

# 国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:国元证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月31日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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。

本报告期自2022年1月1日起至2022年12月31日止

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
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	50
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	50

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	51
§9 基金份额持有人信息.....	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§10 开放式基金份额变动.....	53
§11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
11.4 基金投资策略的改变.....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件.....	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§13 备查文件目录.....	58
13.1 备查文件目录.....	58
13.2 存放地点.....	58
13.3 查阅方式.....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划
基金简称	国元元赢四个月定开债
基金主代码	970070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月28日
基金管理人	国元证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	736,680,170.93份
基金合同存续期	3年

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求资产安全性的基础上，力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。
投资策略	<p>一、本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本集合计划债券资产的投资比例不受上述比例限制。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%。开放期内，本集合计划持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> <p>二、本集合计划的投资策略包括类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富(1-3年)指数（代码：CBA00121.CS）收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划，

	高于货币市场基金、货币型集合计划。
--	-------------------

## 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	国元证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张社平
	联系电话	0551-62207188
	电子邮箱	95578@gyzq.com.cn
客户服务电话	95578/4008888777	95555
传真	0551-62696501	0755-83195201
注册地址	安徽省合肥市梅山路18号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	230001	518040
法定代表人	沈和付	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gyzq.com.cn/">http://www.gyzq.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §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10月28日(基金合同生效日)-2021年12月31日
本期已实现收益	27,007,888.95	3,410,791.71
本期利润	15,371,085.45	4,698,704.16
加权平均基金份额本期利润	0.0217	0.0111
本期加权平均净值利润率	2.06%	1.08%
本期基金份额净值增长率	2.83%	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	36,080,429.09	14,199,357.79
期末可供分配基金份额利润	0.0490	0.0319
期末基金资产净值	772,760,600.02	461,201,086.82
期末基金份额净值	1.0490	1.0347
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率	3.95%	1.08%

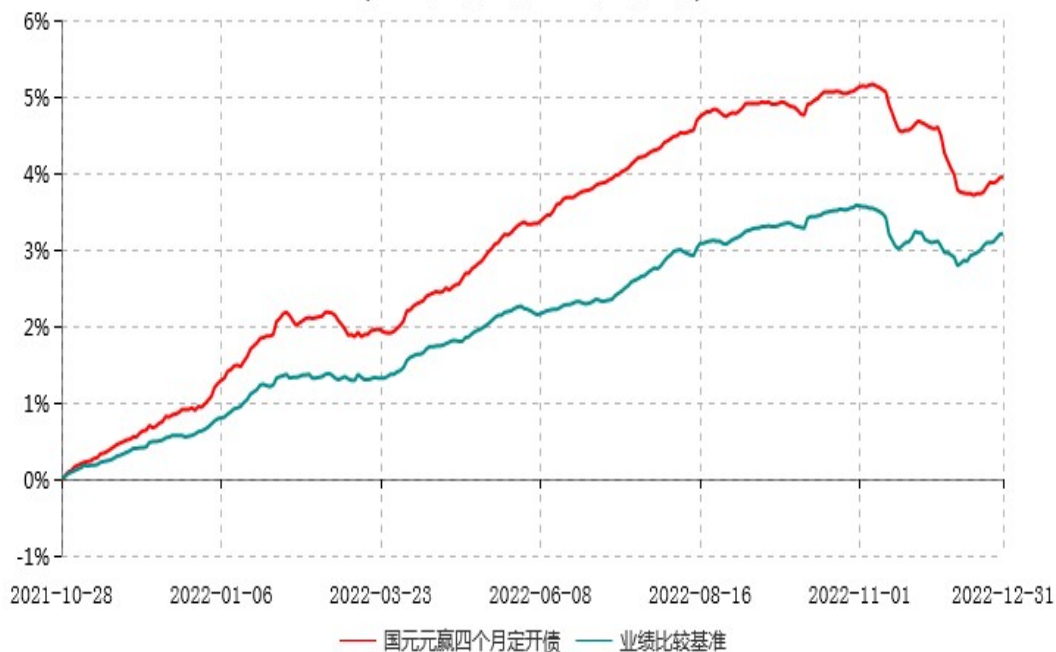
### 3.2 基金净值表现

#### 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

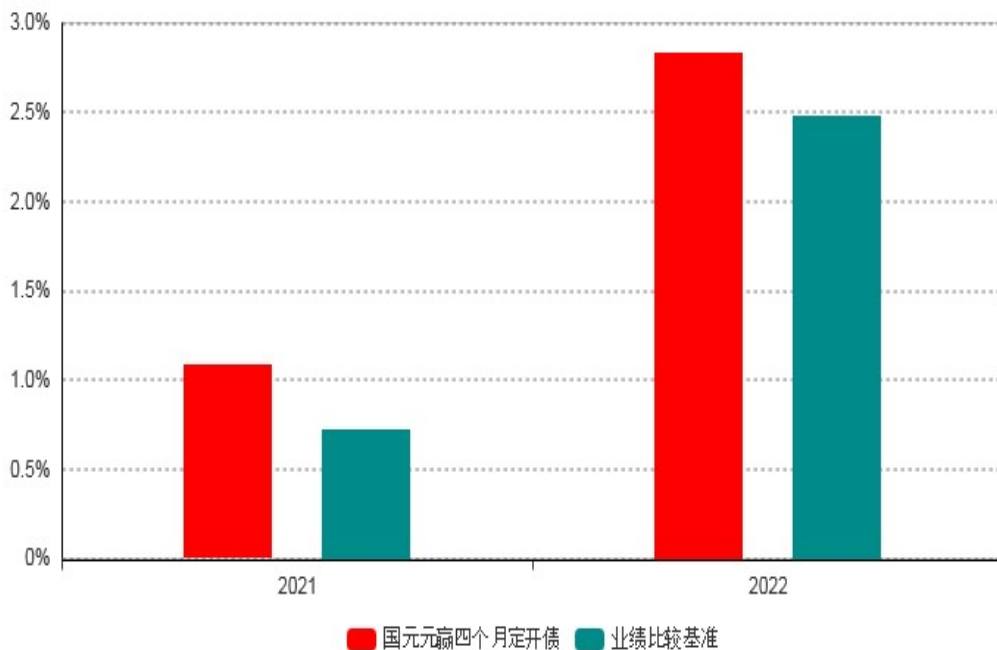
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.78%	0.06%	-0.01%	0.05%	-0.77%	0.01%
过去六个月	0.14%	0.05%	0.93%	0.04%	-0.79%	0.01%
过去一年	2.83%	0.04%	2.54%	0.03%	0.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.95%	0.04%	3.27%	0.03%	0.68%	0.01%

#### 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

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月28日-2022年12月31日)



### 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



### 3.3 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	0.150	7,101,169.41	616,852.77	7,718,022.18	-
合计	0.150	7,101,169.41	616,852.77	7,718,022.18	-

## §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

国元证券股份有限公司是经中国证监会证监公司字（2007）165号文核准，由北京化二股份有限公司定向回购股份、重大资产出售暨以新增股份吸收合并国元证券有限责任公司，于2007年10月25日登记注册，2007年10月30日在深交所成功上市，最新注册资本4,363,777,891元。2002年5月8日，中国证监会以证监机构字（2002）113号文核准国元证券有限责任公司从事受托投资管理业务资格，并自2004年2月1日起自动变更为客户资产管理业务资格。2005年12月12日，公司设立客户资产管理总部，致力于根据客户需求及风险偏好提供多样化的综合金融产品及资产管理服务。

截止2022年12月底，国元证券资产管理业务管理资管计划211只，管理资产净值为232.11亿元，其中集合资产管理计划管理资产净值93.89亿元。

#### 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		
夏真辉	大集合产品投资经理	2013-05-29	-	15	中国科学技术大学金融学硕士。2008年2月加入国元证券客户资产管理总部，历任研究员、投资助理，现任国元元赢四个月定开债、国元元赢六个月定开债投资经理。

李雅婷	大集合产品投资经理	2019-11-08	-	13	南开大学金融学硕士。曾任职于中国工商银行安徽省分行营业部，2012年8月加入国元证券资管总部，历任投资助理，现任国元元赢30天持有期债、国元元赢四个月定开债、国元元增利货币投资经理。
-----	-----------	------------	---	----	---

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

管理人声明：本报告期内，本管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及集合计划合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法（2020修订）》，建立了科学、合理的投资决策体系，加强了对交易环节的内部控制，并通过风控系统对投资、交易环节的控制来保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本管理人一贯公平对待旗下管理的所有组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法》的规定。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本集合计划于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次。

## 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

债市回顾：2022年，国内外债券市场走势大相径庭，受美联储强势加息影响，海外大部分经济体债券收益率大幅上行，而国内债市在“弱现实，强预期”的反复博弈中震荡下行。央行以我为主的稳健货币政策，使得资金面一度极为宽松，10年国债一度触及疫情以来低点，但11月在防疫放松、地产刺激、理财赎回、资金价格走高等多重利空的共同作用下，债券市场出现恐慌性下跌，大部分债券收益率相较2021年末均有所上行，10年国债全年上行5.99BP至2.8353%。

转债市场回顾：2022年可转债市场在经济基本面和政策预期的来回博弈中大幅震荡，中证转债全年下跌10%。11月中下旬受债券市场大幅调整波及，为应对赎回，转债作为高流动性资产也被同步卖出，部分转债债底保护优势凸显。

组合操作：我们严格遵照产品合同的约定，顺应市场趋势，优化资产配置结构，提高组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢四个月定开债基金份额净值为1.0490元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.83%，同期业绩比较基准收益率为2.54%

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债市经过2022年11-12月的大幅调整，较为充分的释放了前期的恐高情绪，资产价格中枢得到修正，重新回到一个较为均衡健康的位置上，市场关注点回归基本面，自2022年12月末开始，各品种各期限收益率均有不同程度下行。

3月初召开的两会提出，2023年经济增长目标为5%，低于此前市场预期，表明了新一届领导班子对高质量增长的追求和务实的工作作风。后续，需密切关注经济修复节奏、通胀预期、国际地缘政治和美联储加息进程等因素的变化。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。

合规管理方面，面对新形势新挑战，公司紧跟最新法律法规要求，贯彻落实最新监管精神，通过合规审查、合规检查、合规咨询等多项措施，压实合规职责，提升内控质量，严格防范大集合业务可能出现的各类合规风险；以风险防范为导向实施差异化管理，对资管业务核心环节重点关注，加强合规检查，强化问题整改落实。同时，为提升员工合规意识，持续开展线上线下全方位、多角度的合规培训，如新员工合规培训、专项合规培训、法制专题宣传等，严把新员工入职的合规意识，并持续在员工执业过程中加强

传导各项法律法规和监管政策精神，将合规文化贯穿于公司和每位员工的业务开展环节。

风险管理方面，公司风险监管部立足职责定位，负责督促客户资产管理总部落实公司风险管理决策和风险管理制度，对投资及交易重点指标进行监控，对异常或违规行为进行调查和报告，确保大集合业务符合公司风险偏好。

稽核方面，公司稽核审计部将公司大集合业务纳入公司整体稽核范畴，对大集合业务风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价，对资产管理业务不定期开展常规稽核工作，通过实施询问、观察、检查、核对、分析性复核等必要的稽核程序，以监督、评价公司资产管理业务的经营业绩、内控制度的建立与执行、合规风控管理等情况。

此外，公司内控部门每年度定期组织开展公司层面内部控制评价工作和合规管理有效性评估工作，检查范围包括资产管理业务内部控制情况、产品设计、投资者保护、推广募集、投资运作、投资顾问、估值核算、信息披露和公平交易等内容，不断提高资管业务内部控制和合规管理水平，加强稽核监督力量。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本集合计划管理人于 2022 年 7 月 5 日发布公告，以 2022 年 6 月 29 日可分配利润为基准，每 10 份集合计划份额发放红利 0.15 元人民币。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本产品本报告期内未出现连续 20 个工作日集合计划份额持有人数低于 200、资产净值低于 5000 万元的情形。

## **§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**

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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	容诚审字[2023]230Z0392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	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了后附的国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称“元赢四个月定开债”）财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产变动表和相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了元赢四个月定开债2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变

	动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国元证券股份有限公司（以下简称“管理人”）及其管理的元赢四个月定开债，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	元赢四个月定开债管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括元赢四个月定开债管理人2022年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。元赢四个月定开债管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括元赢四个月定开债管理人2022年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息

	<p>存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。元赢四个月定开债管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括元赢四个月定开债管理人2022年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>元赢四个月定开债管理人管理层（以下简称“管理层”）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估元赢四个月定开债的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算元赢四个月定开债、终止运营或别无其他现实的选择。元赢四个月定开债管理人治理层负责监督元赢四个月定开债的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职</p>

	<p>业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价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>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对元赢四个月定开债的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元赢四个月定开债不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与元赢四个月定开债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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪玉寿、洪雁南、范少君
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26
审计报告日期	2023-03-31



## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

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	2,149,329.26	1,723,837.01
结算备付金		2,124,595.84	3,449,926.24
存出保证金		23,640.23	10,722.00
交易性金融资产	7.4.7.2	976,962,821.70	453,343,762.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		956,076,684.71	428,298,762.95
资产支持证券投资		20,886,136.99	25,045,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	43,830,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,000,000.00	4,187,459.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.4	312,500.00	10,039,299.41
资产总计		982,572,887.03	516,585,007.07
<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		-	-
卖出回购金融资产款		209,090,448.34	55,000,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		330,619.05	195,318.44
应付托管费		99,185.72	58,595.52
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		103,588.20	61,441.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	188,445.70	68,564.35
负债合计		209,812,287.01	55,383,920.25
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	736,680,170.93	445,732,460.88
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.7	36,080,429.09	15,468,625.94
净资产合计		772,760,600.02	461,201,086.82
负债和净资产总计		982,572,887.03	516,585,007.07

## 7.2 利润表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日(基 金合同生效日)至2 021年12月31日
一、营业总收入		21,635,286.85	5,444,498.46
1.利息收入		1,747,757.84	3,919,834.65
其中：存款利息收入	7.4.7.8	123,180.53	16,999.45
债券利息收入		-	3,269,149.35
资产支持证券利息收 入		-	314,332.91
买入返售金融资产收 入		1,624,577.31	319,352.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		31,520,464.06	236,751.36
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.9	30,624,138.01	236,757.17
资产支持证券投资收 益	7.4.7.10	896,326.05	-5.81
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
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)	7.4.7.11	-11,636,803.50	1,287,912.45
4.汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.12	3,868.45	-

减：二、营业总支出		6,264,201.40	745,794.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,711,986.35	387,686.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,113,595.96	116,653.91
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,104,783.45	200,741.95
其中：卖出回购金融资产支出		1,104,783.45	200,741.95
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		99,374.32	12,146.32
8. 其他费用	7.4.7.13	234,461.32	28,565.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,371,085.45	4,698,704.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,371,085.45	4,698,704.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,371,085.45	4,698,704.16

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01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）	445,732,460.88	-	15,468,625.94	461,201,086.82
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）	445,732,460.88	-	15,468,625.94	461,201,086.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	290,947,710.05	-	20,611,803.15	311,559,513.20
（一）、综合收益总额	-	-	15,371,085.45	15,371,085.45
（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）	290,947,710.05	-	12,958,739.88	303,906,449.93
其中：1.基金申购款	829,777,489.71	-	41,916,970.95	871,694,460.66
2.基金赎回款	-538,829,779.66	-	-28,958,231.07	-567,788,010.73
（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）	-	-	-7,718,022.18	-7,718,022.18
（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）	736,680,170.93	-	36,080,429.09	772,760,600.02
项目	上年度可比期间			

	2021年10月28日（基金合同生效日）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（基金净值）	-	-	-	-
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）	248,122,373.96	-	5,861,039.89	253,983,413.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	197,610,086.92	-	9,607,586.05	207,217,672.97
（一）、综合收益总额	-	-	4,698,704.16	4,698,704.16
（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）	197,610,086.92	-	4,908,881.89	202,518,968.81
其中：1.基金申购款	211,622,545.77	-	5,256,888.61	216,879,434.38
2.基金赎回款	-14,012,458.85	-	-348,006.72	-14,360,465.57
（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、本期期末净资产（基金净值）	445,732,460.88	-	15,468,625.94	461,201,086.82

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:

沈和付

司开铭

司开铭

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

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划(以下简称“元赢四个月定开债”)是由国元证券股份有限公司作为设立人和管理人,由招商银行股份有限公司作为托管人的集合资产管理计划。

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国元元赢2号债券分级集合资产管理计划变更而来。原集合计划为分级型限定性集合资产管理计划,是由国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)作为计划管理人,招商银行股份有限公司作为计划托管人的限定性集合资产管理计划。国元元赢2号债券分级集合资产管理计划自2013年5月16日起开始募集并于2013年5月23日结束募集,于2013年5月29日成立。中国证券业协会于2013年5月31日出具了备案确认函。

2020年7月15日,国元元赢2号债券分级集合资产管理计划变更为国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划,产品不再分级,仅有一类份额,每一份额共担风险、共享收益。

2021年10月28日,国元元赢四个月定开债券型集合资产管理计划变更为国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划,本集合计划自合同生效日起存续期不得超过3年,自合同生效日起3年后,按照中国证监会有关规定执行。变更后本集合计划为契约型开放式。

投资范围:本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许

集合计划投资的其他金融工具。本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转债转股和可交换债券换股所形成的股票，必须在转股后10个交易日内卖出。

业绩比较基准：中债新综合财富(1-3年)指数（代码：CBA00121.CS）收益率\*85%+一年期定期存款利率\*15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表系按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）编制，同时，对于具体会计核算和信息披露方面，也参考了《证券投资基金会计核算业务指引》、《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>》。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 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，真实、完整地反映了本集合计划2022年12月31日的财务状况以及 2022年1月1日至2022年12月31日的经营成果和集合计划净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划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

###### （1）金额资产的分类

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集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划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。



本集合计划目前以交易目的持有的债券投资、股票投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划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。本集合计划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。本集合计划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

金融资产和金融负债于本集合计划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，且本集合计划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；(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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收资金为对外发行的集合计划份额总额扣除分摊至其他综合收益和未分配利润部分后的余额。每份集合计划份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收资金变动分别于计划申购确认日及计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本集合计划转换所引起的转入本集合计划的实收资金增加和转出本集合计划的实收资金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损

益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

本集合计划对以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产按照实际利率法计算确定利息收入，并列报为“利息收入”。各类利息收入的具体确认方法如下：

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

债券投资、资产支持证券投资的利息收入按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下的相关税费后的净额在债券/证券持有期间计提确认。

应收款项的利息收入按实际利率法计算确定的金额在持有期间确认。

买入返售金融资产的利息收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法计提确认。

##### （2）投资收益

本集合计划持有的交易性金融资产期间取得的投资收益以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和衍生工具等实现的损益等确认为投资收益。各类投资收益的具体确认方法如下：

股票投资收益于持有期间按应得的现金股利扣除适用情况下的相关税费后的净额确认。出售股票时，按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券、资产支持证券的投资收益于持有期间按票面价值与票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认。出售时，于出售交易日按应收取的金额与其账面价值的差额确认投资收益，同时，将原计入公允价值变动损益的金额转出计入投资收益。

债券、资产支持证券投资收益于出售时，按应收取的金额/实际收到的金额与其账面价值（已扣除重新计算至出售日的预期信用损失）的差额确认。

##### （3）公允价值变动收益

本集合计划持有的交易性金融资产、交易性金融负债、衍生工具等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失确认为公允价值变动收益。

（4）其他收入在本集合计划履行了合同中的履约义务，客户取得商品或服务控制权时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 管理人报酬按照元赢四个月定开债说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。

(2) 集合计划托管费按照元赢四个月定开债说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。

(3) 卖出回购证券支出在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

(4) 利息支出在借款期内逐日计提，并按借款本金与适用的利率计提的金额入账。

(5) 发生的其他费用如果影响集合计划单位净值小数点后第五位的，采用待摊或预提的方法计入集合计划损益；发生的其他费用如果不影响集合计划单位净值小数点后第五位的，于发生时直接计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 元赢四个月定开债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集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，元赢四个月定开债默认的收益分配方式是现金分红；

若投资者选择现金红利自动转为集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日；

(2) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本集合计划每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 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3月31日分别发布了《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》（财会【2017】7号）、《企业会计准则第23号-金融资产转移》（财会【2017】8号）、《企业会计准则第24号-套期会计》（财会【2017】9号），于2017年5月2日发布了《企业会计准则第37号-金融工具列报》（财会【2017】14号）（上述准则以下统称“新金融工具准则”），同时根据财政部、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》，本集合计划的管理人于2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年6月1日印发了《资产管理产品相关会计处理规定》（财会【2022】14号），自2022年7月1日起施行。

于2022年1月1日之前的金融工具确认和计量与新金融工具准则要求不一致的，本集合计划按照新金融工具准则的规定，对金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整，将金融工具原账面价值和在新金融工具准则施行日（即2022年1月1日）的新账面价值之间的差额计入2022年1月1日的留存收益或其他综合收益。同时，本集合计划未对比较财务报表数据进行调整。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局于2016年12月21日发布的《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[2016]140号）规定：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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号），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，通知自2018年1月1日起施行。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。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税[2008]1号）规定：

（1）对证券投资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，股权的股息、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。

（2）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。

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

#### 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	2,149,329.26	1,723,837.01
等于：本金	2,148,166.02	1,723,837.01
加：应计利息	1,163.24	-
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	2,149,329.26	1,723,837.01

##### 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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	604,063,677.86	13,781,824.91	610,039,968.37	-7,805,534.40
	银行间市场	338,405,797.33	10,636,116.34	346,036,716.34	-3,005,197.33
	合计	942,469,475.19	24,417,941.25	956,076,684.71	-10,810,731.73
资产支持证券		20,000,000.00	918,136.99	20,886,136.99	-32,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		962,469,475.19	25,336,078.24	976,962,821.70	-10,842,731.73
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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	254,873,107.38	-	255,897,762.95	1,024,655.57
	银行间市场	172,556,833.80	-	172,401,000.00	-155,833.80
	合计	427,429,941.18	-	428,298,762.95	868,821.77
资产支持证券		25,119,750.00	-	25,045,000.00	-74,750.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		452,549,691.18	-	453,343,762.95	794,071.77

### 7.4.7.3 买入返售金融资产

#### 7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	43,830,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	43,830,000.00	-

#### 7.4.7.4 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	312,500.00	10,039,299.41
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	312,500.00	10,039,299.41

#### 7.4.7.5 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	-	-
应付交易费用	9,445.70	3,205.04
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	9,445.70	3,205.04
应付利息	-	15,359.31
预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	-



预提费用-账户维护费	9,000.00	-
合计	188,445.70	68,564.35

#### 7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	445,732,460.88	445,732,460.88
本期申购	829,777,489.71	829,777,489.71
本期赎回（以“-”号填列）	-538,829,779.66	-538,829,779.66
本期末	736,680,170.93	736,680,170.93

#### 7.4.7.7 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	14,199,357.79	1,269,268.15	15,468,625.94
本期利润	27,007,888.95	-11,636,803.50	15,371,085.45
本期基金份额交易产生的变动数	8,308,980.20	4,649,759.68	12,958,739.88
其中：基金申购款	35,336,895.04	6,580,075.91	41,916,970.95
基金赎回款	-27,027,914.84	-1,930,316.23	-28,958,231.07
本期已分配利润	-7,718,022.18	-	-7,718,022.18
本期末	41,798,204.76	-5,717,775.67	36,080,429.09

#### 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	83,103.98	10,375.53
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	39,744.71	6,597.83
其他	331.84	26.09
合计	123,180.53	16,999.45

### 7.4.7.9 债券投资收益

#### 7.4.7.9.1 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2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	30,149,140.62	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	474,997.39	236,757.17
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	30,624,138.01	236,757.17

#### 7.4.7.9.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效日） 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	1,736,948,487.39	90,829,923.53
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	1,693,524,709.24	88,188,530.06
减：应计利息总额	42,926,560.57	2,404,636.30

减：交易费用	22,220.19	-
买卖债券差价收入	474,997.39	236,757.17

#### 7.4.7.10 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.10.1 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01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
资产支持证券投资收益—— 利息收入	1,016,076.05	-
资产支持证券投资收益—— 买卖资产支持证券差价收入	-119,750.00	-5.81
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	896,326.05	-5.81

##### 7.4.7.10.2 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01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	25,462,328.77	13,159,314.00
减：卖出资产支持证券成本 总额	25,119,750.00	13,000,500.00
减：应计利息总额	462,328.77	158,819.81
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-119,750.00	-5.81

##### 7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-11,636,803.50	1,287,912.45
——股票投资	-	-
——债券投资	-11,679,553.50	1,362,662.45
——资产支持证券投资	42,750.00	-74,750.00
——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	-11,636,803.50	1,287,912.45

#### 7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
基金赎回费收入	3,676.67	-
其他	191.78	-
合计	3,868.45	-

#### 7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年10月28日(基金合同生 效日)至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	15,035.01

信息披露费	120,000.00	-
TA服务费	9,461.32	10,262.32
其他费用_账户维护费_中债登	31,500.00	-
其他费用_账户维护费_上清所	13,500.00	-
交易费用	-	3,268.20
合计	234,461.32	28,565.53

#### 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

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国元证券股份有限公司	集合计划的管理人和销售机构
招商银行股份有限公司	集合计划的托管人
安徽国元金融控股集团有限责任公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
安徽国元信托有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
建安投资控股集团有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东

注：因管理人关联方过多，此处仅披露管理人、托管人及持有管理人5%以上股份的股东。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国元证券 股份有限 公司	770,782,145.83	100.00%	138,828,152.98	100.00%

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
国元证券 股份有限 公司	5,821,385,000.00	100.00%	1,347,748,000.00	100.00%

**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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日 至2022年12月31 日	2021年10月28日（基金合同 生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,711,986.35	387,686.59
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,113,595.96	116,653.91

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年10月28日（基金 合同生效日）至2021年1 2月31日
基金合同生效日（2021年10月28日）持有的 基金份额	4,014,411.53	4,014,411.53
报告期初持有的基金份额	4,014,411.53	4,014,411.53
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	4,014,411.53	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	4,014,411.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比 例	0.00%	0.90%

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

本集合计划本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年10月28日（基金合同生效日） 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
招商银行股份有限公司	2,149,329.26	83,103.98	1,723,837.01	10,375.53

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

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	2022-07-07	2022-07-07	0.150	7,101,169.41	616,852.77	7,718,022.18	-
合计			0.150	7,101,169.41	616,852.77	7,718,022.18	-

#### 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



本集合计划本报告期末未持有新发/增发证券等流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至2022年12月31日，本集合计划从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为0。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至2022年12月31日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为209,000,000.00元，在2023年1月3日到期。该类交易要求集合计划转入质押库的债券，按照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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

集合计划的管理人建立与实施内部控制，遵循下列原则：（一）全面性原则。内部控制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司的所有业务、部门和人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节和过程，确保不存在内部控制的重大空白或漏洞。

（二）重要性原则。内部控制应在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域。

（三）制衡性原则。内部控制应在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。（四）适应性原则。内部控制应符合国家有关法律法规和中国证监会的有关规定，与公司经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，应权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制，并随着情况的变化及时加以调整。（五）独立性原则：承担内部控制监督检查职能的部门应当独立于公司其他部门；业务部门中后台岗位独立于业务操作岗位。

集合计划的管理人风险管理组织架构由四个层次构成，分别为：公司董事会及下设的风险管理委员会；经营管理层及下设的风控与合规委员会等非常设机构；包括风险监管部、内核办公室、合规法务部、审计监察部、信息技术总部、资金计划部、董事会办公室、运营总部等在内的履行风险管理相关职能的部门；各业务部门及内设的风险管理岗位。

集合计划的管理人董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，履行以下职责：（一）推进风险文化建设；（二）审议批准公司全面风险管理的基本制度；（三）审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；（四）审议

公司定期风险评估报告；（五）任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；（六）建立与首席风险官的直接沟通机制；（七）公司章程规定的其他风险管理职责。董事会设立风险管理委员会，按照公司章程和董事会《风险管理委员会工作细则》的规定履行职责和义务。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。

集合计划的管理人监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

集合计划的管理人经营管理层对全面风险管理承担主要责任，履行以下职责：（一）制定风险管理制度，并适时调整；（二）建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；（三）制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实；对其进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；（四）定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；（五）建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；（六）建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制；（七）根据法律法规的要求和董事会授权的其他风险管理职责。

集合计划的管理人设立风控与合规委员会、信息技术治理委员会、财富管理业务委员会、固定收益业务领导小组、权益投资业务领导小组、资产管理业务领导小组、投行类业务内核领导小组、场外业务领导小组、信用业务审核小组等非常设机构，根据公司授权履行在各自的业务管理、决策范围内的风险管控职责和义务。

集合计划的管理人相关风险管理职能部门在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供全流程（尤其是事前与事中）的风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

#### 7.4.13.2 信用风险

债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本集合计划面临信用风险。

集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在非集中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。

本集合计划对不同信用等级的信用债投资比例有严格限制，债项评级AA信用债的投资比例不超过集合计划信用债资产的20%，债项评级AAA信用债的投资比例不低于集合计划信用债资产的50%，有效防范了信用风险的发生。

#### 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	61,450,205.48	-
合计	61,450,205.48	-

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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	41,995,960.18	-
合计	41,995,960.18	-

#### 7.4.13.2.3 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	525,670,020.93	279,961,878.80
AAA以下	285,413,046.07	148,336,884.15
未评级	41,547,452.05	-
合计	852,630,519.05	428,298,762.95

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	-	-

AAA以下	20,886,136.99	25,045,000.00
未评级	-	-
合计	20,886,136.99	25,045,000.00

#### 7.4.13.3 流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售债券。

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具等，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合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1 2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	2,149,329.26	-	-	-	2,149,329.26

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告

结算备付金	2,124,595.84	-	-	-	2,124,595.84
存出保证金	23,640.23	-	-	-	23,640.23
交易性金融资产	455,093,781.72	475,995,196.11	45,873,843.87	-	976,962,821.70
应收清算款	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
其他资产	-	-	-	312,500.00	312,500.00
资产总计	459,391,347.05	475,995,196.11	45,873,843.87	1,312,500.00	982,572,887.03
负债					
卖出回购金融资产款	209,090,448.34	-	-	-	209,090,448.34
应付管理人报酬	-	-	-	330,619.05	330,619.05
应付托管费	-	-	-	99,185.72	99,185.72
应交税费	-	-	-	103,588.20	103,588.20
其他负债	-	-	-	188,445.70	188,445.70
负债总计	209,090,448.34	-	-	721,838.67	209,812,287.01
利率敏感度缺口	250,300,898.71	475,995,196.11	45,873,843.87	590,661.33	772,760,600.02
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	1,723,837.01	-	-	-	1,723,837.01
结算备付金	3,449,926.24	-	-	-	3,449,926.24
存出保证金	10,722.00	-	-	-	10,722.00
交易性金融资	148,473,021.68	176,452,000.00	128,418,741.27	-	453,343,762.95

产					
买入返售金融资产	43,830,000.00	-	-	-	43,830,000.00
应收证券清算款	-	-	-	4,187,459.46	4,187,459.46
应收利息	-	-	-	10,039,299.41	10,039,299.41
资产总计	197,487,506.93	176,452,000.00	128,418,741.27	14,226,758.87	516,585,007.07
负债					
卖出回购金融资产款	55,000,000.00	-	-	-	55,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	195,318.44	195,318.44
应付托管费	-	-	-	58,595.52	58,595.52
应付交易费用	-	-	-	3,205.04	3,205.04
应交税费	-	-	-	61,441.94	61,441.94
应付利息	-	-	-	15,359.31	15,359.31
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	55,000,000.00	-	-	383,920.25	55,383,920.25
利率敏感度缺口	142,487,506.93	176,452,000.00	128,418,741.27	13,842,838.62	461,201,086.82

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本集合计划资产净值将不会发生重大变动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

##### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	956,076,684.71	123.72	428,298,762.95	92.87
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	20,886,136.99	2.70	25,045,000.00	5.43
合计	976,962,821.70	126.43	453,343,762.95	98.30

#### 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

截至2022年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为38,849,427.54元，第二层次的余额为938,113,394.16元，无

属于第三层次的余额。（截至2021年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为428298762.95元，属于第二层次的余额为25045000.00元，无属于第三层次的余额。）

#### 7.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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应收款项和其他金融负债，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

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	976,962,821.70	99.43
	其中：债券	956,076,684.71	97.30
	资产支持证券	20,886,136.99	2.13
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	4,273,925.10	0.43
8	其他各项资产	1,336,140.23	0.14
9	合计	982,572,887.03	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

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

无。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,392,589.04	1.99
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	610,551,238.87	79.01
5	企业短期融资券	61,450,205.48	7.95
6	中期票据	143,389,216.45	18.56
7	可转债(可交换债)	83,297,474.69	10.78
8	同业存单	41,995,960.18	5.43

9	其他	-	-
10	合计	956,076,684.71	123.72

### 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	127849	18宏鼎债	700,000	43,861,328.77	5.68
2	132015	18中油EB	402,000	42,624,500.55	5.52
3	112110514	21兴业银行C D514	420,000	41,995,960.18	5.43
4	102100365	21扬州化工M TN002	400,000	41,661,841.10	5.39
5	102100914	21临汾投资M TN002	400,000	41,547,452.05	5.38

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	183626	汴京01优	200,000	20,886,136.99	2.70

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 根据管理人现有舆情系统监控，本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行2022年3月受银保监会处罚，2022年9月受银保监会处罚。

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

除上述主体外，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 本集合计划本报告期末未持有股票资产。

### 8.12.3 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	23,640.23
2	应收清算款	1,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	312,500.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,336,140.23

### 8.12.4 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	132015	18中油EB	42,624,500.55	5.52
2	113052	XD兴业转	5,288,296.00	0.68
3	113056	重银转债	4,374,988.16	0.57
4	123048	应急转债	2,483,141.42	0.32
5	113013	国君转债	2,387,169.43	0.31
6	110073	国投转债	2,258,460.14	0.29

7	110059	浦发转债	1,783,707.53	0.23
8	113042	上银转债	1,732,457.05	0.22
9	113044	大秦转债	1,537,330.41	0.20
10	127049	希望转2	1,443,895.02	0.19
11	127045	牧原转债	1,399,289.39	0.18
12	127006	敖东转债	1,297,833.15	0.17
13	127012	招路转债	1,288,053.56	0.17
14	113011	XD光大转	1,203,118.97	0.16
15	113059	福莱转债	1,062,887.50	0.14
16	113050	XD南银转	1,027,767.81	0.13
17	127033	中装转2	991,855.48	0.13
18	110057	现代转债	860,702.55	0.11
19	123107	温氏转债	765,171.85	0.10
20	127025	冀东转债	756,691.61	0.10
21	128132	交建转债	692,418.29	0.09
22	113037	N紫银转	655,346.92	0.08
23	123077	汉得转债	598,984.25	0.08
24	113043	财通转债	486,477.74	0.06
25	110067	华安转债	377,492.26	0.05
26	127017	万青转债	334,628.22	0.04
27	113623	凤21转债	328,881.37	0.04
28	113616	韦尔转债	323,809.73	0.04
29	132022	20广版EB	315,202.19	0.04
30	123101	拓斯转债	222,213.70	0.03
31	113033	利群转债	215,653.85	0.03
32	113639	华正转债	205,414.79	0.03
33	123128	首华转债	201,087.05	0.03
34	113584	家悦转债	147,124.75	0.02
35	113588	润达转债	117,077.59	0.02

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
3,340	220,562.93	208,171,755.32	28.26%	528,508,415.61	71.74%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	8,973,248.98	1.22%

### 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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年10月28日)基金份额总额	248,122,373.96
本报告期期初基金份额总额	445,732,460.88
本报告期基金总申购份额	829,777,489.71
减：本报告期基金总赎回份额	538,829,779.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	736,680,170.93

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开集合计划份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，管理人自2022年2月24日起，沈和付担任国元证券股份有限公司总裁职务，陈新不再担任国元证券股份有限公司总裁职务，于强先生不再担任国元证券股份有限公司副总裁职务。自2022年8月31日起，廖圣柱不再担任国元证券股份有限公司副总裁职务。自2022年9月8日起，李研科不再担任国元证券股份有限公司合规总监职务，俞仕新代任合规总监职务。自2022年12月16日起，俞仕新不再担任国元证券股份有限公司董事长职务，陈东杰不再担任国元证券股份有限公司副总裁职务，沈和付担任国元证券股份有限公司董事长职务、代任总裁职务、代任合规总监职务，陈宁担任国元证券股份有限公司副总裁职务。

自2022年07月15日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本期内，无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期集合计划投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本集合计划的审计事务所为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期应支付给容诚会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币70,000.00元。

### 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

本报告期内，集合计划管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 11.6.2 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，集合计划托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	
国元证券	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国元证券	770,782,145.83	100.00%	5,821,385,000.00	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	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2021年第4季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
2	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2021年第四季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-24
3	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
4	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2021年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
5	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2021年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-31

6	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年第1季度报告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
7	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年第1季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
8	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-01
9	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划分红公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-05
10	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年第2季度报告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-21
11	关于国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划延长开放期的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-21
12	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年中期报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-31
13	国元证券股份有限公司旗下基金2022年中期报告提示性公告	上海证券报	2022-08-31
14	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年第3季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-26
15	国元证券股份有限公司旗下基金2022年第3季度报告提示性公告	上海证券报	2022-10-26
16	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-28



17	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划产品资料概要更新	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-28
18	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-10
19	关于国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划增加华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-10
20	关于国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-21
21	关于国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划延长开放期的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-30

## §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	20220722-20221231	0.00	285,278,623.05	95,092,874.00	190,185,749.05	25.82%
产品特有风险							
-							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国元证券股份有限公司国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

### 13.3 查阅方式

上述文件可在国元证券网站上查阅，或者在营业时间内到国元证券查阅。  
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人国元证券股份有限公司。  
客户服务中心电话：95578  
网址：www.gyzq.com.cn

国元证券股份有限公司  
二〇二三年三月三十一日