

---

# 嘉合货币市场基金

## 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.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10 |
| §4 管理人报告.....                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 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.....                 | 16 |
| 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.....                                 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 17 |
| §7 年度财务报表.....                               | 20 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 20 |
| 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.....                                | 25 |
| §8 投资组合报告.....                               | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 51 |
| 8.2 债券回购融资情况.....                            | 52 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 52 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....         | 53 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 53 |
| 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....      | 54 |
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....          | 55 |
| 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....  | 55 |
| 8.9 投资组合报告附注.....                            | 55 |
| §9 基金份额持有人信息.....                            | 56 |

|   |    |
|---|----|
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 56 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....             | 57 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 57 |
| 9.4 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.....   | 57 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 58 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 58 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 58 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 58 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 59 |
| 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.....      | 59 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 59 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 60 |
| 11.9 其他重大事件.....                        | 60 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 62 |
| 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..... | 63 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 63 |
| §13 备查文件目录.....                         | 63 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 63 |
| 13.2 存放地点.....                          | 63 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 63 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 基金名称            | 嘉合货币市场基金          |                   |
| 基金简称            | 嘉合货币              |                   |
| 基金主代码           | 001232            |                   |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                   |
| 基金合同生效日         | 2015年05月06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      | 6,903,838,784.15份 |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉合货币A             | 嘉合货币B             |
| 下属分级基金的交易代码     | 001232            | 001233            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 141,293,715.84份   | 6,762,545,068.31份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在保持基金资产的低风险和高流动性前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金将通过分析宏观经济发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素，形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上，本基金将根据不同类别资产的收益率水平，结合各类资产的流动性特征和风险特征，决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。   |

### 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 | 中国工商银行股份有限公司 |

|             |      |                        |                     |
|-------------|------|------------------------|---------------------|
| 信息披露<br>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      | 《上海证券报》        |
| 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<br>数据和指标 | 2021年 |      | 2020年 |      | 2019年 |      |
|-------------------|-------|------|-------|------|-------|------|
|                   | 嘉合货   | 嘉合货币 | 嘉合货   | 嘉合货币 | 嘉合货   | 嘉合货币 |
|                   |       |      |       |      |       |      |

|                      | 币A             | B                | 币A             | B                | 币A             | B                |
|----------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益              | 3,653,425.05   | 161,046,966.09   | 3,645,678.26   | 139,326,000.15   | 6,464,340.10   | 431,112,475.04   |
| 本期利润                 | 3,653,425.05   | 161,046,966.09   | 3,645,678.26   | 139,326,000.15   | 6,464,340.10   | 431,112,475.04   |
| 本期净值收益率              | 1.9990%        | 2.2443%          | 1.9659%        | 2.2112%          | 2.5198%        | 2.7663%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2021年末         |                  | 2020年末         |                  | 2019年末         |                  |
| 期末基金资产净值             | 141,293,715.84 | 6,762,545,068.31 | 160,363,861.67 | 5,583,252,269.55 | 226,981,285.26 | 5,042,903,041.63 |
| 期末基金份额净值             | 1.0000         | 1.0000           | 1.0000         | 1.0000           | 1.0000         | 1.0000           |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2021年末         |                  | 2020年末         |                  | 2019年末         |                  |
| 累计净值收益率              | 21.3883%       | 23.3500%         | 19.0092%       | 20.6425%         | 16.7147%       | 18.0325%         |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配是每日结转份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉合货币A

| 阶段    | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.4785%  | 0.0040%     | 0.3403%    | 0.0000%       | 0.138 | 0.004 |

|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
|            |          |         |         |         | 2%       | 0%      |
| 过去六个月      | 0.9738%  | 0.0042% | 0.6805% | 0.0000% | 0.2933%  | 0.0042% |
| 过去一年       | 1.9990%  | 0.0046% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6490%  | 0.0046% |
| 过去三年       | 6.6250%  | 0.0042% | 4.0537% | 0.0000% | 2.5713%  | 0.0042% |
| 过去五年       | 15.0403% | 0.0055% | 6.7537% | 0.0000% | 8.2866%  | 0.0055% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.3883% | 0.0074% | 8.9951% | 0.0000% | 12.3932% | 0.0074% |

## 嘉合货币B

| 阶段         | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③      | ②-④     |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.5395%      | 0.0040%             | 0.3403%            | 0.0000%                   | 0.1992%  | 0.0040% |
| 过去六个月      | 1.0961%      | 0.0042%             | 0.6805%            | 0.0000%                   | 0.4156%  | 0.0042% |
| 过去一年       | 2.2443%      | 0.0046%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.8943%  | 0.0046% |
| 过去三年       | 7.3961%      | 0.0042%             | 4.0537%            | 0.0000%                   | 3.3424%  | 0.0042% |
| 过去五年       | 16.4303%     | 0.0055%             | 6.7537%            | 0.0000%                   | 9.6766%  | 0.0055% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.3500%     | 0.0074%             | 8.9951%            | 0.0000%                   | 14.3549% | 0.0074% |

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



嘉合货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年05月06日-2021年12月31日)



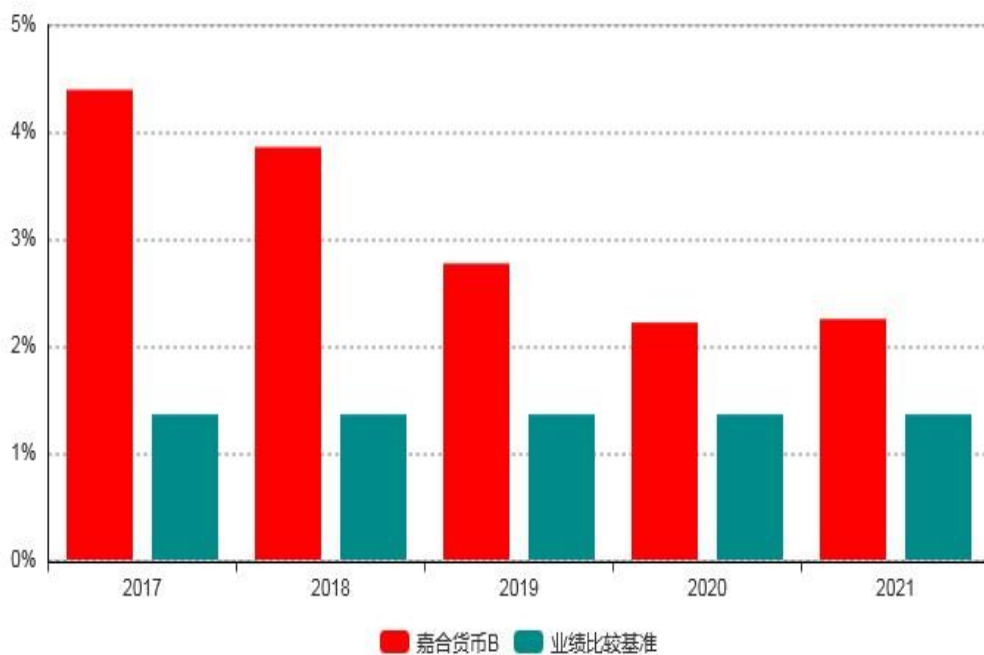
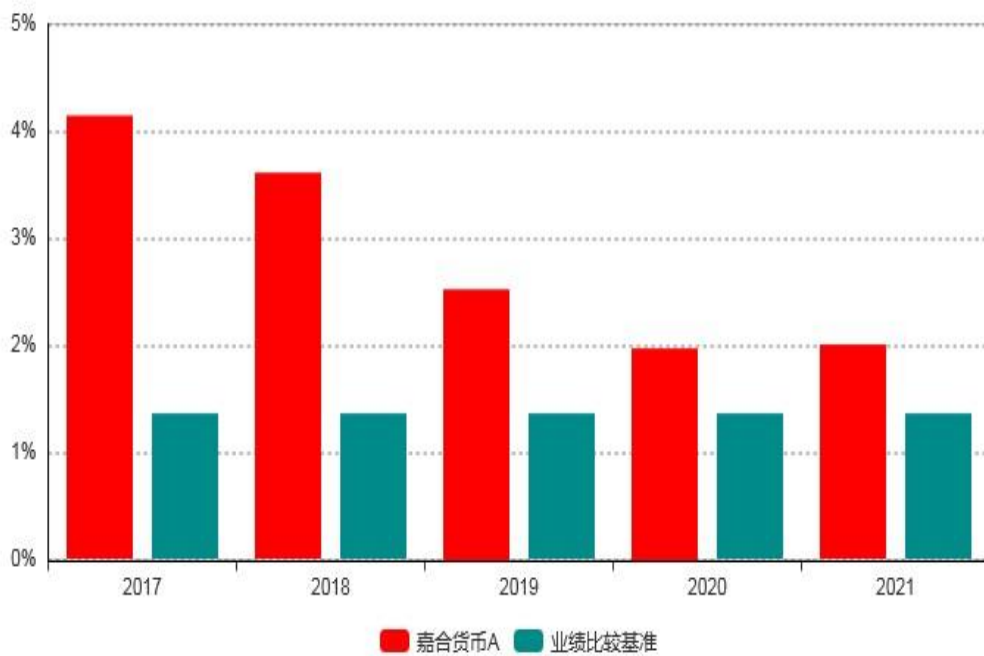
注：截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

嘉合货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年05月06日-2021年12月31日)



注：截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

嘉合货币A

单位：人民币元

| 年度    | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应<br>付赎回款转<br>出金额 | 应付利润本<br>年变动 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|-------|------------------|-----------------------|--------------|---------------|----|
| 2021年 | 3,653,425.05     | -                     | -            | 3,653,425.05  | -  |
| 2020年 | 3,645,678.26     | -                     | -            | 3,645,678.26  | -  |
| 2019年 | 6,464,340.10     | -                     | -            | 6,464,340.10  | -  |
| 合计    | 13,763,443.41    | -                     | -            | 13,763,443.41 | -  |

嘉合货币B

单位：人民币元

| 年度    | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应<br>付赎回款转<br>出金额 | 应付利润本<br>年变动 | 年度利润分配合<br>计   | 备注 |
|-------|------------------|-----------------------|--------------|----------------|----|
| 2021年 | 161,046,966.09   | -                     | -            | 161,046,966.09 | -  |
| 2020年 | 139,326,000.15   | -                     | -            | 139,326,000.15 | -  |
| 2019年 | 431,112,475.04   | -                     | -            | 431,112,475.04 | -  |
| 合计    | 731,485,441.28   | -                     | -            | 731,485,441.28 | -  |

注：本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益，每日将投资人账户收益结转为基金份额，计入该投资人账户的基金份额中。

## § 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。 | 2015-07-08      | -    | 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。 |

|     |   |            |   |     |   |
|-----|---|------------|---|-----|---|
| 于启明 | 固定收益公募投资部副总监，嘉合货币市场基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合磐泰短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的基金经理。 | 2016-01-29 | - | 14年 | 上海财经大学经济学硕士，厦门大学经济学学士，拥有14年金融从业经验。曾任宝盈货币市场证券投资基金基金经理和宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理。2015年加入嘉合基金管理有限公司。 |
|-----|---|------------|---|-----|---|

注：1、季慧娟、于启明的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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

2021年新冠疫情反复扰动全球经济，但随着疫苗接种和特效药的持续推进，各国经济复苏前景改善，发达经济体宽松的货币政策开始边际收紧。国内经济虽面临“三重压力”，但整体经济水平在合理区间运行，全年GDP同比增长8.1%，两年平均增长5.1%，在主要经济体中依然保持领先，节奏上呈现“前高后低”的特征。“三驾马车”延续外需强、内需弱的特征，消费相对疲软，主要是受到疫情反复和居民收入增速放缓的影响；投资同比下滑，其中房地产投资单月同比增速从4月起转为负增长，对经济形成明显拖累，基建投资也在9月落入负增长区间，低于市场预期，只有制造业投资尤其是高端技术制造表现相对亮眼；出口依然表现强劲，对经济起到明显拉动作用。通胀方面，2021年国内呈现结构性通胀。CPI全年低位徘徊，而PPI从1月初的0.3%一路上涨到10月份的13.5%随后回落至年末的10.3%。政策组合上，政策基调从上半场的“调结构”转向下半场的“稳增长”。我国央行先后在7月、12月两次降准，助力经济复苏，对比之下，积极的财政政策发力相对后置。

全年来看，债券收益率水平趋势下行但波动幅度较2020年明显收窄。具体来看，截至12月31日10年期国债收于2.78%，较年初下行40 bps。行情大致可以分为以下四个阶段：一是1-2月初，突如其来的流动性纠偏扭转了2020年底以来的反弹行情，收益率水平转头向上。二是春节后-6月，市场多空博弈下收益率震荡下行。虽有大宗涨价、发行放量和美债上行等不利因素，但平稳的资金面和“资产荒”带动收益率下行约20bps。三是7-10月，7月初在超预期降准的利好下收益率快速下行，10年期国债最低下探至2.80%。随后政策预期修正和通胀担忧加重，收益率水平差不多回到7月降准前的水平。四是10月下-12月，房地产信用风险、基本面走弱和货币政策进一步宽松带动利率下行并创下年内新低。

报告期内，本基金持续做好流动性管理工作，密切跟踪基本面、政策面、资金面和市场情绪等动向，合理调整组合久期和杠杆水平，积极把握资产配置时点并适时参与债券和同业存单的波段操作，努力为持有人创造持续稳健的投资收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.9990%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；截至报告期末嘉合货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为2.2443%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，宏观经济稳增长的压力依然存在，长期经济增速趋于下行，节奏上大概率是前低后高，结构上“内需弱，外需强”的格局可能出现转变。随着海外供给的逐步恢复和消费的放缓，中国出口增速或将受到较大影响。投资受到房地产拖累较明显，在“房住不炒”的主基调下，全国性房地产政策不存在大幅放松的可能性，更多的是对过去严监管的适度纠偏；新老基建的逐步落成有可能对全年经济下行的压力形成对冲；而制造业投资则存在边际走弱的压力。消费或延续弱复苏状态，主要波动将来自于疫情反复、防控政策和收入修复情况。政策组合上，经济下行压力加大的背景下，政策“稳字当头”。货币政策跨周期调节，预计仍将保持中性偏松的状态，从而为宽财政保驾护航，但也要关注海外经济体加速紧缩对国内货币政策带来的掣肘。

对应到债券市场，收益率的主要趋势依然是由经济基本面决定，这也就意味着2022年债券收益率整体趋势预计是先下后上，就全年来看，可能是收益率低位徘徊、震荡运行的状态，相对来说上半年的机会更大。需要重点关注宽信用政策的效果，尤其是房地产行业的恢复情况可能是一个很大的波动因素。

#### 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关于2015年1季度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



根据基金合同的约定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。本基金本报告期内累计收益分配金额:货币A级3,653,425.05元,货币B级161,046,966.09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货币市场基金的托管过程中,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,嘉合货币市场基金的管理人--嘉合基金管理有限公司在嘉合货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### 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货币市场基金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2200084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   | 嘉合货币市场基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见      | <p>我们审计了后附的嘉合货币市场基金（以下简称“嘉合货币基金”）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。</p> <p>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，公允反映了嘉合货币基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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，我们独立于嘉合货币基金，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。</p>  |
| 强调事项      | -   |
| 其他事项      | -   |
| 其他信息      | <p>嘉合货币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。其他信息包括嘉合货币基金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。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信</p>                          |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>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>   |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <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货币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，除非嘉合货币基金计划进行清算、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货币基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的</p> |

|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>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, 就可能对嘉合货币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货币基金不能持续经营。(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。</p> |     |
| 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  | 欧梦激 |
| 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: 嘉合货币市场基金

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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产:  |         |                    |                     |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 200,512,127.56     | 1,984,971.40        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金           |            | 4,503,045.21               | -                           |
| 存出保证金           |            | 354,256.07                 | 130,816.10                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 4,487,933,516.79           | 4,064,894,639.87            |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 4,487,933,516.79           | 4,064,894,639.87            |
| 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    | 2,345,404,758.11           | 1,996,340,514.50            |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 43,375,064.56              | 17,693,684.86               |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | 258,541.00                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 7,082,082,768.30           | 6,081,303,167.73            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2020年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 175,117,572.89             | 335,199,292.20              |
| 应付证券清算款         |            | 39,170.26                  | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,866,056.52               | 1,426,528.17                |
| 应付托管费           |            | 565,471.70                 | 432,281.27                  |
| 应付销售服务费         |            | 85,944.99                  | 73,717.20                   |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 278,966.73                 | 208,246.72                  |
| 应交税费            |            | 82,574.20                  | 73,143.39                   |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -773.14          | 64,827.56        |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 209,000.00       | 209,000.00       |
| 负债合计          |          | 178,243,984.15   | 337,687,036.51   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 6,903,838,784.15 | 5,743,616,131.22 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 6,903,838,784.15 | 5,743,616,131.22 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 7,082,082,768.30 | 6,081,303,167.73 |

注：1、报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额6,903,838,784.15份，其中嘉合货币A类基金份额净值1.0000元，份额总额141,293,715.84份；嘉合货币B类基金份额净值1.0000元，份额总额6,762,545,068.31份。

2、后附报表附注为本会计报表的组成部分。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉合货币市场基金

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<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|-------------|----------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b> |          | 205,344,755.06                    | 181,133,086.92                     |
| 1. 利息收入     |          | 167,457,739.79                    | 165,565,700.10                     |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.11 | 7,222,803.99                      | 56,817.47                          |
| 债券利息收入      |          | 93,281,157.48                     | 124,558,900.00                     |
| 资产支持证券利息收入  |          | -                                 | 103,728.95                         |
| 买入返售金融资产收入  |          | 66,953,778.32                     | 40,846,253.68                      |

|                        |            |                |                |
|------------------------|------------|----------------|----------------|
| 证券出借利息收入               |            | -              | -              |
| 其他利息收入                 |            | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 37,887,015.27  | 15,567,386.82  |
| 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   | 37,887,015.27  | 15,567,576.73  |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.5 | -              | -189.91        |
| 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（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -              | -              |
| 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   | -              | -              |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 40,644,363.92  | 38,161,408.51  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 24,974,241.38  | 22,442,630.95  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 7,567,952.00   | 6,800,797.27   |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 1,204,481.39   | 1,136,619.64   |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | 105,922.50     | 58,050.00      |
| 5. 利息支出                |            | 6,399,719.77   | 7,276,025.94   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 6,399,719.77   | 7,276,025.94   |
| 6. 税金及附加               |            | 73,910.90      | 137,497.89     |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.21   | 318,135.98     | 309,786.82     |
| <b>三、利润总额（亏损总额</b>     |            | 164,700,391.14 | 142,971,678.41 |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 以“-”号填列)          |  |                |                |
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) |  | 164,700,391.14 | 142,971,678.41 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合货币市场基金

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<br>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)                        | 5,743,616,131.22              | -               | 5,743,616,131.22   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润)               | -                             | 164,700,391.14  | 164,700,391.14     |
| 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)      | 1,160,222,652.93              | -               | 1,160,222,652.93   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 45,673,719,641.02             | -               | 45,673,719,641.02  |
| 2. 基金赎回款                               | -44,513,496,988.09            | -               | -44,513,496,988.09 |
| 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) | -                             | -164,700,391.14 | -164,700,391.14    |
| 五、期末所有者权                               | 6,903,838,784.15              | -               | 6,903,838,784.15   |



| 益（基金净值）                                |                                    |                 |                    |
|--|------------------------------------|-----------------|--------------------|
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2020年01月01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）                        | 5,269,884,326.89                   | -               | 5,269,884,326.89   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                  | 142,971,678.41  | 142,971,678.41     |
| 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）      | 473,731,804.33                     | -               | 473,731,804.33     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 47,662,683,674.59                  | -               | 47,662,683,674.59  |
| 2. 基金赎回款                               | -47,188,951,870.26                 | -               | -47,188,951,870.26 |
| 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） | -                                  | -142,971,678.41 | -142,971,678.41    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 5,743,616,131.22                   | -               | 5,743,616,131.22   |

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

嘉合货币市场基金(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”)《关于准予嘉合货币市场基金注册的批复》(证监许可[2015]571号文)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》等相关法规和《嘉合货币市场基金基金合同》发售,基金合同于2015年5月6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1,036,220,642.42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、《嘉合货币市场基金基金合同》和《嘉合货币市场基金招募说明书》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:现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

#### 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的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况、2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与2020年年度报告相一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

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。每份基金份额面值为1.0000元。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，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 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。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，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。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、每日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，

为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在每日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资者基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资者基金份额不变；若当日净收益小于零时，则缩减投资者基金份额。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下固定收益品种的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。

#### 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[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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 512,127.56         | 1,984,971.40        |
| 定期存款         | 200,000,000.00     | -                   |
| 其中：存款期限1个月以内 | 200,000,000.00     | -                   |
| 存款期限1-3个月    | -                  | -                   |
| 存款期限3个月以上    | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计           | 200,512,127.56     | 1,984,971.40        |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2021年12月31日  |                  |              |            |
|--------|-------|---------------------|------------------|--------------|------------|
|        |       | 摊余成本                | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | 821,791,820.86      | 821,148,897.20   | -642,923.66  | -0.0093    |
|        | 银行间市场 | 3,666,141,695.93    | 3,670,321,600.00 | 4,179,904.07 | 0.0605     |
|        | 合计    | 4,487,933,516.79    | 4,491,470,497.20 | 3,536,980.41 | 0.0512     |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                | -            | -          |
| 合计     |       | 4,487,933,516.79    | 4,491,470,497.20 | 3,536,980.41 | 0.0512     |
| 项目     |       | 上年度末<br>2020年12月31日 |                  |              |            |
|        |       | 摊余成本                | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                   | -                | -            | -          |
|        | 银行间市场 | 4,064,894,639.87    | 4,070,273,700.00 | 5,379,060.13 | 0.0937     |
|        | 合计    | 4,064,894,639.87    | 4,070,273,700.00 | 5,379,060.13 | 0.0937     |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                | -            | -          |
| 合计     |       | 4,064,894,639.87    | 4,070,273,700.00 | 5,379,060.13 | 0.0937     |

注：于12月31日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。1. 偏离金额=影子定价 - 摊余成本；2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 2,345,404,758.11    | -         |
| 合计    | 2,345,404,758.11    | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 1,996,340,514.50    | -         |
| 合计    | 1,996,340,514.50    | -         |

## 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 7,729.61           | 521.57              |
| 应收定期存款利息   | 172,222.20         | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 2,229.04           | -                   |
| 应收债券利息     | 41,216,522.98      | 16,644,675.13       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  | -                   |
| 应收买入返售证券利息 | 1,976,185.39       | 1,048,423.37        |
| 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 | 175.34        | 64.79         |
| 合计 | 43,375,064.56 | 17,693,684.86 |

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>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 | 278,966.73         | 208,246.72          |
| 合计          | 278,966.73         | 208,246.72          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>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         | 209,000.00          |
| 合计          | 209,000.00         | 209,000.00          |

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 嘉合货币A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币A) | 本期<br>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          | 160,363,861.67                | 160,363,861.67 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 本期申购          | 1,199,318,710.14  | 1,199,318,710.14  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,218,388,855.97 | -1,218,388,855.97 |
| 本期末           | 141,293,715.84    | 141,293,715.84    |

## 7.4.7.9.2 嘉合货币B

金额单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币B) | 本期<br>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          | 5,583,252,269.55              | 5,583,252,269.55   |
| 本期申购          | 44,474,400,930.88             | 44,474,400,930.88  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -43,295,108,132.12            | -43,295,108,132.12 |
| 本期末           | 6,762,545,068.31              | 6,762,545,068.31   |

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增；赎回含转换出及分级份额调减。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 嘉合货币A

单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币A)  | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 3,653,425.05  | -     | 3,653,425.05  |
| 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        | -3,653,425.05 | -     | -3,653,425.05 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

## 7.4.7.10.2 嘉合货币B

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |                 |   |                 |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| (嘉合货币B)        |                 |   |                 |
| 上年度末           | -               | - | -               |
| 本期利润           | 161,046,966.09  | - | 161,046,966.09  |
| 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        | -161,046,966.09 | - | -161,046,966.09 |
| 本期末            | -               | - | -               |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 31,607.24                         | 56,208.64                              |
| 定期存款利息收入  | 7,071,347.21                      | -                                      |
| 其他存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | 117,284.97                        | -                                      |
| 其他        | 2,564.57                          | 608.83                                 |
| 合计        | 7,222,803.99                      | 56,817.47                              |

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

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|---------------------------------------|-----------------------------------|--|
| 债券投资收益——买卖债券<br>(、债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | 37,887,015.27                     | 15,567,576.73                          |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                    | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                    | -                                 | -                                      |
| 合计                                    | 37,887,015.27                     | 15,567,576.73                          |

#### 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<br>2021年01月01日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月<br>31日 |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出债券(、债转<br>股及债券到期兑<br>付)成交总额   | 102,173,119,691.87                | 67,190,502,286.89                      |
| 减：卖出债券(、<br>债转股及债券到期<br>兑付)成本总额 | 101,623,305,262.31                | 66,970,282,266.84                      |
| 减：应收利息总额                        | 511,927,414.29                    | 204,652,443.32                         |
| 买卖债券差价收入                        | 37,887,015.27                     | 15,567,576.73                          |

#### 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

单位：人民币元

| 项目                 | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|--------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出资产支持证券成交总额       | -                                 | 28,231,519.43                          |
| 减：卖出资产支持证券成本<br>总额 | -                                 | 28,140,189.91                          |
| 减：应收利息总额           | -                                 | 91,519.43                              |
| 资产支持证券投资收益         | -                                 | -189.91                                |

**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****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**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<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|----|-----------------------------------|--|
|----|-----------------------------------|--|

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| 交易所市场交易费用 | -          | -         |
| 银行间市场交易费用 | 105,922.50 | 58,050.00 |
| 合计        | 105,922.50 | 58,050.00 |

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 审计费用    | 80,000.00                         | 80,000.00                              |
| 信息披露费   | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 证券出借违约金 | -                                 | -                                      |
| 汇划手续费   | 81,175.98                         | 72,586.82                              |
| 中债登     | 18,000.00                         | 18,000.00                              |
| 上清所     | 17,760.00                         | 18,000.00                              |
| 其他费用    | 1,200.00                          | 1,200.00                               |
| 合计      | 318,135.98                        | 309,786.82                             |

#### 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<br>2021年01月01日至202<br>1年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 24,974,241.38                     | 22,442,630.95                          |



|                 |              |              |
|-----------------|--------------|--------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,496,670.53 | 2,597,472.33 |
|-----------------|--------------|--------------|

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%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                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2021年01月01日至2021年12月31日 | 2020年01月01日至2020年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,567,952.00            | 6,800,797.27            |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%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        |            |            |
|                | 嘉合货币A                   | 嘉合货币B      | 合计         |
| 嘉合基金管理有限公司     | 40,872.09               | 606,641.04 | 647,513.13 |
| 合计             | 40,872.09               | 606,641.04 | 647,513.13 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |            |            |
|                | 2020年01月01日至2020年12月31日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |            |            |
|                | 嘉合货币A                   | 嘉合货币B      | 合计         |

|                    |           |            |            |
|--------------------|-----------|------------|------------|
| 嘉合基金<br>管理有限<br>公司 | 56,191.41 | 496,959.28 | 553,150.69 |
| 合计                 | 56,191.41 | 496,959.28 | 553,150.69 |

注：本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{销售服务费率} / \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

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

嘉合货币A

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 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%                                  |

嘉合货币B

份额单位：份

| 项目                  | 本期                          | 上年度可比期间                     |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                     | 2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
| 报告期初持有的基金份额         | 0.00                        | 15,282,085.49               |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                        | 20,872.16                   |
| 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                        | 15,302,957.65               |
| 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%                       |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额、强增。期间赎回/卖出总份额含转换出份额、强减。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均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                      |           | 上年度可比期间                 |           |
|--------------|-------------------------|-----------|-------------------------|-----------|
|              | 2021年01月01日至2021年12月31日 |           | 2020年01月01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 | 512,127.56              | 31,607.24 | 1,984,971.40            | 56,208.64 |

#### 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

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

## 嘉合货币A

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 3,653,425.05     | -                 | -            | 3,653,425.05 | -  |

## 嘉合货币B

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 161,046,966.09   | -                 | -            | 161,046,966.09 | -  |

## 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。

于2021年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金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134,217,572.89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<br>单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|------|------|-------|------------|-------|--------|
|------|------|-------|------------|-------|--------|

|           |             |            |        |           |                |
|-----------|-------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 101900712 | 19沪杭甬MTN001 | 2022-01-04 | 100.81 | 350,000   | 35,284,158.82  |
| 219964    | 21贴现国债64    | 2022-01-04 | 99.44  | 1,052,000 | 104,611,175.13 |
| 合计        |             |            |        | 1,402,000 | 139,895,333.95 |

#### 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为40,900,000.00元，于2022年01月04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，实施董事会风险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信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大，且本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%。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%。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 90,362,699.44      | 479,838,079.38      |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 682,374,740.29     | 702,376,659.18      |
| 合计     | 772,737,439.73     | 1,182,214,738.56    |

- 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，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，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、未评级债券为短期融资券等无信用评级的债券。

#### 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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,382,715,338.01   | 1,672,119,487.34    |
| 合计     | 1,382,715,338.01   | 1,672,119,487.34    |

1、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，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，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。

2、未评级为无信用评级的同业存单。

#### 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 1,147,851,048.74   | 160,539,203.69      |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 1,147,851,048.74   | 160,539,203.69      |

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。

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投资的公允价值。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括：现金，通知存款，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，短期融资券，剩余期限在397天以内（含397天的债券）、资产支持证券、中期票据，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。同时，本基金通过现金流管理策略，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、银行协议存款提前支取、持有高流动性券种、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

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%。本基金与由本基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不超过该商业银行最近一个季度末净资产的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10%。

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。

本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、央行票据、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”(参见附注7.4.4.5)对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年12月31<br>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                   | 200,512,127.56   | -                | -                | -    | -    | -             | 200,512,127.56   |
| 结算备付金                  | 4,503,045.21     | -                | -                | -    | -    | -             | 4,503,045.21     |
| 存出保证金                  | 354,256.07       | -                | -                | -    | -    | -             | 354,256.07       |
| 交易性金融资产                | 632,385,126.12   | 2,646,864,884.84 | 1,208,683,505.83 | -    | -    | -             | 4,487,933,516.79 |
| 买入返售金融资产               | 2,345,404,758.11 | -                | -                | -    | -    | -             | 2,345,404,758.11 |
| 应收利息                   | -                | -                | -                | -    | -    | 43,375,064.56 | 43,375,064.56    |
| 资产总计                   | 3,183,159,313.07 | 2,646,864,884.84 | 1,208,683,505.83 | -    | -    | 43,375,064.56 | 7,082,082,768.30 |
| 负债                     |                  |                  |                  |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款              | 175,117,572.89   | -                | -                | -    | -    | -             | 175,117,572.89   |
| 应付证券清算款                | -                | -                | -                | -    | -    | 39,170.26     | 39,170.26        |
| 应付管理人报酬                | -                | -                | -                | -    | -    | 1,866,056.52  | 1,866,056.52     |
| 应付托管费                  | -                | -                | -                | -    | -    | 565,471.70    | 565,471.70       |
| 应付销售服务费                | -                | -                | -                | -    | -    | 85,944.99     | 85,944.99        |
| 应付交易费用                 | -                | -                | -                | -    | -    | 278,966.73    | 278,966.73       |
| 应交税费                   | -                | -                | -                | -    | -    | 82,574.20     | 82,574.20        |
| 应付利息                   | -                | -                | -                | -    | -    | -773.14       | -773.14          |
| 其他负债                   | -                | -                | -                | -    | -    | 209,000.00    | 209,000.00       |
| 负债总计                   | 175,117,572.89   | -                | -                | -    | -    | 3,126,411.26  | 178,243,984.15   |
| 利率敏感度缺口                | 3,008,041,740.18 | 2,646,864,884.84 | 1,208,683,505.83 | -    | -    | 40,248,653.30 | 6,903,838,784.15 |
| 上年度末<br>2020年12月31     | 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               |

| 日         |                  |                  |                |                |   |               |                  |
|-----------|------------------|------------------|----------------|----------------|---|---------------|------------------|
| 资产        |                  |                  |                |                |   |               |                  |
| 银行存款      | 1,984,971.40     | -                | -              | -              | - | -             | 1,984,971.40     |
| 存出保证金     | 130,816.10       | -                | -              | -              | - | -             | 130,816.10       |
| 交易性金融资产   | 1,229,910,700.03 | 1,704,992,981.49 | 540,227,332.79 | 589,763,625.56 | - | -             | 4,064,894,639.87 |
| 买入返售金融资产  | 1,996,340,514.50 | -                | -              | -              | - | -             | 1,996,340,514.50 |
| 应收利息      | -                | -                | -              | -              | - | 17,693,684.86 | 17,693,684.86    |
| 应收申购款     | -                | -                | -              | -              | - | 258,541.00    | 258,541.00       |
| 资产总计      | 3,228,367,002.03 | 1,704,992,981.49 | 540,227,332.79 | 589,763,625.56 | - | 17,952,225.86 | 6,081,303,167.73 |
| 负债        |                  |                  |                |                |   |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 335,199,292.20   | -                | -              | -              | - | -             | 335,199,292.20   |
| 应付管理人报酬   | -                | -                | -              | -              | - | 1,426,528.17  | 1,426,528.17     |
| 应付托管费     | -                | -                | -              | -              | - | 432,281.27    | 432,281.27       |
| 应付销售服务费   | -                | -                | -              | -              | - | 73,717.20     | 73,717.20        |
| 应付交易费用    | -                | -                | -              | -              | - | 208,246.72    | 208,246.72       |
| 应交税费      | -                | -                | -              | -              | - | 73,143.39     | 73,143.39        |
| 应付利息      | -                | -                | -              | -              | - | 64,827.56     | 64,827.56        |
| 其他负债      | -                | -                | -              | -              | - | 209,000.00    | 209,000.00       |
| 负债总计      | 335,199,292.20   | -                | -              | -              | - | 2,487,744.31  | 337,687,036.51   |
| 利率敏感度缺口   | 2,893,167,709.83 | 1,704,992,981.49 | 540,227,332.79 | 589,763,625.56 | - | 15,464,481.55 | 5,743,616,131.22 |

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进行了分类。

#### 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） |                     |
|    |  | 本期末<br>2021年12月31日          | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 市场利率平行下降25个基点                                      | 2,730,781.89                | 3,072,921.92        |
|    | 市场利率平行上升25个基点                                      | -2,730,781.89               | -3,072,921.92       |

#### 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。

于本年末及上年末，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 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0，属于第二层次的余额为人民币4,487,933,516.79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0，属于第二层次的余额为人民币4,064,894,639.87元，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，本基金将综合考虑估值调整中采用的可观察与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买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，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  | 固定收益投资            | 4,487,933,516.79 | 63.37         |
|    | 其中：债券             | 4,487,933,516.79 | 63.37         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 2,345,404,758.11 | 33.12         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 205,015,172.77   | 2.89          |
| 4  | 其他各项资产            | 43,729,320.63    | 0.62          |
| 5  | 合计                | 7,082,082,768.30 | 100.00        |

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例 (%)  |               |
|----|--------------|----------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 4.27           |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |               |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 175,117,572.89 | 2.54          |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金不存在债券正回购的资金余额超过资产净值20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |

|                   |    |
|-------------------|----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 13 |
|-------------------|----|

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限               | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|----------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30天以内                | 46.11               | 2.54                |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30天(含)—60天           | 15.76               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60天(含)—90天           | 22.29               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90天(含)—120天          | 9.51                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 8.29                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                   | 101.95              | 2.54                |

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

### 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 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券 | 1,068,773,780.60 | 15.48         |

|    |                    |                  |       |
|----|--------------------|------------------|-------|
| 2  | 央行票据               | -                | -     |
| 3  | 金融债券               | 115,855,909.71   | 1.68  |
|    | 其中：政策性金融债          | 115,855,909.71   | 1.68  |
| 4  | 企业债券               | 253,691,869.91   | 3.67  |
| 5  | 企业短期融资券            | 752,694,821.75   | 10.90 |
| 6  | 中期票据               | 914,201,796.81   | 13.24 |
| 7  | 同业存单               | 1,382,715,338.01 | 20.03 |
| 8  | 其他                 | -                | -     |
| 9  | 合计                 | 4,487,933,516.79 | 65.01 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                | -     |

#### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 219964    | 21贴现国债64    | 6,200,000 | 616,529,739.36 | 8.93         |
| 2  | 019664    | 21国债16      | 2,920,550 | 291,671,417.84 | 4.22         |
| 3  | 112115326 | 21民生银行CD326 | 2,700,000 | 269,253,371.11 | 3.90         |
| 4  | 101900580 | 19百联集MTN002 | 2,000,000 | 201,718,744.76 | 2.92         |
| 5  | 101900125 | 19国电MTN001  | 2,000,000 | 200,568,969.33 | 2.91         |
| 6  | 112186563 | 21宁波银行CD218 | 2,000,000 | 199,432,808.66 | 2.89         |
| 7  | 019654    | 21国债06      | 1,600,000 | 159,984,564.0  | 2.32         |

|    |           |             |           |                |      |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|------|
|    |           |             |           | 0              |      |
| 8  | 012102349 | 21湘高速SCP004 | 1,500,000 | 150,281,789.74 | 2.18 |
| 9  | 112114143 | 21江苏银行CD143 | 1,500,000 | 149,521,395.87 | 2.17 |
| 10 | 101900117 | 19宝钢MTN001  | 1,200,000 | 120,333,947.67 | 1.74 |

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                           | 偏离情况     |
|------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.1163%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0608% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0368%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内，本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

### 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日计提损益。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司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；宁波银行股份有限公司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。

### 8.9.3 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   | 354,256.07    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 43,375,064.56 |
| 4  | 应收申购款   | -             |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 43,729,320.63 |

### 8.9.4 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<br>级别  | 持有<br>人户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 嘉合<br>货币A | 10,418               | 13,562.46      | 34,897,655.29    | 24.70%         | 106,396,060.55 | 75.30%     |
| 嘉合<br>货币B | 41                   | 164,940,123.62 | 6,762,545,068.31 | 100.00%        | 0.00           | 0.00%      |
| 合计        | 10,459               | 660,085.93     | 6,797,442,723.60 | 98.40%         | 106,396,060.55 | 1.54%      |



|  |    |  |    |    |  |  |
|--|----|--|----|----|--|--|
|  | 59 |  | 60 | 6% |  |  |
|--|----|--|----|----|--|--|

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、B级比例分母为各自级别的份额，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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份)          | 占总份额比例 |
|----|-------|------------------|--------|
| 1  | 银行类机构 | 1,507,895,896.20 | 21.84% |
| 2  | 保险类机构 | 509,464,338.93   | 7.38%  |
| 3  | 保险类机构 | 509,464,338.93   | 7.38%  |
| 4  | 银行类机构 | 505,460,165.68   | 7.32%  |
| 5  | 券商类机构 | 501,097,119.39   | 7.26%  |
| 6  | 券商类机构 | 300,088,771.80   | 4.35%  |
| 7  | 银行类机构 | 206,805,411.01   | 3.00%  |
| 8  | 银行类机构 | 206,448,305.05   | 2.99%  |
| 9  | 银行类机构 | 201,106,685.66   | 2.91%  |
| 10 | 信托类机构 | 200,493,827.07   | 2.90%  |

## 9.3 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<br>(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 | 嘉合货币A | 543,583.71    | 0.380%   |
|                  | 嘉合货币B | -             | -        |
|                  | 合计    | 543,583.71    | 0.010%   |

## 9.4 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<br>(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 | 嘉合货币A | 50~100                |
|                                | 嘉合货币B | -                     |
|                                | 合计    | 50~100                |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 嘉合货币A | -                     |
|                                | 嘉合货币B | -                     |

|  |    |   |
|--|----|---|
|  | 合计 | - |
|--|----|---|

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份额总量在50~100万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 嘉合货币A            | 嘉合货币B             |
|----------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2015年05月06日)基金份额总额 | 568,321.28       | 1,035,652,321.14  |
| 本报告期期初基金份额总额               | 160,363,861.67   | 5,583,252,269.55  |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,199,318,710.14 | 44,474,400,930.88 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 1,218,388,855.97 | 43,295,108,132.12 |
| 本报告期末基金份额总额                | 141,293,715.84   | 6,762,545,068.31  |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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 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，本基金托管人及其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 |    |
| 长江证券       | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券       | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中国国际金融有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、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。

2、本基金本报告期新增德邦证券2个交易单元，新增长江证券1个交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称           | 债券交易                  |              | 债券回购交易                |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|----------------|-----------------------|--------------|-----------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|                | 成交金额                  | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                  | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 长江证券           | -                     | -            | -                     | -              | -    | -            | -    | -            |
| 德邦证券           | -                     | -            | -                     | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中国国际金<br>融有限公司 | 12,358,69<br>2,519.32 | 100.<br>00%  | 13,861,40<br>0,000.00 | 100.<br>00%    | -    | -            | -    | -            |

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过0.5%。

### 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  | 嘉合货币市场基金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  | 嘉合货币市场基金关于2021年春节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告 | 《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                       | 2021-02-05 |
| 4  | 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 |
| 5  | 嘉合货币市场基金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 |
| 9  | 嘉合货币市场基金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 | 关于嘉合货币市场基金2021年劳动节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告 | 《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                       | 2021-04-27 |
| 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 | 嘉合货币市场基金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 | 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 |
| 14 | 嘉合货币市场基金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 |
| 15 | 关于嘉合货币市场基金2021年中秋节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告 | 《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                       | 2021-09-14 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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（副总经理）变更的公告                        | 人网站、中国证监会基金电子披露网站                              |            |
| 18 | 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 |
| 19 | 关于嘉合货币市场基金2021年中国国庆节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告   | 《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                  | 2021-09-25 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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 |
| 22 | 嘉合货币市场基金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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 关于嘉合货币市场基金2022年元旦节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告     | 《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                  | 2021-12-24 |
| 25 | 嘉合货币市场基金(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                          | 2021-12-31 |
| 26 | 嘉合货币市场基金(B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                          | 2021-12-31 |
| 27 | 嘉合货币市场基金招募说明书（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                          | 2021-12-31 |

## § 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              | 20210628 - 20211231   | 1,010,499,937.55 | 2,325,748,267.73 | 1,828,352,309.08 | 1,507,895,896.20 | 21.84% |

**产品特有风险**

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内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货币市场基金募集注册的文件
- 二、《嘉合货币市场基金基金合同》
- 三、《嘉合货币市场基金托管协议》
- 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、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）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