

# 嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证 券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 24 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.11 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	64
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	64
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	65
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>65</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>68</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	68
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	嘉实致安 3 个月定期债券
基金主代码	007879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,181,962,593.83 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略：运用大类资产配置策略，本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。本基金封闭期投资策略还包括：债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，还将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

### 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		嘉实基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	李帅帅
	联系电话	(010)65215588	0755-25878287
	电子邮箱	service@jsfund.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95511-3

传真	(010)65215588	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	100005	518001
法定代表人	经雷	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	106,390,804.45	26,746,070.63	24,140,578.93
本期利润	6,365,113.87	32,088,791.62	18,716,800.15
加权平均基金份额本期利润	0.0021	0.0663	0.0370
本期加权平均净值利润率	0.19%	6.30%	3.56%
本期基金份额净值增长率	-0.70%	6.64%	3.65%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	329,287,091.72	36,339,070.19	25,447,947.45
期末可供分	0.0787	0.0793	0.0503

配基金份额利润			
期末基金资产净值	4,511,249,685.55	497,907,579.59	531,605,009.64
期末基金份额净值	1.0787	1.0863	1.0503
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	11.22%	12.00%	5.03%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）上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。

## 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.34%	0.13%	0.48%	0.22%	-1.82%	-0.09%
过去六个月	-0.49%	0.11%	-1.68%	0.19%	1.19%	-0.08%
过去一年	-0.70%	0.10%	-2.42%	0.21%	1.72%	-0.11%
过去三年	9.76%	0.15%	0.79%	0.19%	8.97%	-0.04%
自基金合同生效起至今	11.22%	0.15%	2.31%	0.19%	8.91%	-0.04%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 85\% \times (\text{中债综合全价指数}(t) / \text{中债综合全价指数}(t-1) - 1) + 10\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

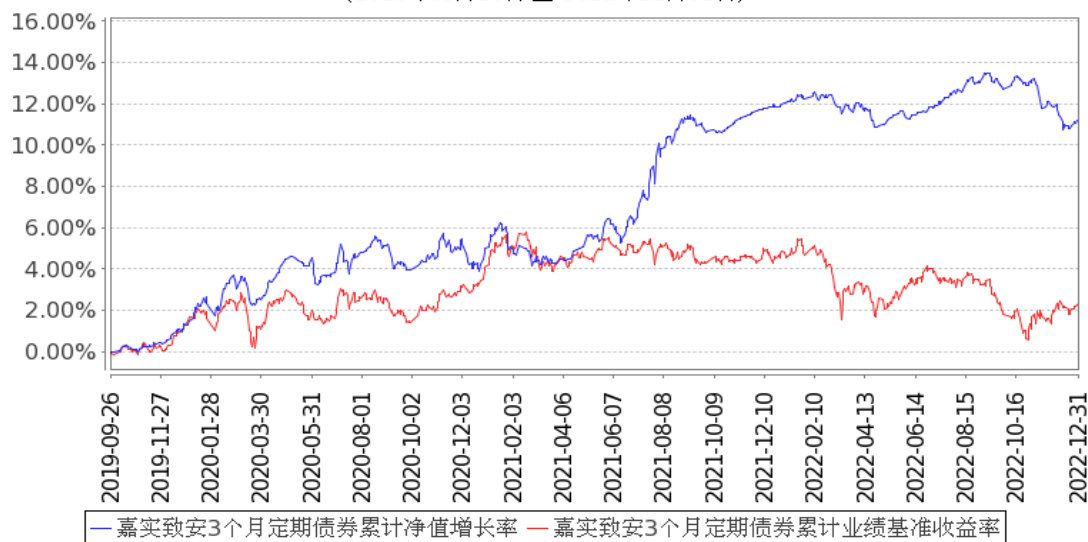
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

嘉实致安3个月定期债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

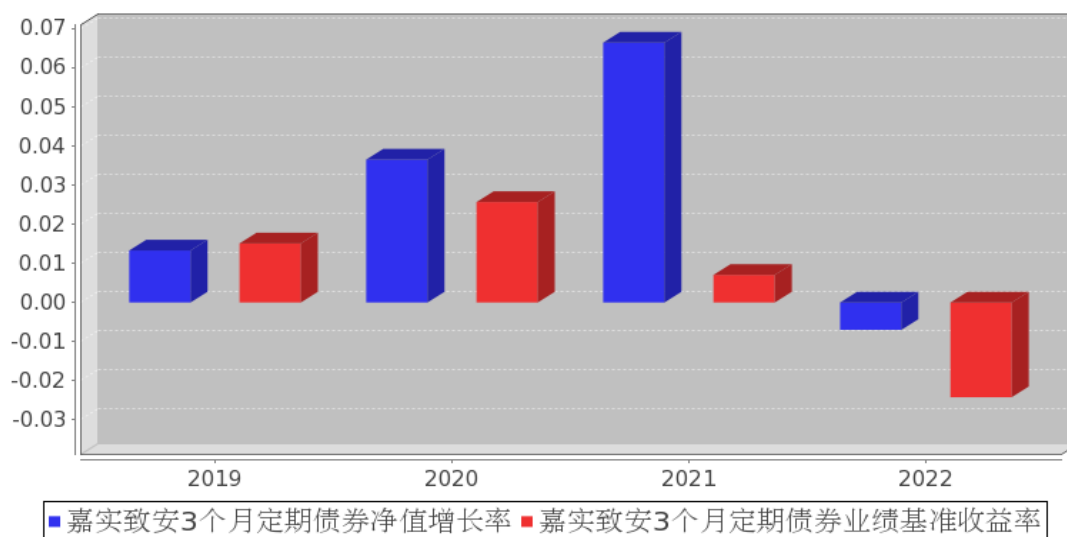
(2019年09月26日至2022年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实致安3个月定期债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。



## 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022年	-	-	-	-	-
2021年	0.3140	15,579,331.75	314,000.00	15,893,331.75	-
2020年	-	-	-	-	-
合计	0.3140	15,579,331.75	314,000.00	15,893,331.75	-

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2022年12月31日，基金管理人共管理298只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

## 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		
赵国英	本基金、嘉实信用债券、嘉实致盈债券、嘉实致享纯债债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券、嘉实中证	2022年5月6日	-	18年	曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020年8月加入嘉实基金管理有限公司。现任投资总监（纯债）。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	同业存单 AAA 指数 7 天持有期 基金经理				
董福焱	本基金、 嘉实策略 混合、嘉 实多元债 券、嘉实 精选平衡 混合基金 经理	2022 年 5 月 6 日	-	12 年	曾任英国德勤会计师事务所审计师，博时基金管理有限公司行业研究员，天弘基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司投资经理。2018 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任职于上海 GARP 投资策略组，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
赖礼辉	本基金、 嘉实安益 混合、嘉 实策略优 选混合、 嘉实稳宏 债券、嘉 实浦盈一 年持有期 混合、嘉 实鑫泰一 年持有混 合基金经 理	2020 年 10 月 19 日	2022 年 5 月 6 日	15 年	曾任长城证券有限责任公司金融研究所股票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财富管理部证券分析师，2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，历任信用研究员、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息

披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 17 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 16 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 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 年国内外均出现较多超预期事件冲击，受到疫情、地产、俄乌冲突等因素的拖累，最终全年国内经济增速未到 5% 左右的目标。从二季度起，经济呈现较大压力，稳增长政策持续发力但效果有限，社融增速阶段性出现下滑。全年通胀压力较小，货币政策维持平稳宽松状态。4 季度出现防疫措施的调整，货币政策也转向灵活，使得资金利率阶段性抬升。总的来看，全年基本面

面临压力，货币政策整体偏松。

22 年债券市场走出先下后上的震荡行情，从 2 季度起随经济压力增大，在货币政策的呵护下各品种利率大幅下行，信用利差大幅压缩，但 4 季度最后两个月出现了利率快速上行的阶段。资金和存单利率的抬升，稳经济信号的释放，理财和基金赎回的负反馈加剧了债券市场的调整，尤其是部分信用债的调整幅度为过去 2 年最大。

报告期内，组合积极参与信用债投资，保持适度的杠杆水平。同时积极运用久期策略，参与利率债交易机会，票息和利率债资本利得均为组合净值提供一定的正贡献。

转债部分采用均衡配置的思路，以平衡型转债和偏股型转债为主。2022 年全球流动性收紧的背景下，转债表现一般，对组合净值带来一定程度上拖累。在国内外影响因素较为复杂的大背景下，我们将主要精力放在自下而上的选取个券方面，重点关注赎回风险可控、正股空间较为明显的优质个券。同时，我们对于下行风险可控，存在主题性投资机会或条款博弈的个券亦有关注。

权益部分，组合三季度主要持有地产、基建，四季度做了部分止盈；持续持有资源链条（原油、有色）和困境反转链条（养殖、电力），增配了高股息（高分红央企、交运等），增配了中小盘股，在疫后复苏板块（航空、酒店、白酒）做了波段。4 季度开始对港股进行配置，贡献了部分收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0787 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.70%，业绩比较基准收益率为-2.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情影响消退，基本面特别是消费的改善，从预期层面将给利率债带来调整压力，但如果后续政策力度或基本面表现不及预期，利率走势仍有波折。考虑到地产拖累、外需回落和消费改善的不确定性，今年基本面弱复苏的可能性较大。在经济确定性回归到合理增长区间之前，预计货币政策稳中偏松的基调不变，流动性环境有望延续“合理充裕”。节奏上，一季度收益率冲高仍有交易机会，下半年更关注通胀走势对货币政策的影响。传统上一季度经济有开门红的诉求，政策层面会较为积极，叠加 12 月疫情过峰，距离第二波大规模感染预计有 3-6 个月平静期，这个窗口期消费复苏的确定性较强，基本面修复趋势难以证伪，利率走势偏谨慎，冲高上行后有机会博弈后续因内生问题导致经济复苏不及预期的交易机会。

转债市场，权益市场整体处于中期底部区域，成长板块经历调整后，在中期成长大周期风格行情延续下，具备一定的配置性价比；稳增长板块期待政策和宏观数据的进一步证实，消费板块亦存在布局机会。转债资产配置上，我们将更加聚焦优质个券，回避双高个券和存在赎回风险的

标的，适当参与波段操作。

权益部分，看好金融、地产等稳增长相关的价值股和高股息央国企资产的估值提升机会，回避机构抱团赛道股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

无。

### § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 25320 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“嘉实致安 3 个月定期债券基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利

	<p>润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实致安 3 个月定期债券基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实致安 3 个月定期债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实致安 3 个月定期债券基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实致安 3 个月定期债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实致安 3 个月定期债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实致安 3 个月定期债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现</p>

	<p>由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实致安 3 个月定期债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实致安 3 个月定期债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张勇	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2023 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	331,606,031.09	1,065,364.51
结算备付金		47,490,813.99	2,604,774.54
存出保证金		472,041.06	13,852.01
交易性金融资产	7.4.7.2	6,169,731,042.89	557,555,535.61
其中：股票投资		321,394,514.31	7,313,068.70
基金投资		-	-
债券投资		5,848,336,528.58	550,242,466.91
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-



其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		25,099,657.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	7,192,745.20
资产总计		6,574,399,586.37	568,432,271.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,022,848,255.70	69,229,843.95
应付清算款		37,846,394.62	826,515.13
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,149,707.90	211,064.21
应付托管费		328,742.25	42,212.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		211,113.70	35,066.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	765,686.65	179,989.22
负债合计		2,063,149,900.82	70,524,692.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	4,181,962,593.83	458,353,589.14
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	329,287,091.72	39,553,990.45
净资产合计		4,511,249,685.55	497,907,579.59
负债和净资产总计		6,574,399,586.37	568,432,271.87

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0787 元，基金份额总额 4,181,962,593.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		41,390,926.39	37,386,026.34
1. 利息收入		2,565,023.56	19,754,578.14
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,809,798.17	43,782.59
债券利息收入		-	19,712,130.89
资产支持证券利息收入		-	-53,255.63
买入返售金融资产收入		755,225.39	51,920.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		138,851,593.41	12,288,727.21
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-2,814,515.62	4,768,071.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	132,624,170.53	14,975,194.31
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-8,262,330.14
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	9,041,938.50	807,791.75
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）	7.4.7.20	-100,025,690.58	5,342,720.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		35,025,812.52	5,297,234.72
1. 管理人报酬		11,554,792.32	2,548,862.05
2. 托管费		3,322,289.25	509,772.35
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		19,714,798.95	1,634,908.89

其中：卖出回购金融资产支出		19,714,798.95	1,634,908.89
6. 信用减值损失	7.4.7.22	39,901.49	-
7. 税金及附加		153,914.39	54,322.80
8. 其他费用	7.4.7.23	240,116.12	549,368.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,365,113.87	32,088,791.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,365,113.87	32,088,791.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,365,113.87	32,088,791.62

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	458,353,589.14	-	39,553,990.45	497,907,579.59
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）	458,353,589.14	-	39,553,990.45	497,907,579.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,723,609,004.69	-	289,733,101.27	4,013,342,105.96
（一）、综合收	-	-	6,365,113.87	6,365,113.87

益总额				
(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)	3,723,609,004.69	-	283,367,987.40	4,006,976,992.09
其中:1. 基金申购款	4,181,962,593.83	-	318,035,076.81	4,499,997,670.64
2. 基金赎回款	-458,353,589.14	-	-34,667,089.41	-493,020,678.55
(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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	4,181,962,593.83	-	329,287,091.72	4,511,249,685.55
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	506,157,062.19	-	25,447,947.45	531,605,009.64

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 (基 金 净 值)	506,157,062.19	-	25,447,947.45	531,605,009.64
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-47,803,473.05	-	14,106,043.00	-33,697,430.05
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	32,088,791.62	32,088,791.62
(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)	-47,803,473.05	-	-2,089,416.87	-49,892,889.92
其中:1. 基 金 申 购 款	310,460.75	-	3,539.25	314,000.00
2 .基 金 赎 回 款	-48,113,933.80	-	-2,092,956.12	-50,206,889.92
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基	-	-	-15,893,331.75	-15,893,331.75

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	458,353,589.14	-	39,553,990.45	497,907,579.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(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”)证监许可[2019]1463 号《关于准予嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,008,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指

引》、《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括



卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后

续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 1,065,364.51 元、2,604,774.54 元、13,852.01 元和 7,192,745.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 1,065,429.01 元、2,605,946.64 元、13,858.21 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 557,555,535.61 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 564,747,038.01 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 69,229,843.95 元、826,515.13 元、211,064.21 元、42,212.85 元、6,673.22 元、-1,684.00 元和 175,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 69,228,159.95 元、826,515.13 元、211,064.21 元、42,212.85 元、6,673.22 元、0.00 元和 175,000.00 元。

i) 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”、“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，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，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”、“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。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《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]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	31,011,488.10	1,065,364.51
等于：本金	31,008,170.44	1,065,364.51
加：应计利息	3,317.66	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	300,594,542.99	-
等于：本金	300,000,000.00	-
加：应计利息	634,444.48	-
减：坏账准备	39,901.49	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	100,124,444.48	-
存款期限 3 个月以上	200,470,098.51	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	331,606,031.09	1,065,364.51

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		347,841,595.87	-	321,394,514.31	-26,447,081.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	657,176,326.74	7,161,886.89	648,471,623.97	-15,866,589.66
	银行间市场	5,191,780,511.75	64,174,704.61	5,199,864,904.61	-56,090,311.75
	合计	5,848,956,838.49	71,336,591.50	5,848,336,528.58	-71,956,901.41
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,196,798,434.36	71,336,591.50	6,169,731,042.89	-98,403,982.97
项目	上年度末 2021年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,098,666.24	-	7,313,068.70	214,402.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	186,705,794.60	-	187,974,466.91	1,268,672.31
	银行间市场	362,129,367.16	-	362,268,000.00	138,632.84
	合计	548,835,161.76	-	550,242,466.91	1,407,305.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		555,933,828.00	-	557,555,535.61	1,621,707.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	7,192,745.20
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	7,192,745.20

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	562,686.65	6,673.22
其中：交易所市场	467,327.99	4,094.64
银行间市场	95,358.66	2,578.58
应付利息	-	-1,684.00
预提费用	203,000.00	175,000.00
合计	765,686.65	179,989.22

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	458,353,589.14	458,353,589.14
本期申购	4,181,962,593.83	4,181,962,593.83
本期赎回（以“-”号填列）	-458,353,589.14	-458,353,589.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,181,962,593.83	4,181,962,593.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	36,339,070.19	3,214,920.26	39,553,990.45
本期利润	106,390,804.45	-100,025,690.58	6,365,113.87
本期基金份额交易产生的变动数	284,399,295.91	-1,031,308.51	283,367,987.40
其中：基金申购款	319,345,707.10	-1,310,630.29	318,035,076.81
基金赎回款	-34,946,411.19	279,321.78	-34,667,089.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	427,129,170.55	-97,842,078.83	329,287,091.72

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	56,586.45
定期存款利息收入	1,278,611.15	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	381,326.77	31,152.89
其他	93,273.80	1,505.49
合计	1,809,798.17	43,782.59

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,814,515.62	4,768,071.29
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-2,814,515.62	4,768,071.29

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	758,034,141.10	151,847,408.01
减：卖出股票成本总额	758,715,867.85	147,079,336.72
减：交易费用	2,132,788.87	-
买卖股票差价收入	-2,814,515.62	4,768,071.29

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

债券投资收益——利息收入	134,847,063.27	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,222,892.74	14,975,194.31
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	132,624,170.53	14,975,194.31

#### 7.4.7.15.2 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1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,074,358,712.94	586,370,441.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,994,195,890.83	560,015,614.37
减：应计利息总额	82,239,720.77	11,379,632.88
减：交易费用	145,994.08	-
买卖债券差价收入	-2,222,892.74	14,975,194.31

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	-	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-8,262,330.14
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-

资产支持证券投资收益—— —申购差价收入	-	-
合计	-	-8,262,330.14

#### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	-	1,818,831.51
减：卖出资产支持证券成本总额	-	10,000,000.00
减：应计利息总额	-	81,161.65
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-8,262,330.14

#### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	9,041,938.50	807,791.75
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	9,041,938.50	807,791.75

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-100,025,690.58	5,342,720.99
股票投资	-26,661,484.02	-2,843,665.15
债券投资	-73,364,206.56	8,186,386.14
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-100,025,690.58	5,342,720.99

#### 7.4.7.21 其他收入

无。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
银行存款	39,901.49	-
买入返售金融资产	-	-
债权投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他	-	-
合计	39,901.49	-

注：在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型



并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金结合中债预期信用损失比例和资产负债表日的资产账面余额计算处于减值第一阶段及第二阶段的资产的预期信用损失。预期信用损失比例通过中债市场隐含违约率与违约损失率的乘积计算获得，违约损失率参数由市场数据分析法确定并可根据历史违约债券的市场信息计算得到。此外，在考虑未来经济影响下，通过对多场景进行分析对资产预期信用损失比例进行前瞻性调整。在考虑前瞻性信息时，本基金考虑了不同的宏观经济情景。2022 年度，中性、乐观与悲观场景下的权重分别为 80%、10%、10%，用于计算中债预期信用损失前瞻性调整系数的国内生产总值同比增长率在中性、乐观以及悲观场景下的预测值为 4.60%、5.52%、3.68%。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	83,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	35,700.00	35,530.00
其他	1,200.00	1,200.00
深港通证券组合费	216.12	-
交易费用	-	337,638.63
合计	240,116.12	549,368.63

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,554,792.32	2,548,862.05
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%/0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。2. 自 2022 年 6 月 13 日起，本基金管理费率由 0.50%调整为 0.30%。3. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,322,289.25	509,772.35

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行股份有限公司	-	902,689,564.05	-	-	500,000,000.00	17,388.77
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
	-	-	-	-	-	-

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

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

无。

## 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	报告期初持有的基金份额	10,310,460.75
报告期间申购/买入总份额	-	310,460.75
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,310,460.75	-
报告期末持有的基金份额	-	10,310,460.75
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.25%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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

无。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司活期	31,011,488.10	56,586.45	1,065,364.51	11,124.21

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本期(2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日)，本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,727,831,070.05 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
1928018	19 工商银行 永续债	2023 年 1 月 3 日	103.51	1,066,000	110,343,558.36
1928021	19 农业银行 永续债 01	2023 年 1 月 3 日	103.17	300,000	30,950,801.10
1928025	19 交通银行 永续债	2023 年 1 月 3 日	102.46	200,000	20,491,632.88
2028017	20 农业银行 永续债 01	2023 年 1 月 3 日	101.88	1,114,000	113,499,679.41
2028018	20 交通银行 二级	2023 年 1 月 3 日	101.92	100,000	10,191,780.82

2028033	20 建设银行 二级	2023年1月3 日	103.41	400,000	41,365,358.90
2028037	20 光大银行 永续债	2023年1月3 日	103.27	200,000	20,653,660.27
2028040	20 交通银行 永续债	2023年1月3 日	103.46	100,000	10,345,590.68
2028051	20 浦发银行 永续债	2023年1月3 日	102.93	300,000	30,877,808.22
2028053	20 中国银行 永续债 03	2023年1月3 日	102.80	410,000	42,146,124.11
2120110	21 北京银行 永续债 02	2023年1月3 日	99.17	600,000	59,501,947.40
2128032	21 兴业银行 二级 01	2023年1月3 日	101.02	67,000	6,768,395.44
2128042	21 兴业银行 二级 02	2023年1月3 日	99.87	200,000	19,974,713.42
2128051	21 工商银行 二级 02	2023年1月3 日	99.72	300,000	29,915,899.73
092280105	22 南京银行 永续债 01	2023年1月4 日	95.33	81,000	7,721,899.55
101900235	19 豫投资 MTN001	2023年1月4 日	104.99	183,000	19,212,752.86
102001021	20 大唐集 MTN001	2023年1月4 日	101.99	1,000,000	101,985,095.89
102002109	20 川能投 MTN003	2023年1月4 日	101.68	1,100,000	111,844,269.04
102200187	22 陕煤化 MTN010	2023年1月4 日	98.16	500,000	49,081,000.00
102280544	22 松江国投 MTN001	2023年1月4 日	101.85	300,000	30,554,284.93
012283988	22 鲁钢铁 SCP009	2023年1月5 日	100.22	432,000	43,293,032.68
092280105	22 南京银行 永续债 01	2023年1月5 日	95.33	1,119,000	106,676,612.23
102280484	22 河钢集 MTN004	2023年1月5 日	101.65	222,000	22,565,791.53
102282226	22 蜀道投资 MTN009	2023年1月5 日	97.57	258,000	25,172,983.66
180321	18 进出 21	2023年1月5 日	102.60	735,000	75,412,147.81
1928014	19 华夏银行 永续债	2023年1月5 日	104.44	691,000	72,167,415.26
1928031	19 广发银行 永续债	2023年1月5 日	102.79	445,000	45,740,147.95

2120107	21 浙商银行 永续债	2023 年 1 月 5 日	98.73	1,264,000	124,799,498.96
1928001	19 中国银行 永续债 01	2023 年 1 月 6 日	105.53	500,000	52,766,917.81
1928014	19 华夏银行 永续债	2023 年 1 月 6 日	104.44	1,190,000	124,282,524.11
1928018	19 工商银行 永续债	2023 年 1 月 6 日	103.51	142,000	14,698,672.88
200219	20 国开 19	2023 年 1 月 6 日	101.92	422,000	43,011,037.76
2028014	20 中国银行 永续债 01	2023 年 1 月 6 日	101.79	340,000	34,609,689.86
2028048	20 中国银行 永续债 02	2023 年 1 月 6 日	102.71	1,300,000	133,521,397.26
2028053	20 中国银行 永续债 03	2023 年 1 月 6 日	102.80	590,000	60,649,300.55
2120107	21 浙商银行 永续债	2023 年 1 月 6 日	98.73	736,000	72,668,062.68
合计				18,907,000	1,919,461,486.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 295,017,185.65 元,于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票,还将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定,建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构,建立健全内部控制机制和 risk 管理制度,坚持审慎经营理念,保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具会计准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将存款减值阶段划分如下：在资产负债表日，若存款的主体隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则存款处于减值第一阶段；若存款的主体隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则存款处于减值第二阶段；若存款的主体隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，存款处于减值第三阶段。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	242,284,829.59	-
合计	242,284,829.59	-

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	4,184,922,983.57	327,377,683.00
AAA 以下	601,437,410.27	56,695,983.91
未评级	651,458,877.27	30,888,000.00
合计	5,437,819,271.11	414,961,666.91

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	168,232,427.88	87,636,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	168,232,427.88	87,636,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性



风险进行管理，通过独立的风险管理部门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期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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	331,606,031.09	-	-	-	331,606,031.09
结算备付金	47,490,813.99	-	-	-	47,490,813.99
存出保证金	472,041.06	-	-	-	472,041.06
交易性金融资产	1,555,818,449.46	3,485,406,776.91	807,111,302.21	321,394,514.31	6,169,731,042.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,099,657.34	25,099,657.34
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,935,387,335.60	3,485,406,776.91	807,111,302.21	346,494,171.65	6,574,399,586.37
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,022,848,255.70	-	-	-	2,022,848,255.70
应付清算款	-	-	-	37,846,394.62	37,846,394.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,149,707.90	1,149,707.90
应付托管费	-	-	-	328,742.25	328,742.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	211,113.70	211,113.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	765,686.65	765,686.65
负债总计	2,022,848,255.70	-	-	40,301,645.12	2,063,149,900.82
利率敏感度缺口	-87,460,920.10	3,485,406,776.91	807,111,302.21	306,192,526.53	4,511,249,685.55
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,065,364.51	-	-	-	1,065,364.51
结算备付金	2,604,774.54	-	-	-	2,604,774.54
存出保证金	13,852.01	-	-	-	13,852.01
交易性金融资产	310,071,000.00	175,592,836.80	64,578,630.11	7,313,068.70	557,555,535.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	7,192,745.20	7,192,745.20
资产总计	313,754,991.06	175,592,836.80	64,578,630.11	14,505,813.90	568,432,271.87
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	69,229,843.95	-	-	-	69,229,843.95
应付清算款	-	-	-	826,515.13	826,515.13
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	211,064.21	211,064.21
应付托管费	-	-	-	42,212.85	42,212.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	35,066.92	35,066.92
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,989.22	179,989.22
负债总计	69,229,843.95	-	-	1,294,848.33	70,524,692.28
利率敏感度缺口	244,525,147.11	175,592,836.80	64,578,630.11	13,210,965.57	497,907,579.59

注：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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-28,306,003.66	-2,255,873.26
	市场利率下降 25 个基点	28,594,784.77	2,295,277.09

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-
-----------------------	---	---	---	---

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币 升值 5%	1,098,547.02	-
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-1,098,547.02	-

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	321,394,514.31	7.12	7,313,068.70	1.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	321,394,514.31	7.12	7,313,068.70	1.47

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	61,103,213.63	13,146,385.86
	业绩比较基准下降5%	-61,103,213.63	-13,146,385.86

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	511,417,759.85	20,606,685.61
第二层次	5,658,313,283.04	536,948,850.00
第三层次	-	-
合计	6,169,731,042.89	557,555,535.61

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

#### 7.4.14.4 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资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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>》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	321,394,514.31	4.89
	其中：股票	321,394,514.31	4.89
2	基金投资	-	-



3	固定收益投资	5,848,336,528.58	88.96
	其中：债券	5,848,336,528.58	88.96
	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	379,096,845.08	5.77
8	其他各项资产	25,571,698.40	0.39
9	合计	6,574,399,586.37	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 21,970,940.38 元，占基金资产净值的比例为 0.49%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,720,707.00	0.24
B	采矿业	13,202,810.12	0.29
C	制造业	100,256,331.20	2.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,940,000.00	0.93
E	建筑业	20,377,976.00	0.45
F	批发和零售业	8,634,000.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	29,173,282.34	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,190,000.00	0.09
J	金融业	55,924,113.05	1.24
K	房地产业	10,212,465.22	0.23
L	租赁和商务服务业	4,791,889.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	299,423,573.93	6.64

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	8,227,016.70	0.18
非必需消费品	10,554,949.78	0.23
必需消费品	-	-
能源	3,188,973.90	0.07
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	21,970,940.38	0.49

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	1,099,855	21,898,113.05	0.49
2	600863	内蒙华电	6,000,000	20,940,000.00	0.46
3	300750	宁德时代	50,000	19,671,000.00	0.44
4	600276	恒瑞医药	400,000	15,412,000.00	0.34
5	002468	申通快递	1,399,938	14,461,359.54	0.32
6	601658	邮储银行	3,000,000	13,860,000.00	0.31
7	728 HK	中国电信	3,000,000	8,227,016.70	0.18
7	601728	中国电信	1,000,000	4,190,000.00	0.09
8	601857	中国石油	1,738,996	8,642,810.12	0.19
8	857 HK	中国石油股份	1,000,000	3,188,973.90	0.07
9	601688	华泰证券	900,000	11,466,000.00	0.25
10	601390	中国中铁	2,000,000	11,120,000.00	0.25
11	2333 HK	长城汽车	1,163,000	10,554,949.78	0.23
12	000600	建投能源	2,000,000	10,500,000.00	0.23
12	600900	长江电力	500,000	10,500,000.00	0.23
13	600720	祁连山	1,000,000	9,930,000.00	0.22
14	000090	天健集团	1,695,600	9,257,976.00	0.21
15	300498	温氏股份	458,900	9,008,207.00	0.20
16	002768	国恩股份	300,000	8,706,000.00	0.19
17	600109	国金证券	1,000,000	8,700,000.00	0.19
18	002462	嘉事堂	600,000	8,634,000.00	0.19
19	002443	金洲管道	1,300,000	8,190,000.00	0.18
20	002092	中泰化学	1,000,000	7,460,000.00	0.17
21	001965	招商公路	815,740	6,338,299.80	0.14
22	000630	铜陵有色	2,000,000	6,240,000.00	0.14
23	002314	南山控股	1,430,500	5,464,510.00	0.12

24	601111	中国国航	500,000	5,300,000.00	0.12
25	002818	富森美	393,100	4,791,889.00	0.11
26	600007	中国国贸	299,934	4,747,955.22	0.11
27	600938	中国海油	300,000	4,560,000.00	0.10
28	603558	健盛集团	500,000	4,120,000.00	0.09
29	601677	明泰铝业	200,000	3,628,000.00	0.08
30	300390	天华超净	59,200	3,308,096.00	0.07
31	600372	中航电子	200,000	3,194,000.00	0.07
32	601919	中远海控	298,700	3,073,623.00	0.07
33	002013	中航机电	300,000	3,015,000.00	0.07
34	002085	万丰奥威	500,000	2,975,000.00	0.07
35	603085	天成自控	200,000	2,128,000.00	0.05
36	300761	立华股份	50,000	1,712,500.00	0.04
37	603327	福蓉科技	52,480	844,403.20	0.02
38	002724	海洋王	104,500	844,360.00	0.02
39	002567	唐人神	83,400	590,472.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	69,016,822.45	13.86
2	601728	中国电信	50,090,000.00	10.06
2	728 HK	中国电信	8,114,188.93	1.63
3	600938	中国海油	39,884,135.00	8.01
4	600863	内蒙华电	34,798,948.00	6.99
5	601288	农业银行	28,580,000.00	5.74
6	601390	中国中铁	27,449,222.00	5.51
7	601688	华泰证券	27,028,289.66	5.43
8	601111	中国国航	26,727,447.20	5.37
9	386 HK	中国石油化工股份	13,090,988.06	2.63
9	600028	中国石化	12,900,000.00	2.59
10	600519	贵州茅台	25,720,775.00	5.17
11	300750	宁德时代	23,475,422.00	4.71
12	600497	驰宏锌锗	21,895,000.00	4.40
13	601668	中国建筑	21,770,000.00	4.37
14	601006	大秦铁路	21,070,466.11	4.23
15	000002	万科 A	20,444,063.00	4.11
16	600900	长江电力	18,256,824.00	3.67
17	001979	招商蛇口	17,653,332.04	3.55
18	600104	上汽集团	17,218,313.89	3.46
19	601919	中远海控	16,974,273.00	3.41

20	000651	格力电器	16,192,485.00	3.25
21	601658	邮储银行	15,777,001.00	3.17
22	600276	恒瑞医药	14,857,370.00	2.98
23	601677	明泰铝业	14,766,380.50	2.97
24	002468	申通快递	14,525,971.72	2.92
25	601857	中国石油	10,744,518.00	2.16
25	857 HK	中国石油股份	3,249,995.59	0.65
26	000090	天健集团	13,730,000.00	2.76
27	002314	南山控股	12,637,697.00	2.54
28	600720	祁连山	11,895,925.00	2.39
29	600009	上海机场	11,850,952.00	2.38
30	000600	建投能源	11,525,564.00	2.31
31	002768	国恩股份	11,236,578.00	2.26
32	2333 HK	长城汽车	11,173,461.03	2.24
33	300498	温氏股份	10,676,422.00	2.14
34	000883	湖北能源	10,497,608.00	2.11
35	000539	粤电力 A	10,386,035.00	2.09
36	601328	交通银行	9,980,000.00	2.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601728	中国电信	47,403,012.00	9.52
2	600030	中信证券	46,851,150.72	9.41
3	600938	中国海油	37,144,789.58	7.46
4	601288	农业银行	28,700,000.00	5.76
5	386 HK	中国石油化工股份	13,610,996.46	2.73
5	600028	中国石化	13,310,000.00	2.67
6	600519	贵州茅台	26,795,281.90	5.38
7	601668	中国建筑	22,620,000.00	4.54
8	601111	中国国航	21,481,561.00	4.31
9	600497	驰宏锌锗	21,353,213.45	4.29
10	601006	大秦铁路	20,400,944.00	4.10
11	001979	招商蛇口	19,395,329.52	3.90
12	000002	万科 A	19,313,323.00	3.88
13	600104	上汽集团	16,683,891.25	3.35
14	000651	格力电器	16,505,700.00	3.32
15	601688	华泰证券	15,160,802.00	3.04
16	601390	中国中铁	13,455,000.00	2.70
17	600863	内蒙华电	13,260,000.00	2.66
18	601677	明泰铝业	12,120,310.95	2.43
19	601919	中远海控	12,004,376.50	2.41

20	600009	上海机场	11,973,351.00	2.40
21	000539	粤电力 A	11,091,477.20	2.23
22	000883	湖北能源	10,560,000.00	2.12

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,099,458,797.48
卖出股票收入（成交）总额	758,034,141.10

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,042,154.52	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,878,286,146.72	63.80
	其中：政策性金融债	247,152,673.98	5.48
4	企业债券	384,535,716.64	8.52
5	企业短期融资券	242,284,829.59	5.37
6	中期票据	1,978,932,007.69	43.87
7	可转债（可交换债）	190,023,245.54	4.21
8	同业存单	168,232,427.88	3.73
9	其他	-	-
10	合计	5,848,336,528.58	129.64

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2028017	20 农业银行永续债 01	2,400,000	244,523,546.30	5.42
2	232280012	22 广州银行二级资本债 01	2,000,000	201,199,178.08	4.46
3	1928014	19 华夏银行永续债	1,900,000	198,434,282.19	4.40
4	2120107	21 浙商银行永续债	2,000,000	197,467,561.64	4.38
5	1928018	19 工商银行永续债	1,900,000	196,672,383.56	4.36

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

无。

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

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中国邮政储蓄银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国进出口银行、浙商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.11.3 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	472,041.06
2	应收清算款	25,099,657.34
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	25,571,698.40

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

1	127019	国城转债	8,751,324.38	0.19
2	113602	景 20 转债	5,339,465.06	0.12
3	110080	东湖转债	5,261,351.67	0.12
4	128132	交建转债	4,936,554.38	0.11
5	113597	佳力转债	4,690,104.02	0.10
6	123048	应急转债	4,546,782.42	0.10
7	127018	本钢转债	4,486,401.72	0.10
8	113033	利群转债	4,249,309.59	0.09
9	123083	朗新转债	4,187,760.27	0.09
10	113591	胜达转债	4,091,815.04	0.09
11	123121	帝尔转债	3,951,446.94	0.09
12	123057	美联转债	3,905,065.75	0.09
13	128040	华通转债	3,859,824.66	0.09
14	127036	三花转债	3,751,003.40	0.08
15	113546	迪贝转债	3,537,164.38	0.08
16	110055	伊力转债	3,534,400.00	0.08
17	123044	红相转债	3,531,156.16	0.08
18	123085	万顺转 2	3,502,650.69	0.08
19	123063	大禹转债	3,435,671.45	0.08
20	113053	隆 22 转债	3,429,247.40	0.08
21	113045	环旭转债	3,424,584.66	0.08
22	113030	东风转债	3,353,898.61	0.07
23	127056	中特转债	3,186,780.12	0.07
24	113621	彤程转债	3,163,055.89	0.07
25	113526	联泰转债	3,131,041.31	0.07
26	127038	国微转债	3,109,994.52	0.07
27	128033	迪龙转债	3,032,243.15	0.07
28	110085	通 22 转债	2,979,658.22	0.07
29	128090	汽模转 2	2,930,160.96	0.06
30	128042	凯中转债	2,858,321.69	0.06
31	127051	博杰转债	2,845,625.16	0.06
32	113640	苏利转债	2,719,390.85	0.06
33	123050	聚飞转债	2,557,131.13	0.06
34	123130	设研转债	2,506,206.05	0.06
35	113532	海环转债	2,473,967.99	0.05
36	128121	宏川转债	2,437,964.38	0.05
37	113060	浙 22 转债	2,415,962.19	0.05
38	113577	春秋转债	2,393,637.85	0.05
39	123100	朗科转债	2,277,864.09	0.05
40	128144	利民转债	2,269,506.85	0.05
41	127039	北港转债	2,192,749.58	0.05
42	127061	美锦转债	2,137,540.22	0.05
43	123132	回盛转债	2,082,395.74	0.05

44	123054	思特转债	1,943,804.29	0.04
45	113593	沪工转债	1,861,257.78	0.04
46	113527	维格转债	1,839,902.57	0.04
47	113519	长久转债	1,638,411.48	0.04
48	128134	鸿路转债	1,634,035.73	0.04
49	113616	韦尔转债	1,557,505.81	0.03
50	127035	濮耐转债	1,529,544.83	0.03
51	123022	长信转债	1,461,396.81	0.03
52	127029	中钢转债	1,459,709.92	0.03
53	132014	18 中化 EB	1,134,970.96	0.03
54	128136	立讯转债	118,645.24	0.00
55	113567	君禾转债	26,363.39	0.00
56	128127	文科转债	639.50	0.00

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
204	20,499,816.64	4,181,962,593.83	100.00	-	-

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。



## 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日） 基金份额总额	210,008,000.00
本报告期期初基金份额总额	458,353,589.14
本报告期基金总申购份额	4,181,962,593.83
减：本报告期基金总赎回份额	458,353,589.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,181,962,593.83

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022 年 5 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 83,000.00 元，该审计机构已连续 4 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
------	----

受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-
<b>措施 2</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
<b>措施 3</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 26 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	3	1,857,492,938.58	100.00	1,174,402.36	100.00	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
中信证券股份有限公司	2,531,631,017.41	100.00	61,050,064,000.00	100.00	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实致安3个月定期债券第九个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年1月17日
2	关于嘉实致安3个月定期债券第十个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年4月19日
3	关于嘉实致安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金2022年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年4月19日
4	关于嘉实致安3个月定期债券基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月6日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月12日
6	关于嘉实致安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金降低管理费率并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年6月10日
7	关于嘉实致安3个月定期债券第十一个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2022年8月11日

		金电子披露网站	
8	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 9 月 14 日
9	嘉实基金管理有限公司住所变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 10 日
10	关于嘉实致安 3 个月定期债券第十二个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 24 日
11	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 21 日
12	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022-04-26 至 2022-12-31	-	3,719,545,285.48	-	3,719,545,285.48	88.94
	2	2022-01-20 至 2022-04-25	-	462,416,696.18	-	462,416,696.18	11.06
	3	2022-01-01 至 2022-04-25	448,043,128.39	-	448,043,128.39	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复文件；

- (2) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司, 咨询电话 400-600-8800, 或发 E-mail: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日