

# 嘉合货币市场基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 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 08 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。本中期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8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30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 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                          | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 7  |
| §4 管理人报告.....                                 | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                         | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....               | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                  | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....              | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....              | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                  | 13 |
| 4.8 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.....        | 13 |
| §5 托管人报告.....                                 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                   | 13 |
| 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.....  | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....        | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                       | 14 |
| 6.1 资产负债表.....                                | 14 |
| 6.2 利润表.....                                  | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                         | 18 |
| 6.4 报表附注.....                                 | 20 |
| §7 投资组合报告.....                                | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                           | 44 |
| 7.2 债券回购融资情况.....                             | 45 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                         | 45 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....          | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                     | 46 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 47 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....       | 47 |
| 7.8 期末按公允价值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.....   | 48 |
| 7.9 投资组合报告附注.....                             | 48 |
| §8 基金份额持有人信息.....                             | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                    | 49 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                   | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                 | 50 |
| 8.4 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.....         | 50 |
| §9 开放式基金份额变动.....                             | 50 |

|   |    |
|---|----|
| §10 重大事件揭示.....                         | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 51 |
| 10.2 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.....   | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 51 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 51 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 52 |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 54 |
| 11.1 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..... | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 54 |
| §12 备查文件目录.....                         | 54 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 54 |
| 12.2 存放地点.....                          | 54 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 55 |

## § 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      | 6,941,209,635.98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 | 163,981,750.94份   | 6,777,227,885.04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55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55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》        |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.haoamc.com |
| 基金中期报告备置地点          | 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            |
|--------|------------|-----------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期<br>(2022年01月01日-2022年06月30日) |               |
|---------------|----------------------------------|---------------|
|               | 嘉合货币A                            | 嘉合货币B         |
| 本期已实现收益       | 1,615,434.29                     | 83,069,242.99 |

|                      |                       |                  |
|----------------------|-----------------------|------------------|
| 本期利润                 | 1,615,434.29          | 83,069,242.99    |
| 本期净值收益率              | 0.9411%               | 1.0612%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2022年06月30日) |                  |
| 期末基金资产净值             | 163,981,750.94        | 6,777,227,885.04 |
| 期末基金份额净值             | 1.0000                | 1.0000           |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2022年06月30日) |                  |
| 累计净值收益率              | 22.5307%              | 24.6591%         |

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<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     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.1206%      | 0.0038%             | 0.1110%            | 0.0000%                   | 0.0096%  | 0.0038% |
| 过去三个月          | 0.4411%      | 0.0043%             | 0.3366%            | 0.0000%                   | 0.1045%  | 0.0043% |
| 过去六个月          | 0.9411%      | 0.0043%             | 0.6695%            | 0.0000%                   | 0.2716%  | 0.0043% |
| 过去一年           | 1.9240%      | 0.0042%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.5740%  | 0.0042% |
| 过去三年           | 6.2073%      | 0.0041%             | 4.0537%            | 0.0000%                   | 2.1536%  | 0.0041% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 22.5307%     | 0.0073%             | 9.6645%            | 0.0000%                   | 12.8662% | 0.0073% |

嘉合货币B

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                | 收益率①     | 收益率标准<br>差② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准<br>差④ |          |         |
|----------------|----------|-------------|------------|-------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.1405%  | 0.0038%     | 0.1110%    | 0.0000%           | 0.0295%  | 0.0038% |
| 过去三个月          | 0.5013%  | 0.0043%     | 0.3366%    | 0.0000%           | 0.1647%  | 0.0043% |
| 过去六个月          | 1.0612%  | 0.0043%     | 0.6695%    | 0.0000%           | 0.3917%  | 0.0043% |
| 过去一年           | 2.1690%  | 0.0042%     | 1.3500%    | 0.0000%           | 0.8190%  | 0.0042% |
| 过去三年           | 6.9753%  | 0.0041%     | 4.0537%    | 0.0000%           | 2.9216%  | 0.0041% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 24.6591% | 0.0073%     | 9.6645%    | 0.0000%           | 14.9946% | 0.0073% |

### 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-2022年06月30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



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。

## § 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2022年6月30日，公司注册资本为人民币3亿元。

截至2022年6月30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、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、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及嘉合锦鑫混合型证券投资基金。

#### 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、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金的基金经理。 | 2015-07-08      | -    | 15年    | 上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士。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  | 2016-01-29      | -    | 15年    | 上海财经大学经济学硕士，厦门大学经济学学士。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                         |

|    |  |            |   |    |                                    |
|----|--|------------|---|----|------------------------------------|
|    | 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。  |            |   |    | 嘉合基金管理有限公司。                        |
| 叶平 | 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、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。 | 2022-02-14 | - | 5年 | 南京大学国民经济学硕士。2017年5月进入嘉合基金管理有限公司工作。 |

注：1、季慧娟、于启明、叶平的“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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。

##### 4.3.2 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

今年以来，海外主要经济体PMI指数加速下滑，消费者信心指数也处于历史低位，但通胀水平却居高不下，为此各国央行纷纷收紧货币政策，金融市场波动加剧。受俄乌冲突、疫情反复和周期性下行的多重影响，国内经济3月以来再次探底，随着各项稳增长政策的落实和疫情的缓解，6月经济活力有所恢复，领先指标PMI时隔3个月后重回荣枯线以上。数据上来看，上半年我国GDP为56.26万亿，同比增长2.5%。其中基建投资是今年稳增长的重要抓手，制造业投资和出口也提供了一定支撑，但房地产投资还处在下行通道，消费也持续低迷。通胀方面，PPI延续高位回落，CPI低位震荡上行，总体通胀压力不大。后续二者变动方向确认，重点关注斜率变化，主要扰动因素还是在能源和猪肉价格。目前政策总基调围绕“稳增长、稳就业、稳物价”，财政政策积极发力，减收与增支多措并举。货币政策稳中偏松，央行采取了包括降准、创设再贷款工具和上缴结存利润等措施，使得4月以来银行间回购中枢基本处于近两年的低位，此外1Y同业存单利率也始终低于MLF利率，反映出中短期流动性都非常宽裕。

在这样的背景下，债券市场利率债收益率曲线陡峭化下行。年初以来，1Y期国债下行29BPs至1.95%，10Y期国债上行5BPs至2.82%。短端的大幅下行主要受益于流动性的宽松，而长端的区间震荡则受到宽信用预期和海外加息等多因素的影响。另一方面，信用债市场则上演了极致的“资产荒”行情，但与前几轮不同的是，这次市场更多地是在压缩相对强资质的城投和非民企产业债。

报告期内，组合积极跟踪市场信号，调节组合久期水平，同时利用杠杆策略，提高交易频率等方式增厚组合收益。

#### 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0.9411%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；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1.0612%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济发展仍然面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”的三重压力。尤其是房地产行业在房企融资受限和居民信心缺失的影响下，销售和投资何时企稳仍需时间等待。政策组合上，政策“稳字当头”。财政政策的前置使得下半年的发挥空间相对减小，叠加2021年的基数影响，后续财政政策方面还需有所作为，因此我们既要紧盯存量政策的落实，还要关注增量政策的出台。货币政策大概率将延续宽松。一方面，近期高层的表态仍然偏暖；另一方面，当前稳增长形势仍显急迫，客观上需要货币政策保持在稳中偏松的状态。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，这也就意味着当前的经济形势仍然有利于债券市场，尽管收益率绝对和相对水平已

经较低。后续我们会密切关注基本面变化的情况适度参与，尤其是房地产行业的恢复情况，同时观察财政政策的增量信息和货币政策的边际变化。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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：嘉合货币A级1,615,434.29元，嘉合货币B级83,069,242.99元。

#### 4.8 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 托管人对本中期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2022年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉合货币市场基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 351,794.74         | 200,512,127.56      |
| 结算备付金      |         | 1,029,099.74       | 4,503,045.21        |
| 存出保证金      |         | 317,612.21         | 354,256.07          |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 4,657,276,421.66   | 4,487,933,516.79    |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 4,657,276,421.66   | 4,487,933,516.79    |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 2,711,397,222.68   | 2,345,404,758.11    |
| 债权投资       |         | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 39,144,071.89              | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 35,087,527.94              | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          |            | -                          | 43,375,064.56               |
| 资产总计          |            | 7,444,603,750.86           | 7,082,082,768.30            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021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        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 500,032,876.71             | 175,117,572.89              |
| 应付清算款         |            | -                          | 39,170.26                   |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 2,050,105.23               | 1,866,056.52                |
| 应付托管费         |            | 621,244.00                 | 565,471.70                  |
| 应付销售服务费       |            | 98,075.48                  | 85,944.99                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 50,540.48                  | 82,574.20                   |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.5    | 541,272.98                 | 487,193.59                  |
| 负债合计          |            | 503,394,114.88             | 178,243,984.15              |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |

|          |         |                  |                  |
|----------|---------|------------------|------------------|
| 实收基金     | 6.4.7.6 | 6,941,209,635.98 | 6,903,838,784.15 |
| 其他综合收益   |         | -                | -                |
| 未分配利润    | 6.4.7.7 | -                | -                |
| 净资产合计    |         | 6,941,209,635.98 | 6,903,838,784.15 |
| 负债和净资产总计 |         | 7,444,603,750.86 | 7,082,082,768.30 |

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额6,941,209,635.98份，其中嘉合货币A类基金份额净值1.0000元，份额总额163,981,750.94份；嘉合货币B类基金份额净值1.0000元，份额总额6,777,227,885.04份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-------------------|----------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 107,214,801.54                    | 99,573,225.23                      |
| 1. 利息收入           |          | 31,085,940.32                     | 88,330,985.47                      |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.8  | 1,113,521.07                      | 1,601,324.39                       |
| 债券利息收入            |          | -                                 | 53,306,965.11                      |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                 | -                                  |
| 买入返售金融资产收入        |          | 29,972,419.25                     | 33,422,695.97                      |
| 证券出借利息收入          |          | -                                 | -                                  |
| 其他利息收入            |          | -                                 | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 76,531,180.33                     | 11,242,239.76                      |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.9  | -                                 | -                                  |
| 基金投资收益            | 6.4.7.10 | -                                 | -                                  |
| 债券投资收益            | 6.4.7.11 | 76,531,180.33                     | 11,242,239.76                      |



|                                 |                |               |               |
|---------------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.12       | -             | -             |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.13       | -             | -             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.14       | -             | -             |
| 股利收益                            | 6.4.7.15       | -             | -             |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认<br>产生的收益   |                | -             | -             |
| 其他投资收益                          |                | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.16       | -             | -             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |                | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.17       | -402,319.11   | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |                | 22,530,124.26 | 18,322,913.41 |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.<br>1 | 13,270,505.44 | 12,054,385.63 |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.<br>2 | 4,021,365.29  | 3,652,844.19  |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.<br>3 | 610,407.50    | 584,909.58    |
| 4. 投资顾问费                        |                | -             | -             |
| 5. 利息支出                         |                | 4,424,793.92  | 1,785,955.20  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |                | 4,424,793.92  | 1,785,955.20  |
| 6. 信用减值损失                       |                | -             | -             |
| 7. 税金及附加                        |                | 48,544.71     | 52,717.72     |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.18       | 154,507.40    | 192,101.09    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |                | 84,684,677.28 | 81,250,311.82 |
| 减：所得税费用                         |                | -             | -             |

|                   |  |               |               |
|-------------------|--|---------------|---------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 84,684,677.28 | 81,250,311.82 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -             | -             |
| 六、综合收益总额          |  | 84,684,677.28 | 81,250,311.82 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉合货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        |                   |                       |
|-------------------------------------|-------------------------------|--------|-------------------|-----------------------|
|                                     | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计                 |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 6,903,838,78<br>4.15          | -      | -                 | 6,903,838,78<br>4.15  |
| 加：会计政策变更                            | -                             | -      | -                 | -                     |
| 前期差错更正                              | -                             | -      | -                 | -                     |
| 其他                                  | -                             | -      | -                 | -                     |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                     | 6,903,838,78<br>4.15          | -      | -                 | 6,903,838,78<br>4.15  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 37,370,851.8<br>3             | -      | -                 | 37,370,851.8<br>3     |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | -      | 84,684,677.2<br>8 | 84,684,677.2<br>8     |
| （二）、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） | 37,370,851.8<br>3             | -      | -                 | 37,370,851.8<br>3     |
| 其中：1. 基金申购款                         | 18,323,117,0<br>30.01         | -      | -                 | 18,323,117,0<br>30.01 |

|  |                                    |        |                    |                        |
|--|------------------------------------|--------|--------------------|------------------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -18,285,746,<br>178.18             | -      | -                  | -18,285,746,<br>178.18 |
| (三)、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) | -                                  | -      | -84,684,677.<br>28 | -84,684,677.<br>28     |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                  | -      | -                  | -                      |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 6,941,209,63<br>5.98               | -      | -                  | 6,941,209,63<br>5.98   |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |        |                    |                        |
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润              | 净资产合计                  |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 5,743,616,13<br>1.22               | -      | -                  | 5,743,616,13<br>1.22   |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -      | -                  | -                      |
| 前期差错更正                                   | -                                  | -      | -                  | -                      |
| 其他                                       | -                                  | -      | -                  | -                      |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 5,743,616,13<br>1.22               | -      | -                  | 5,743,616,13<br>1.22   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -793,043,09<br>1.76                | -      | -                  | -793,043,09<br>1.76    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                  | -      | 81,250,311.8<br>2  | 81,250,311.8<br>2      |
| (二)、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)      | -793,043,09<br>1.76                | -      | -                  | -793,043,09<br>1.76    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 23,616,698,6                       | -      | -                  | 23,616,698,6           |

|  |                    |   |                |                    |
|--|--------------------|---|----------------|--------------------|
|  | 97.62              |   |                | 97.62              |
| 2. 基金赎回款                                 | -24,409,741,789.38 | - | -              | -24,409,741,789.38 |
| (三)、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) | -                  | - | -81,250,311.82 | -81,250,311.82     |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                  | - | -              | -                  |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 4,950,573,039.46   | - | -              | 4,950,573,039.46   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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6.4.2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2022年6月30日的财务状况、2022年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号—金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号—套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号—金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和2022年中国证监会发布的修订的《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〉》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》和《企业会计准则第24号—套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号—金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量

且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即2022年1月1日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对2022年1月1日本基金资产负债表各项目的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债券投资和应收利息对应的账面价值分别为人民币200,512,127.56元、4,503,045.21元、354,256.07元、2,345,404,758.11元、4,487,933,516.79元和43,375,064.56元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和债券投资，对应的账面价值分别为人民币200,692,079.37元、4,505,274.25元、354,431.41元、2,347,380,943.50元和4,529,150,039.77元。

以摊余成本计量的金融负债

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币175,117,572.89元、278,966.73元、-773.14元和209,000.00元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款和其他负债，对应的账面价值分别为人民币175,116,799.75元和487,966.73元。

于2021年12月31日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金2022年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日（含）以后，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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末         |
|--------------|-------------|
|              | 2022年06月30日 |
| 活期存款         | 351,794.74  |
| 等于：本金        | 351,736.30  |
| 加：应计利息       | 58.44       |
| 减：坏账准备       | -           |
| 定期存款         | -           |
| 等于：本金        | -           |
| 加：应计利息       | -           |
| 减：坏账准备       | -           |
| 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         | -           |
| 等于：本金        | -           |
| 加：应计利息       | -           |
| 减：坏账准备       | -           |
| 合计           | 351,794.74  |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末         |      |      |     |
|----|-------------|------|------|-----|
|    | 2022年06月30日 |      |      |     |
|    | 按实际利率计算的账面  | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
|    |             |      |      |     |

|        |       | 价值               |                  |              | (%)     |
|--------|-------|------------------|------------------|--------------|---------|
| 债券     | 交易所市场 | 185,683,188.94   | 184,999,046.59   | -684,142.35  | -0.0099 |
|        | 银行间市场 | 4,471,593,232.72 | 4,474,730,501.98 | 3,137,269.26 | 0.0452  |
|        | 合计    | 4,657,276,421.66 | 4,659,729,548.57 | 2,453,126.91 | 0.0353  |
| 资产支持证券 |       | -                | -                | -            | -       |
| 合计     |       | 4,657,276,421.66 | 4,659,729,548.57 | 2,453,126.91 | 0.0353  |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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>2022年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                  | -         |
| 银行间市场 | 2,711,397,222.68   | -         |
| 合计    | 2,711,397,222.68   | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年06月30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 | -          |
| 应付交易费用    | 313,094.03 |
| 其中：交易所市场  | -          |
| 银行间市场     | 313,094.03 |
| 应付利息      | -          |
| 预提费用      | 228,178.95 |
| 合计        | 541,272.98 |

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 嘉合货币A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |                 |
|---------------|-------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额(份)                       | 账面金额            |
| 上年度末          | 141,293,715.84                | 141,293,715.84  |
| 本期申购          | 452,744,629.65                | 452,744,629.65  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -430,056,594.55               | -430,056,594.55 |
| 本期末           | 163,981,750.94                | 163,981,750.94  |

##### 6.4.7.6.2 嘉合货币B

金额单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币B) | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |                    |
|---------------|-------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额(份)                       | 账面金额               |
| 上年度末          | 6,762,545,068.31              | 6,762,545,068.31   |
| 本期申购          | 17,870,372,400.36             | 17,870,372,400.36  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -17,855,689,583.63            | -17,855,689,583.63 |
| 本期末           | 6,777,227,885.04              | 6,777,227,885.04   |

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。

#### 6.4.7.7 未分配利润

## 6.4.7.7.1 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       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 1,615,434.29  | -     | 1,615,434.29  |
| 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        | -1,615,434.29 | -     | -1,615,434.29 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

## 6.4.7.7.2 嘉合货币B

单位：人民币元

| 项目<br>(嘉合货币B)  | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 83,069,242.99  | -     | 83,069,242.99  |
| 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        | -83,069,242.99 | -     | -83,069,242.99 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

## 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期                      |
|----------|-------------------------|
|          | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 活期存款利息收入 | 21,051.87               |
| 定期存款利息收入 | 1,011,527.81            |

|           |              |
|-----------|--------------|
| 其他存款利息收入  | -            |
| 结算备付金利息收入 | 78,169.24    |
| 其他        | 2,772.15     |
| 合计        | 1,113,521.07 |

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 54,832,600.62                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 21,698,579.71                 |
| 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                           | 76,531,180.33                 |

##### 6.4.7.11.2 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>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 47,710,442,011.46             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 47,395,514,849.17             |

|          |                |
|----------|----------------|
| 减：应计利息总额 | 293,164,868.94 |
| 减：交易费用   | 63,713.64      |
| 买卖债券差价收入 | 21,698,579.71  |

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | -                       |

|    |             |
|----|-------------|
| 其他 | -402,319.11 |
| 合计 | -402,319.11 |

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用    | 39,671.58               |
| 信息披露费   | 59,507.37               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 汇划手续费   | 36,728.45               |
| 中债登     | 9,000.00                |
| 上清所     | 9,000.00                |
| 其他费用    | 600.00                  |
| 合计      | 154,507.40              |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称        | 与本基金的关系             |
|--------------|---------------------|
| 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 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。

###### 6.4.10.1.6 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至202<br>2年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至202<br>1年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,270,505.44                     | 12,054,385.63                          |



|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 809,494.74 | 806,852.87 |
|-----------------|------------|------------|

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2022年01月01日至2022年06月30日 | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,021,365.29            | 3,652,844.19            |

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。

#### 6.4.10.2.3 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                      |            |            |
|----------------|-------------------------|------------|------------|
|                | 2022年01月01日至2022年06月30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     | 15,559.09               | 320,785.63 | 336,344.72 |
| 合计             | 15,559.09               | 320,785.63 | 336,344.72 |
| 获得销售服务费的       | 上年度可比期间                 |            |            |
|                | 2021年01月01日至2021年06月30日 |            |            |

| 各关联方名称     | 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 | 21,288.08        | 284,467.53 | 305,755.61 |
| 合计         | 21,288.08        | 284,467.53 | 305,755.61 |

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算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 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债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30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 | 351,794.74 | 21,051.87 | 140,472.01 | 11,711.18 |
|--------------|------------|-----------|------------|-----------|

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

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 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,615,434.29     | -                 | -            | 1,615,434.29 | -  |

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 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 83,069,242.99    | -                 | -            | 83,069,242.99 | -  |

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据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。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30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500,032,876.71元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|------------|--------|-----------|----------------|
| 229929 | 22贴现国债29 | 2022-07-01 | 99.60  | 5,320,000 | 529,873,707.85 |
| 合计     |          |            |        | 5,320,000 | 529,873,707.85 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30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。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | 90,362,699.44       |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,282,733,156.51   | 682,374,740.29      |
| 合计     | 1,282,733,156.51   | 772,737,439.73      |

- 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。

**6.4.13.2.2 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。

**6.4.13.2.3 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>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,609,140,180.41   | 1,382,715,338.01    |
| 合计     | 1,609,140,180.41   | 1,382,715,338.01    |

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。

**6.4.13.2.4 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>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 476,291,156.03     | 1,147,851,048.74    |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 476,291,156.03     | 1,147,851,048.74    |

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。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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6.4.12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，并进行适当报告和批露；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。

#### 6.4.13.3.1 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公司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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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6.4.4.5）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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年<br>06月30<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                           | 351,794.74       | -                | -                | -     | -     | -             | 351,794.74       |
| 结算备付金                          | 1,029,099.74     | -                | -                | -     | -     | -             | 1,029,099.74     |
| 存出保证金                          | 317,612.21       | -                | -                | -     | -     | -             | 317,612.21       |
| 交易性金融资产                        | 707,542,105.96   | 3,009,505,768.52 | 940,228,547.18   | -     | -     | -             | 4,657,276,421.66 |
| 买入返售金融资产                       | 2,711,397,222.68 | -                | -                | -     | -     | -             | 2,711,397,222.68 |
| 应收清算款                          | -                | -                | -                | -     | -     | 39,144,071.89 | 39,144,071.89    |
| 应收申购款                          | -                | -                | -                | -     | -     | 35,087,527.94 | 35,087,527.94    |
| 资产总计                           | 3,420,637,835.33 | 3,009,505,768.52 | 940,228,547.18   | -     | -     | 74,231,599.83 | 7,444,603,750.86 |
| 负债                             |                  |                  |                  |       |       |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                      | 500,032,876.71   | -                | -                | -     | -     | -             | 500,032,876.71   |
| 应付管理人报酬                        | -                | -                | -                | -     | -     | 2,050,105.23  | 2,050,105.23     |
| 应付托管费                          | -                | -                | -                | -     | -     | 621,244.00    | 621,244.00       |
| 应付销售服务费                        | -                | -                | -                | -     | -     | 98,075.48     | 98,075.48        |
| 应交税费                           | -                | -                | -                | -     | -     | 50,540.48     | 50,540.48        |
| 其他负债                           | -                | -                | -                | -     | -     | 541,272.98    | 541,272.98       |
| 负债总计                           | 500,032,876.71   | -                | -                | -     | -     | 3,361,238.17  | 503,394,114.88   |
| 利率敏感度缺口                        | 2,920,604,958.62 | 3,009,505,768.52 | 940,228,547.18   | -     | -     | 70,870,361.66 | 6,941,209,635.98 |
| 上年度末<br>2021 年<br>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                         | 632,385,126.12   | 2,646,864,884.84 | 1,208,683,505.83 | -     | -     | -             | 4,487,933,516.79 |

|           |                  |                  |                  |   |   |               |                  |
|-----------|------------------|------------------|------------------|---|---|---------------|------------------|
| 产         |                  |                  |                  |   |   |               |                  |
| 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 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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>2022年06月30日          | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 市场利率平行下降25个基点                                      | 2,638,532.77                | 2,730,781.89        |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 市场利率平行上升25个基点 | -2, 638, 532. 77 | -2, 730, 781. 89 |
|---------------|------------------|------------------|

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

于本报告期末及上年末，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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年06月30日   | 上年度末<br>2021年12月31日  |
|---------------|----------------------|----------------------|
| 第一层次          | -                    | -                    |
| 第二层次          | 4, 657, 276, 421. 66 | 4, 487, 933, 516. 79 |
| 第三层次          | -                    | -                    |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 4,657,276,421.66 | 4,487,933,516.79 |
|----|------------------|------------------|

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。

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

2022年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2021年12月31日：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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            | 4,657,276,421.66 | 62.56         |
|    | 其中：债券             | 4,657,276,421.66 | 62.56         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 2,711,397,222.68 | 36.42         |
|    | 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 | 1,380,894.48     | 0.02   |
| 4 | 其他各项资产       | 74,549,212.04    | 1.00   |
| 5 | 合计           | 7,444,603,750.86 | 100.00 |

## 7.2 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 | 6.22           |              |
|    | 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 | 500,032,876.71 | 7.20         |
|    | 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

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过资产净值20%的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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    | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 27 |

### 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。

### 7.3.2 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  | 49.83              | 7.20               |

|    |                      |        |      |
|----|----------------------|--------|------|
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 2  | 30天(含)—60天           | 11.68  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 3  | 60天(含)—90天           | 31.68  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 4  | 90天(含)—120天          | 0.71   | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 12.83  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 合计 |                      | 106.73 | 7.20 |

#### 7.4 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。

#### 7.5 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      | 1,244,948,114.41 | 17.94         |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 19,939,735.73    | 0.29          |
|    | 其中：政策性金融债 | 19,939,735.73    | 0.29          |
| 4  | 企业债券      | 324,276,630.85   | 4.67          |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,190,710,900.50 | 17.15         |
| 6  | 中期票据      | 268,260,859.76   | 3.86          |
| 7  | 同业存单      | 1,609,140,180.41 | 23.18         |
| 8  | 其他        | -                | -             |

|    |                    |                  |       |
|----|--------------------|------------------|-------|
| 9  | 合计                 | 4,657,276,421.66 | 67.10 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                | -     |

### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)    | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 229929    | 22贴现国债29     | 10,902,000 | 1,085,842,699.81 | 15.64        |
| 2  | 112109234 | 21浦发银行CD234  | 2,000,000  | 199,594,708.16   | 2.88         |
| 3  | 112216083 | 22上海银行CD083  | 2,000,000  | 198,390,380.60   | 2.86         |
| 4  | 042100444 | 21电网CP014    | 1,500,000  | 152,425,289.77   | 2.20         |
| 5  | 012280704 | 22电网SCP006   | 1,500,000  | 151,007,596.90   | 2.18         |
| 6  | 012104049 | 21京能洁能SCP006 | 1,200,000  | 121,806,323.62   | 1.75         |
| 7  | 131900016 | 19三峡GN002    | 1,100,000  | 113,184,507.61   | 1.63         |
| 8  | 172701    | 17汇金01       | 1,000,000  | 103,899,058.20   | 1.50         |
| 9  | 112823    | 19深投02       | 1,000,000  | 102,967,872.96   | 1.48         |
| 10 | 012280919 | 22中建七局SCP003 | 1,000,000  | 100,771,505.28   | 1.45         |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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            | 0.0882% |
| 报告期内偏离度的最低值            | 0.0175% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0408% |

### 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，本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

### 7.8 期末按公允价值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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海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；上海浦东发展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。

#### 7.9.3 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 | 317,612.21    |
| 2  | 应收清算款 | 39,144,071.89 |
| 3  | 应收利息  | -             |
| 4  | 应收申购款 | 35,087,527.94 |



|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 5 | 其他应收款 | -             |
| 6 | 待摊费用  | -             |
| 7 | 其他    | -             |
| 8 | 合计    | 74,549,212.04 |

#### 7.9.4 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。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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 | 11,1<br>83           | 14,663.48          | 38,058,578.40        | 23.2<br>1%     | 125,923,172.54 | 76.79%     |
| 嘉合<br>货币B | 50                   | 135,544.55<br>7.70 | 6,770,133,838.<br>86 | 99.9<br>0%     | 7,094,046.18   | 0.10%      |
| 合计        | 11,2<br>33           | 617,930.17         | 6,808,192,417.<br>26 | 98.0<br>8%     | 133,017,218.72 | 1.92%      |

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）。

#### 8.2 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 | 1,521,556,961.45 | 21.92% |
| 2  | 银行类机构 | 604,744,649.56   | 8.71%  |
| 3  | 保险类机构 | 514,863,071.36   | 7.42%  |
| 4  | 保险类机构 | 514,863,071.36   | 7.42%  |

|    |       |                |       |
|----|-------|----------------|-------|
| 5  | 券商类机构 | 503,559,351.60 | 7.25% |
| 6  | 券商类机构 | 304,296,386.81 | 4.38% |
| 7  | 券商类机构 | 301,619,602.80 | 4.35% |
| 8  | 银行类机构 | 208,996,903.43 | 3.01% |
| 9  | 银行类机构 | 208,636,013.32 | 3.01% |
| 10 | 银行类机构 | 203,237,789.42 | 2.93% |

### 8.3 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<br>例 |
|------------------|-------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 嘉合货币A | 408,347.72    | 0.25%        |
|                  | 嘉合货币B | -             | 0.00%        |
|                  | 合计    | 408,347.72    | 0.01%        |

### 8.4 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<br>间(万份) |
|--|-------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 嘉合货币A | 10~50                 |
|  | 嘉合货币B | -                     |
|  | 合计    | 10~50                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>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、基金投资和部门负责人持有本基金A份额总量在10~50万份(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份额。

## § 9 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) | 568,321.28 | 1,035,652,321.14 |

|               |                |                   |
|---------------|----------------|-------------------|
| 日)基金份额总额      |                |                   |
| 本报告期期初基金份额总额  | 141,293,715.84 | 6,762,545,068.31  |
| 本报告期基金总申购份额   | 452,744,629.65 | 17,870,372,400.36 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 430,056,594.55 | 17,855,689,583.63 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 163,981,750.94 | 6,777,227,885.04  |

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本基金管理人在本报告期内无重大人事变动情况。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 | 股票交易 |     | 应支付该券商的佣金 |     | 备注 |
|------|----|------|-----|-----------|-----|----|
|      |    | 成交金额 | 占当期 | 佣金        | 占当期 |    |
|      |    |      |     |           |     |    |

|            | 单元数量 |   | 股票成交总额的比例 |   | 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：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。

#### 10.7.2 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       | -                | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中国国际金融有限公司 | 7,081,318,646.36 | 100.00%      | 7,057,400,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

#### 10.8 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%。

#### 10.9 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  | 关于嘉合货币市场基金2022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 | 2022-01-20 |
| 2  | 嘉合基金管理有限公司旗下                        | 《上海证券报》、《中国证                  | 2022-01-24 |

|    |  |   |            |
|----|--|---|------------|
|    | 部分基金2021年第四季度报告提示性公告                         | 券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站                           |            |
| 3  | 嘉合货币市场基金2021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                               | 2022-01-24 |
| 4  | 嘉合基金管理有限公司关于调整对投资者使用网上直销汇款交易认购、申购基金实施费率优惠的公告 | 《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 | 2022-02-08 |
| 5  | 嘉合货币市场基金基金经理变更公告                             | 《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                       | 2022-02-15 |
| 6  | 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                               | 2022-02-17 |
| 7  | 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                               | 2022-02-17 |
| 8  | 嘉合货币市场基金招募说明书（更新）（2022年第1号）                  | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                               | 2022-02-17 |
| 9  | 关于嘉合货币市场基金2022年清明前暂停申购、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                       | 2022-03-26 |
| 10 | 嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021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               | 2022-03-31 |
| 11 | 嘉合货币市场基金2021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                               | 2022-03-31 |
| 12 | 嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022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               | 2022-04-22 |
| 13 | 嘉合货币市场基金2022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                               | 2022-04-22 |

|    |                                      |                               |            |
|----|--------------------------------------|-------------------------------|------------|
| 14 | 关于嘉合货币市场基金2022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 | 2022-04-23 |
| 15 | 关于嘉合货币市场基金2022年端午节前暂停申购、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 | 2022-05-28 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                  |                | 报告期末持有基金情况     |                  |        |
|--|----------------|------------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|--------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构   | 1              | 20220101 - 20220630    | 1,507,895,896.20 | 915,446,540.76 | 901,785,475.51 | 1,521,556,961.45 | 21.92% |
| 产品特有风险   |                |                        |                  |                |                |                  |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较高时，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> |                |                        |                  |                |                |                  |        |

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 12.3 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  
二〇二二年八月三十一日