

# 嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金

## 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	10
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	14
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	14
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 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49

§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	嘉合慧康63个月定开债券	
基金主代码	009673	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月04日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,999,034,352.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	009673	009674
报告期末下属分级基金的份额总额	7,999,027,682.77份	6,669.92份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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	基金管理人处、基金托管人住所

## 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 (2022年01月01日-2022年06月30日)
---------------	----------------------------------

	嘉合慧康63个月定 开债券A	嘉合慧康63个月定 开债券C
本期已实现收益	151,531,160.80	122.47
本期利润	151,531,160.80	122.47
加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0184
本期加权平均净值利润率	1.88%	1.83%
本期基金份额净值增长率	1.89%	1.85%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	31,415,164.29	25.25
期末可供分配基金份额利润	0.0039	0.0038
期末基金资产净值	8,030,442,847.06	6,695.17
期末基金份额净值	1.0039	1.0038
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.98%	6.76%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉合慧康63个月定开债券A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.33%	0.01%	0.27%	0.01%	0.06%	0.00%

过去三个月	0.99%	0.01%	0.81%	0.01%	0.18%	0.00%
过去六个月	1.89%	0.01%	1.61%	0.01%	0.28%	0.00%
过去一年	3.77%	0.01%	3.25%	0.01%	0.52%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.98%	0.01%	6.19%	0.01%	0.79%	0.00%

## 嘉合慧康63个月定开债券C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.32%	0.01%	0.27%	0.01%	0.05%	0.00%
过去三个月	0.97%	0.01%	0.81%	0.01%	0.16%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.01%	1.61%	0.01%	0.24%	0.00%
过去一年	3.67%	0.01%	3.25%	0.01%	0.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.76%	0.01%	6.19%	0.01%	0.57%	0.00%

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



嘉合慧康63个月定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年08月04日-2022年06月30日)



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

嘉合慧康63个月定开债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年08月04日-2022年06月30日)



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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	2020-08-04	-	15年	上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士。

	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。				曾任华宝信托有限责任公司交易员，德邦基金管理有限公司债券交易员兼研究员，中欧基金管理有限公司债券交易员。2014年加入嘉合基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	--

注：1、季慧娟的“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《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

2022年上半年，年初经济和金融数据曾展现宽信用效果，但随着俄乌战争和超预期的新一轮疫情的冲击后，国内经济影响巨大，供给冲击、需求收缩和预期转弱三重压力加剧。二季度所有经济数据全线下滑，GDP增速仅为0.4%，因此上半年国内GDP仅增长

2.5%。总体来看，上半年基建投资增速较强，工业生产修复较快，服务业生产较弱，房地产投资持续负增长。美国三月由于通胀压力，进入加息周期。

2022年上半年，银行间流动性始终保持合理宽裕，二季度后资金价格长期保持历史低位。货币政策重大操作上，1月17日，央行下调一年期MLF和7天公开市场逆回购利率各10个基点。1月20日，下调1年期LPR 10个基点至3.7%，下调5年期以上LPR 5个基点至4.6%。4月25日央行下调金融机构存款准备金率0.25%。5月20日，再次下调5年期LPR利率 15基点。

上半年债券市场总体而言，长端收益率呈现震荡行情，10年期国债收益率在2.7%-2.85%区间内震荡。而短端收益率三月份前震荡较大，4月后随资金宽松，收益率呈现大幅下行态势。具体来看，年初到2月，宽货币带动下的牛市行情延续。1月降息如期而至，10年国债收益率最低下行至2.68%。2月到3月上旬，市场V型大反转，尤其是前期备受产品户青睐的信用债和政金债更是迎来剧烈调整。主要源于：1月份金融数据放量带动“宽信用”预期升温、房地产政策放松，外有俄乌地缘冲突；理财和基金赎回也导致债券被动抛售。3月中下旬至4月初，金融数据转弱，上海深圳等多地疫情爆发，货币宽松预期又起，10年国债收益率从高点2.85%下行至2.78%。4月中下旬开始，超预期宽松的资金面维持，短端持续走强。4月15日降准缩量不及预期，10年国债收益率开始反弹回到2.85%位置。5月份后，疫情影响经济表现，高层会议提出经济压力，10年国债收益率快速下行至2.7%附近。6月以来，随着上海复工复产、疫情压力减弱，稳增长政策密集出台，“宽信用”政策进入发力高峰，收益率再度回升，10年国债反弹至2.84%附近。

本基金在报告期内，增配了期限匹配的政策性金融债，提高账户杠杆。关注资金价格，调整融资期限结构和融资场所尽量降低融资成本。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券A基金份额净值为1.0039元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.89%，同期业绩比较基准收益率为1.61%；截至报告期末嘉合慧康63个月定开债券C基金份额净值为1.0038元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.85%，同期业绩比较基准收益率为1.61%。

#### 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，从基本面来看，7月政治局会议突出疫情防控，没有增量宏观政策，房地产压实地方政府责任，整体来说，对消费，基建，房地产等提升效果偏弱，经济修复空间想象减少。从资金面来看，央行上缴利润叠加财政投放，经济内生动力较弱下，流动性处于偏宽松状态。面对下半年，经济和就业压力犹存，为让经济运行在合理区间的大前提下，货币政策仍将保持合理宽裕，大幅收拢资金的概率不大，因此资金面预计

仍将保持宽松状态。待经济内生动力恢复，货币政策传导机制疏通，实物融资需求恢复后，资金面预计将向政策利率靠拢。由于债券收益率已经部分反应货币政策和经济基本面预期，仍需关注用好现有政策下，实体经济的恢复程度，做好债券供给、信贷支持实体、货币和房地产政策等预期差。

#### 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免费提供的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

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

本报告期内，本基金于2022年03月18日实施第一次利润分配，嘉合慧康A每10份基金份额派发红利0.100元，嘉合慧康C每10份基金份额派发红利0.100元，于2022年06月13日实施第二次利润分配，嘉合慧康A每10份基金份额派发红利0.100元，嘉合慧康C每10份基金份额派发红利0.080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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金共进行利润分配 15,998.067379 万元。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	616,310.23	1,262,658.89
结算备付金		59,523,100.85	47,503,536.52
存出保证金		35.56	31,827.50
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	12,899,795,039.01	-
其中：债券投资		12,899,795,039.01	-
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		257,429.43	110,829,059.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	12,756,657,107.62
资产总计		12,960,191,915.08	12,916,284,190.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 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		4,927,852,477.93	4,763,510,421.28
应付清算款		284,593.57	111,335,912.32
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		992,663.39	1,025,157.61
应付托管费		330,887.77	341,719.21
应付销售服务费		0.60	0.62

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	281,749.59	1,172,051.44
负债合计		4,929,742,372.85	4,877,385,262.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	7,999,034,352.69	7,999,034,347.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	31,415,189.54	39,864,580.06
净资产合计		8,030,449,542.23	8,038,898,927.72
负债和净资产总计		12,960,191,915.08	12,916,284,190.20

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0039元，基金份额总额7,999,034,352.69份，其中A类基金份额净值1.0039元，份额总额7,999,027,682.77份；C类基金份额净值1.0038元，份额总额6,669.92份。

2、后附报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：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 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		208,617,826.15	189,344,745.21
1. 利息收入		208,618,175.65	189,344,745.21
其中：存款利息收入	6.4.7.10	521,884.53	182,860.13
债券利息收入		208,096,291.12	189,161,885.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-



证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-349.50	-
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-349.50	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		57,086,542.88	48,431,532.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	5,994,370.78	5,994,520.99
2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,998,123.59	1,998,173.59
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	3.62	3.62
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		48,985,865.94	40,321,555.62
其中：卖出回购金融资产		48,985,865.94	40,321,555.62

支出			
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	108,178.95	117,278.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		151,531,283.27	140,913,212.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		151,531,283.27	140,913,212.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		151,531,283.27	140,913,212.69

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	7,999,034,34 7.66	-	39,864,580.0 6	8,038,898,92 7.72
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）	7,999,034,34 7.66	-	39,864,580.0 6	8,038,898,92 7.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5.03	-	-8,449,390.5 2	-8,449,385.4 9

(一)、综合收益总额	-	-	151,531,283.27	151,531,283.27
(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)	5.03	-	-	5.03
其中:1.基金申购款	5.03	-	-	5.03
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-159,980,673.79	-159,980,673.79
(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)	7,999,034,352.69	-	31,415,189.54	8,030,449,542.23
项 目	上年度可比期间 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)	7,999,034,343.79	-	40,091,197.65	8,039,125,541.44
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)	7,999,034,343.79	-	40,091,197.65	8,039,125,541.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	0.54	-	-3,069,405.63	-3,069,405.09

(一)、综合收益总额	-	-	140,913,212.69	140,913,212.69
(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)	0.54	-	-	0.54
其中: 1. 基金申购款	0.54	-	-	0.54
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-143,982,618.32	-143,982,618.32
(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)	7,999,034,344.33	-	37,021,792.02	8,036,056,136.35

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

嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]945号)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2020年8月4日生效。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额为人民币7,999,034,343.71元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。根据《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金

份额发售公告》的相关规定，本基金以63个月为一个封闭期，本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起至63个月后的对应日的前一日止，首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起至63个月后的对应日的前一日止。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日（包括该日）起进入开放期，每个开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内期间可以办理申购与赎回业务。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“中国邮政储蓄银行”）。

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

#### 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、应收利息和其他资产，对应的账面价值分别为人民币1,262,658.89元、47,503,536.52元、31,827.50元、161,331,909.59元和12,595,325,198.03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、存出保证金和债权资产，对应的账面价值分别为人民币1,281,104.50元、47,527,050.78元、31,843.23元和12,756,615,132.02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4,763,510,421.28元、156,865.74元、806,185.70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4,764,316,606.98元和365,865.74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、其他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、债权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》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) 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。

(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	616,310.23
等于：本金	616,171.28
加：应计利息	138.95
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	616,310.23

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

##### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 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 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	2,800,76	-1,997,98	73,242,94	-	2,872,00
		1,000.00	1.93	3.34	-	5,961.41
	银行间市场	9,890,00	-52,169,4	189,958,4	-	10,027,78
		0,000.00	04.59	82.19	-	9,077.60
	小计	12,690,76	-54,167,3	263,201,4	-	12,899,79
		1,000.00	86.52	25.53	-	5,039.01
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		12,690,76	-54,167,3	263,201,4	-	12,899,79
		1,000.00	86.52	25.53	-	5,039.01

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	173,570.64
其中：交易所市场	-
银行间市场	173,570.64
应付利息	-
预提费用	108,178.95
合计	281,749.59

#### 6.4.7.8 实收基金

##### 6.4.7.8.1 嘉合慧康63个月定开债券A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开债券A)	本期 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	7,999,027,678.28	7,999,027,678.28
本期申购	4.49	4.49
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,999,027,682.77	7,999,027,682.77

##### 6.4.7.8.2 嘉合慧康63个月定开债券C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开债券C)	本期 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	6,669.38	6,669.38
本期申购	0.54	0.54
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,669.92	6,669.92

注：1. 此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 根据《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《嘉合慧康63

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

#### 6.4.7.9 未分配利润

##### 6.4.7.9.1 嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开 债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	39,864,557.26	-	39,864,557.26
本期利润	151,531,160.80	-	151,531,160.80
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	-159,980,553.77	-	-159,980,553.77
本期末	31,415,164.29	-	31,415,164.29

##### 6.4.7.9.2 嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

项目 (嘉合慧康63个月定开 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22.80	-	22.80
本期利润	122.47	-	122.47
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	-120.02	-	-120.02
本期末	25.25	-	25.25

#### 6.4.7.10 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	33,668.02	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	488,044.83	
其他	171.68	
合计	521,884.53	

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 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。

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
债券投资收益——利息收入	-	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-349.50	
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	-349.50
----	---------

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	349.50
买卖债券差价收入	-349.50

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.13.4 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。

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 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	-
中债登	9,000.00
合计	108,178.95

#### 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东

广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日



当期发生的基金应支付的管理费	5,994,370.78	5,994,520.99
其中：支付销售机构的客户维护费	112,409.00	112,414.26

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

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	1,998,123.59	1,998,173.59

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%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		
	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	1.81	1.81
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00

合计	0.00	1.81	1.81
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合慧康63个月定开债券A	嘉合慧康63个月定开债券C	合计
嘉合基金 管理有限 公司	0.00	1.81	1.81
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	1.81	1.81

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.1%年费率计提。

计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 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

单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06月30日						
银行间市场交 易的各关联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄 银行	-	-	-	-	2,100,000, 000.00	110,13 7.00

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

嘉合慧康63个月定开债券A

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,398,999,000.00	29.99%	2,398,999,000.00	29.99%

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	616,310.23	33,668.02	1,879,655.62	43,547.13

注：除上表列示的金额外，本基金通过“邮储银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，2022年6月30日的相关余额为人民币59,523,100.85元。（2021年06月30日：人民币40,322,812.03元）。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

嘉合慧康63个月定开债券A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-0 3-18	2022-03- 18	0.100	79,990,2 74.64	2.23	79,990,2 76.87	-
2	2022-0 6-13	2022-06- 13	0.100	79,990,2 74.64	2.26	79,990,2 76.90	-
合计			0.200	159,980, 549.28	4.49	159,980, 553.77	-

嘉合慧康63个月定开债券C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-0 3-18	2022-03- 18	0.100	66.38	0.30	66.68	-
2	2022-0 6-13	2022-06- 13	0.080	53.10	0.24	53.34	-
合计			0.180	119.48	0.54	120.02	-

**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**

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3,003,999,235.01元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150314	15进出14	2022-07-01	104.63	10,862,000	1,136,468,149.44
150314	15进出14	2022-07-05	104.63	453,000	47,396,434.51
200305	20进出05	2022-07-06	99.37	3,140,000	312,022,800.53
200405	20农发05	2022-07-01	97.33	13,180,000	1,282,760,186.19
200405	20农发05	2022-07-04	97.33	2,100,000	204,385,158.65
200408	20农发08	2022-07-01	102.55	2,100,000	215,352,699.77
合计				31,835,000	3,198,385,429.09

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 1,923,853,242.92 元，分别于2021年07月01日、07月04日、07月05日、07月06日、07月07日、07月13日到到期。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。

#### 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，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

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

#### 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本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 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	616,310.23	-	-	-	-	-	616,310.23
结算备付金	59,523,100.85	-	-	-	-	-	59,523,100.85
存出保	35.56	-	-	-	-	-	35.56



## 嘉合慧康 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年中期报告

证金							
债权投资	-	-	-	12,899,795,039.01	-	-	12,899,795,039.01
应收清算款	-	-	-	-	-	257,429.43	257,429.43
资产总计	60,139,446.64	-	-	12,899,795,039.01	-	257,429.43	12,960,191,915.08
负债							
卖出回购金融资产款	4,927,852,477.93	-	-	-	-	-	4,927,852,477.93
应付清算款	-	-	-	-	-	284,593.57	284,593.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	992,663.39	992,663.39
应付托管费	-	-	-	-	-	330,887.77	330,887.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.60	0.60
其他负债	-	-	-	-	-	281,749.59	281,749.59
负债总计	4,927,852,477.93	-	-	-	-	1,889,894.92	4,929,742,372.85
利率敏感度缺口	-4,867,713,031.29	-	-	12,899,795,039.01	-	-1,632,465.49	8,030,449,542.23
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,262,658.89	-	-	-	-	-	1,262,658.89
结算备付金	47,503,536.52	-	-	-	-	-	47,503,536.52
存出保证金	31,827.50	-	-	-	-	-	31,827.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	110,829,059.67	110,829,059.67
应收利息	-	-	-	-	-	161,331,909.59	161,331,909.59
其他资产	-	-	-	12,595,325,198.03	-	-	12,595,325,198.03
资产总计	48,798,022.91	-	-	12,595,325,198.03	-	272,160,969.26	12,916,284,190.20
负债							

卖出回购金融资产款	4,763,510,421.28	-	-	-	-	-	4,763,510,421.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-	111,335,912.32	111,335,912.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,025,157.61	1,025,157.61
应付托管费	-	-	-	-	-	341,719.21	341,719.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.62	0.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	156,865.74	156,865.74
应付利息	-	-	-	-	-	806,185.70	806,185.70
其他负债	-	-	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	4,763,510,421.28	-	-	-	-	113,874,841.20	4,877,385,262.48
利率敏感度缺口	-4,714,712,398.37	-	-	12,595,325,198.03	-	158,286,128.06	8,038,898,927.72

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账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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度末，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

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

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 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债权投资、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债。于2022年6月30日，除下列所示的债权投资以外，本基金持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异：

本期末(2022年6月30日)，交易所市场债券账面价值为人民币2,872,005,961.41元，公允价值为人民币2,918,696,004.84元；银行间市场债券账面价值为人民币10,027,789,077.60元，公允价值为人民币10,236,611,482.19元；资产支持证券账面价值为0，公允价值为人民币0(2021年12月31日交易所市场债券账面价值为人民币2,798,134,144.62元，公允价值为人民币2,846,172,098.30元；银行间市场债券账面价值为人民币9,797,191,053.41元，公允价值为人民币10,011,227,000.00元；资产支持证券账面价值为0，公允价值为0)。

除特别声明外，本基金按下述原则确认公允价值：

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

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

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,899,795,039.01	99.53
	其中：债券	12,899,795,039.01	99.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,139,411.08	0.46
8	其他各项资产	257,464.99	0.00
9	合计	12,960,191,915.08	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期内未投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,899,795,039.01	160.64
	其中：政策性金融债	12,899,795,039.01	160.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	12,899,795,039.01	160.64

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150314	15进出14	35,500,000	3,714,290,121.99	46.25
2	200405	20农发05	33,000,000	3,211,766,778.77	39.99
3	018017	国开2007	11,501,000	1,184,151,504.35	14.75
4	200315	20进出15	10,900,000	1,119,963,830.31	13.95
5	018083	农发2001	8,806,620	901,865,868.34	11.23

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.12 投资组合报告附注

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

注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35.56
2	应收清算款	257,429.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,464.99

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉合慧康63个月定期开债券A	142	56,331,180.86	7,999,022,000.00	100.00%	5,682.77	0.00%
嘉合慧康63个月定期开债券C	75	88.93	0.00	0.00%	6,669.92	100.00%
合计	217	36,861,909.46	7,999,022,000.00	100.00%	12,352.69	0.00%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉合慧康63个月定期开债券A	1,302.48	0.00%
	嘉合慧康63个月定期开债券C	730.79	10.96%
	合计	2,033.27	0.00%



## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉合慧康63个月定期开债券A	0~10
	嘉合慧康63个月定期开债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合慧康63个月定期开债券A	0~10
	嘉合慧康63个月定期开债券C	-
	合计	0~10

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

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

。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合慧康63个月定期开债券A	嘉合慧康63个月定期开债券C
基金合同生效日(2020年08月04日)基金份额总额	7,999,027,675.05	6,668.66
本报告期期初基金份额总额	7,999,027,678.28	6,669.38
本报告期基金总申购份额	4.49	0.54
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,999,027,682.77	6,669.92

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。

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

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

注：1、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。  
2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

### 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
国元证券	348,954.76	100.00%	69,146,362.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2021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	2022-01-24
2	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金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
3	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
4	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2022年度第一次分红公告	《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-17
5	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
6	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2021年年	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31

	度报告		
7	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
8	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金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
9	嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金2022年度第二次分红公告	《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-09

## § 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	2,398,999,000.00	-	-	2,398,999,000.00	29.99%
	2	20220101 - 20220630	1,599,999,000.00	-	-	1,599,999,000.00	20.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较高为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 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慧康63个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书

- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

## 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