的余额为0（2020年12月31日，属于第一层次的余额为人民币16,396,645.49元，属于第二层次的余额为0，属于第三层次的余额为0）。

##### 7.4.14.1.1.1 第二层次的公允价值计量

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

## 7.4.14.1.1.2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）。

## 7.4.14.1.2其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

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

## 7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

## §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	1,075,464.00	10.38
	其中：股票	1,075,464.00	10.38
2	基金投资	8,559,125.44	82.64
3	固定收益投资	671,748.00	6.49
	其中：债券	671,748.00	6.49
	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	22,660.96	0.22
8	其他各项资产	28,331.17	0.27
9	合计	10,357,329.57	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比
----	------	---------	----------



			例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	72,765.00	0.71
C	制造业	754,601.00	7.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,072.00	0.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	101,595.00	0.99
L	租赁和商务服务业	50,431.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,075,464.00	10.43

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601058	赛轮轮胎	8,500	125,715.00	1.22
2	600048	保利发展	6,500	101,595.00	0.99

3	002271	东方雨虹	1,900	100,092.00	0.97
4	600600	青岛啤酒	1,000	99,000.00	0.96
5	600406	国电南瑞	2,400	96,072.00	0.93
6	300014	亿纬锂能	800	94,544.00	0.92
7	603606	东方电缆	1,800	92,088.00	0.89
8	000860	顺鑫农业	2,300	87,814.00	0.85
9	000568	泸州老窖	300	76,161.00	0.74
10	002128	电投能源	4,900	72,765.00	0.71
11	300058	蓝色光标	4,700	50,431.00	0.49
12	600741	华域汽车	1,700	48,110.00	0.47
13	603501	韦尔股份	100	31,077.00	0.30

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000400	许继电气	268,034.00	1.55
2	000860	顺鑫农业	245,088.00	1.42
3	601058	赛轮轮胎	212,253.00	1.23
4	600418	江淮汽车	207,679.00	1.20
5	600406	国电南瑞	200,751.00	1.16
6	300014	亿纬锂能	198,054.00	1.15
7	002271	东方雨虹	193,547.00	1.12
8	300058	蓝色光标	177,820.00	1.03
9	002128	电投能源	172,153.00	1.00
10	000568	泸州老窖	168,692.00	0.98
11	600600	青岛啤酒	104,883.00	0.61
12	002284	亚太股份	103,079.00	0.60
13	600048	保利发展	102,180.00	0.59
14	601636	旗滨集团	102,131.00	0.59

15	603986	兆易创新	101,996.00	0.59
16	000830	鲁西化工	101,473.00	0.59
17	603606	东方电缆	94,669.80	0.55
18	002466	天齐锂业	92,592.00	0.54
19	002594	比亚迪	92,550.00	0.54
20	600426	华鲁恒升	48,945.00	0.28

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000400	许继电气	253,151.00	1.46
2	600418	江淮汽车	199,883.00	1.16
3	000860	顺鑫农业	149,040.00	0.86
4	300058	蓝色光标	146,873.00	0.85
5	002271	东方雨虹	108,534.00	0.63
6	603986	兆易创新	104,112.00	0.60
7	002128	电投能源	101,282.00	0.59
8	601058	赛轮轮胎	100,603.00	0.58
9	000568	泸州老窖	100,306.00	0.58
10	002284	亚太股份	96,829.00	0.56
11	601636	旗滨集团	93,754.00	0.54
12	600406	国电南瑞	93,731.00	0.54
13	300014	亿纬锂能	92,806.00	0.54
14	000830	鲁西化工	92,501.00	0.54
15	002466	天齐锂业	89,650.00	0.52
16	002594	比亚迪	82,457.00	0.48
17	600426	华鲁恒升	47,670.00	0.28
18	300844	山水比德	42,622.00	0.25

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,114,398.80
卖出股票收入（成交）总额	1,995,804.00

### 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	564,112.80	5.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	107,635.20	1.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	671,748.00	6.52

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019649	21国债01	5,640	564,112.80	5.47
2	123111	东财转3	640	107,635.20	1.04

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金的投资组合比例要求为：投资于证券投资基金基金份额的比例不低于本基金资产的80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金占基金资产的比例不低于60%；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5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资人员在构建基金投资策略时，通过基金标的池的建立筛选被投资基金，基金池的构建条件包括：

（1）4大类基金：股票型及混合型基金、纯债型基金、二级债基、QDII股票型及混合型基金；

（2）3级基金池：初级池、精选池、核心池。精选池及核心池为基金管理人重点关注及挑选的备选池，核心池中的标的为优先投资标的；

（3）具有复杂、衍生品性质的基金份额，不进入本基金备选子基金池中，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

在定量分析的基础上，本基金构建基础池，结合定性和调研后构建核心池，核心池为本基金投资的首选池。每月末或每季末本基金将适时更新基金池。

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001603	易方达安盈回报混合	契约型 开放式	288,252.56	734,179.27	7.12	否
2	007549	中泰开阳价值优选灵活配置混合A	契约型 开放式	294,981.54	677,867.58	6.58	否
3	090018	大成新锐产业混合	契约型 开放式	83,738.87	568,754.41	5.52	否
4	001054	工银瑞信新金融股票A	契约型 开放式	165,877.42	567,798.41	5.51	否
5	001714	工银瑞信文体产业股票A	契约型 开放式	151,935.49	554,716.47	5.38	否
6	040035	华安逆向策略混合A	契约型 开放式	66,319.22	516,295.13	5.01	否
7	006425	嘉合锦程价值精选混合C	契约型 开放式	199,819.01	471,712.74	4.58	是
8	009402	交银施罗德启明混合A	契约型 开放式	220,565.99	402,069.74	3.90	否
9	005821	万家新机遇龙头企业灵活配置混合A	契约型 开放式	143,731.43	383,302.98	3.72	否
10	519002	华安安信消费服务混合A	契约型 开放式	60,190.81	314,015.46	3.05	否

11	002943	广发多因子 灵活配置混 合	契约型 开放式	81,665.52	312,803.4 4	3.03	否
12	001736	圆信永丰优 加生活股票	契约型 开放式	86,826.28	312,748.2 6	3.03	否
13	002593	富国美丽中 国混合A	契约型 开放式	98,052.59	306,610.4 5	2.97	否
14	010160	广发高端制 造股票C	契约型 开放式	91,190.95	302,644.5 2	2.94	否
15	519915	富国消费主 题混合A	契约型 开放式	97,130.57	302,367.4 6	2.93	否
16	002190	农银汇理新 能源主题灵 活配置混合	契约型 开放式	66,005.04	287,544.3 6	2.79	否
17	720001	财通价值动 量混合	契约型 开放式	50,083.71	237,897.6 2	2.31	否
18	519674	银河创新成 长混合A	契约型 开放式	27,143.73	210,486.0 5	2.04	否
19	519003	海富通收益 增长混合	契约型 开放式	77,886.29	209,592.0 1	2.03	否
20	000729	建信中小盘 先锋股票A	契约型 开放式	47,889.80	202,334.4 1	1.96	否
21	288001	华夏经典混 合	契约型 开放式	80,589.37	196,396.2 9	1.91	否
22	008177	建信高股息 主题股票	契约型 开放式	122,801.9 0	195,119.9 4	1.89	否
23	750001	安信策略精 选灵活配置 混合	契约型 开放式	67,994.71	189,705.2 4	1.84	否
24	510300	300ETF	契约型 开放式	20,400.00	102,163.2 0	0.99	否

## 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 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。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,677.45
2	应收证券清算款	13,176.39
3	应收股利	-
4	应收利息	13,039.87
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	337.58
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,331.17

8.13.4 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	123111	东财转3	107,635.20	1.04

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	81	124,742.47	10,009,000.00	99.06%	95,140.37	0.94%
嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	81	1,821.37	0.00	0.00%	147,530.66	100.00%
合计	162	63,281.92	10,009,000.00	97.63%	242,671.03	2.37%

## 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	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	4,814.78	0.050%
	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	2,535.15	1.720%

	合计	7,349.93	0.070%
--	----	----------	--------

### 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	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	0~10
	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	0~10
	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C	-
	合计	0~10

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

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,000.00	97.630%	10,009,000.00	97.630%	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

理人员					
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,009,000.00	97.630%	10,009,000.00	97.630%	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）A	嘉合永泰优选三个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日(2020年05月09日)基金份额总额	20,478,959.22	11,138,194.26
本报告期期初基金份额总额	10,393,605.50	5,742,499.46
本报告期基金总申购份额	58,795.73	33,009.69
减：本报告期基金总赎回份额	348,260.86	5,627,978.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,104,140.37	147,530.66

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。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金持有的基金未发生重大影响事件。

### 11.6 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。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
长江证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	5,110,202.80	100.00%	3,672.62	100.00%	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增德邦证券、东兴证券、东吴证券、银河证券各2个交易单元，新增广发证券、英大证券、长江证券、申港证券各1个交易单元，退租粤开证券2个交易单元。

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。

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

				比例		比例		
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	9,748,5 94.85	100. 00%	500,00 0.00	100. 00%	-	-	60,636,6 03.82	100. 00%
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理变更公告	《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子信息披露网站	2021-01-28
4	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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	2021-01-30
5	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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	2021-01-30

6	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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	2021-01-30
7	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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信息披露网站	2021-02-02
8	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
9	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
10	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
11	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
12	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一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	2021-04-22
13	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
14	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

15	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
16	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
17	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
18	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
19	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2021年第2号）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
20	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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
21	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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
22	嘉合基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告提示性公告	《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	2021-08-31
23	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
24	嘉合基金管理有限公司关于	《上海证券报》、基金管理	2021-09-24



	高级管理人员（董事长）变更的公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
25	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
26	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
27	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
28	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
29	嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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
30	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

## § 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超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101 - 20211231	10,009,000.00	-	0.00	10,009,000.00	97.63%
	2	20210101 - 20210114	5,000,000.00	-	5,000,000.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金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高时，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永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件

二、《嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》

三、《嘉合永泰优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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、基金托管人办公场所。

### 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](http://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