

信诚货币市场证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2023 年 03 月 30 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

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	19
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	19
§ 6	审计报告	19
6.1	审计报告基本信息	19
6.2	审计报告的基本内容	19
§ 7	年度财务报表	21
7.1	资产负债表	21
7.2	利润表	22
7.3	净资产（基金净值）变动表	24
7.4	报表附注	25
§ 8	投资组合报告	57
8.1	期末基金资产组合情况	57
8.2	债券回购融资情况	58
8.3	基金投资组合平均剩余期限	58
8.4	报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	59

8.6	期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	59
8.7	“影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	60
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	60
8.9	投资组合报告附注	60
§ 9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 10	开放式基金份额变动	63
§ 11	重大事件揭示	63
11.1	基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4	基金投资策略的改变	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	68
11.9	其他重大事件	68
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13	备查文件目录	70
13.1	备查文件目录	70
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚货币市场证券投资基金		
基金简称	信诚货币		
基金主代码	550010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 03 月 23 日		
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,855,323,788.80 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
下属分级基金的交易代码	550010	550011	004849
报告期末下属分级基金的份额总额	145,378,708.40 份	4,612,551,102.63 份	1,097,393,977.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对货币市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	021-60637111
传真	021-50120895	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪	北京市西城区闹市口大街 1 号

	大道 8 号上海国金中心汇丰银行 大楼 9 层	院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	涂一锴	田国立

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼八层
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 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		
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
本期已实现收益	2,584,812.05	112,885,479.79	568,225.87	3,943,160.99	66,208,407.22	517,250.59	2,489,381.21	71,358,944.63	10,647.93
本期利润	2,584,812.05	112,885,479.79	568,225.87	3,943,160.99	66,208,407.22	517,250.59	2,489,381.21	71,358,944.63	10,647.93
本期净值收益率	1.6908%	1.9351%	1.6917%	1.9756%	2.2207%	1.9744%	1.8288%	2.0735%	1.8265%
3.1.2 期末数据和指	2022 年末			2021 年末			2020 年末		
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E

标						E			E
期末基金资产净值	145,378,708.40	4,612,551,102.63	1,097,393,977.77	124,869,923.78	6,102,757,427.80	76,120.20	105,402,097.96	5,698,345,827.18	7,245.86
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末			2021 年末			2020 年末		
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
累计净值收益率	43.1688%	47.2777%	13.2616%	40.7883%	44.4818%	11.3775%	38.0608%	41.3429%	9.2210%

注：1、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。

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

3、本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.3787%	0.0019%	0.0882%	0.0000%	0.2905%	0.0019%
过去六个月	0.7461%	0.0018%	0.1764%	0.0000%	0.5697%	0.0018%
过去一年	1.6908%	0.0024%	0.3500%	0.0000%	1.3408%	0.0024%
过去三年	5.5963%	0.0020%	1.0510%	0.0000%	4.5453%	0.0020%
过去五年	11.5873%	0.0031%	1.7510%	0.0000%	9.8363%	0.0031%
自基金合同生效起至今	43.1688%	0.0055%	4.3073%	0.0001%	38.8615%	0.0054%

信诚货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4395%	0.0019%	0.0882%	0.0000%	0.3513%	0.0019%
过去六个月	0.8683%	0.0018%	0.1764%	0.0000%	0.6919%	0.0018%
过去一年	1.9351%	0.0024%	0.3500%	0.0000%	1.5851%	0.0024%
过去三年	6.3594%	0.0020%	1.0510%	0.0000%	5.3084%	0.0020%

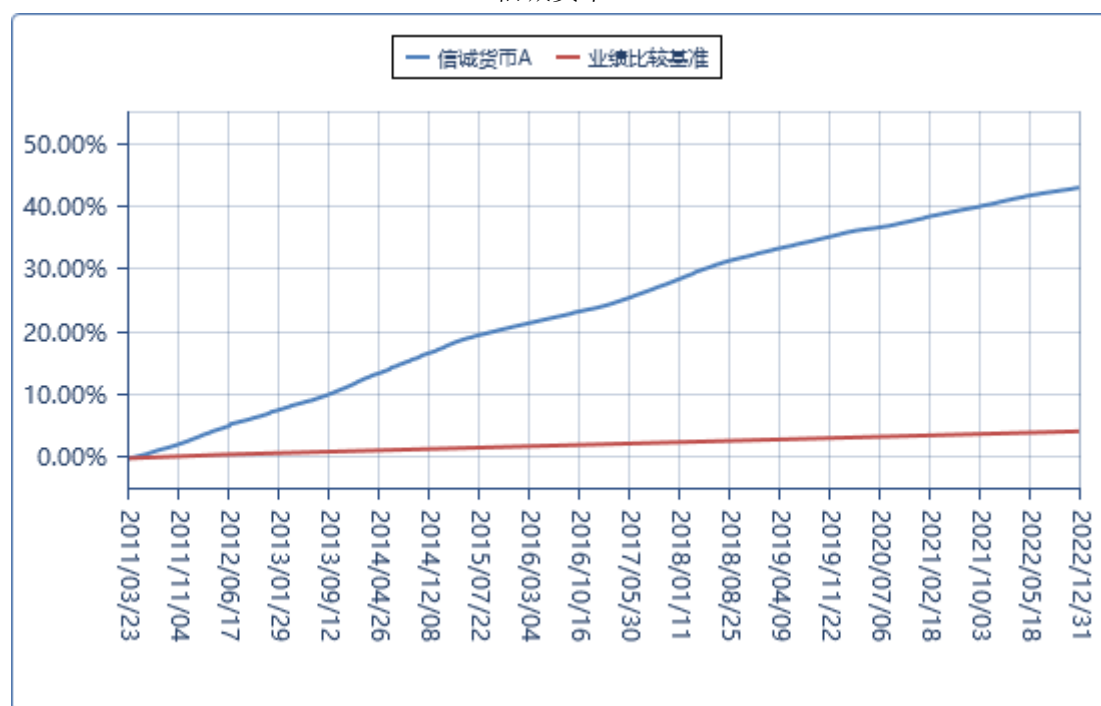
过去五年	12.9357%	0.0031%	1.7510%	0.0000%	11.1847%	0.0031%
自基金合同生效起至今	47.2777%	0.0055%	4.3073%	0.0001%	42.9704%	0.0054%

信诚货币 E

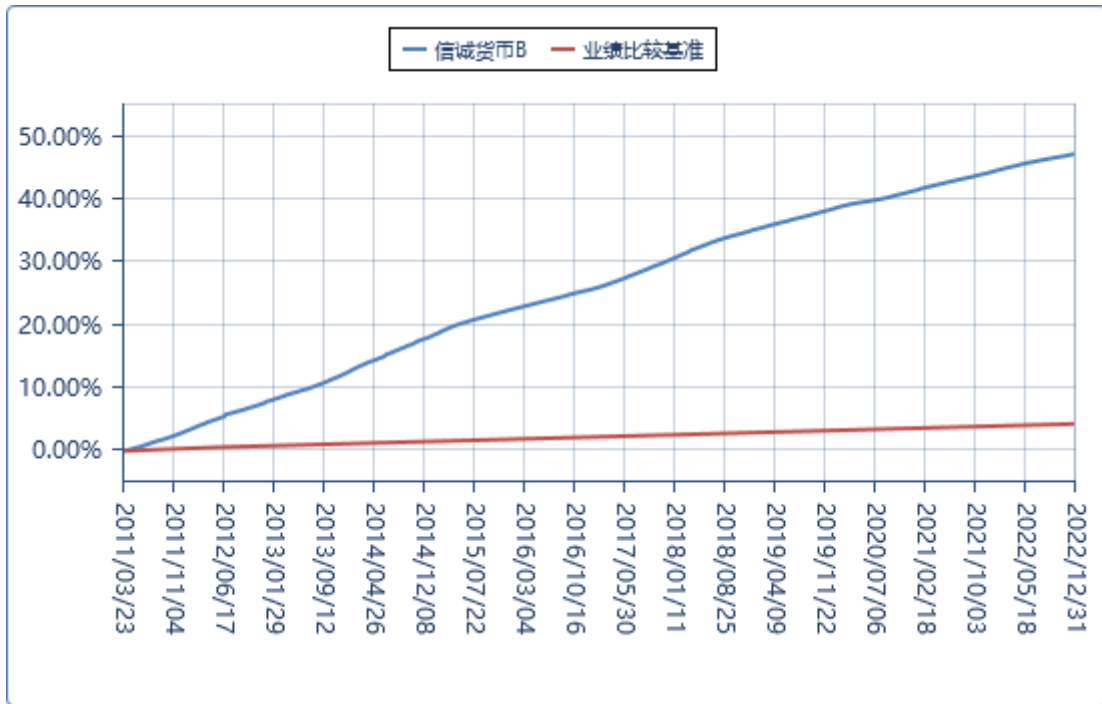
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	0.3811%	0.0019%	0.0882%	0.0000%	0.2929%	0.0019%
过去六个月	0.7485%	0.0018%	0.1764%	0.0000%	0.5721%	0.0018%
过去一年	1.6917%	0.0024%	0.3500%	0.0000%	1.3417%	0.0024%
过去三年	5.5935%	0.0020%	1.0510%	0.0000%	4.5425%	0.0020%
过去五年	11.5442%	0.0030%	1.7510%	0.0000%	9.7932%	0.0030%
自基金合同生效起至今	13.2616%	0.0032%	1.8977%	0.0000%	11.3639%	0.0032%

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

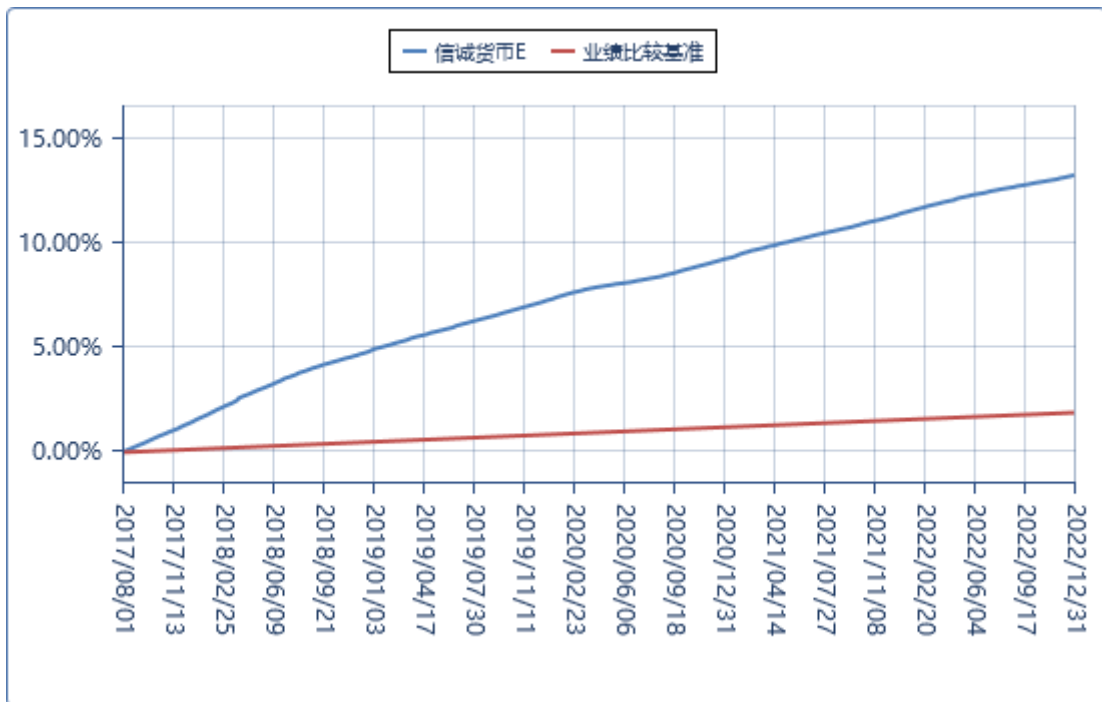
信诚货币 A



信诚货币 B

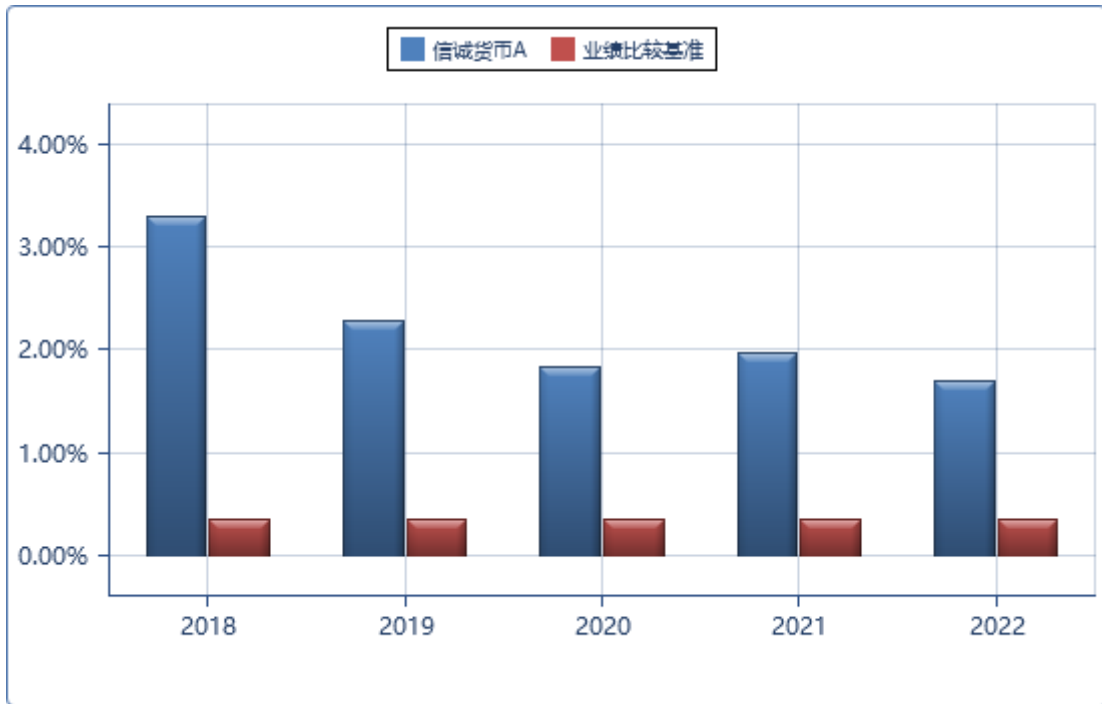


信诚货币 E

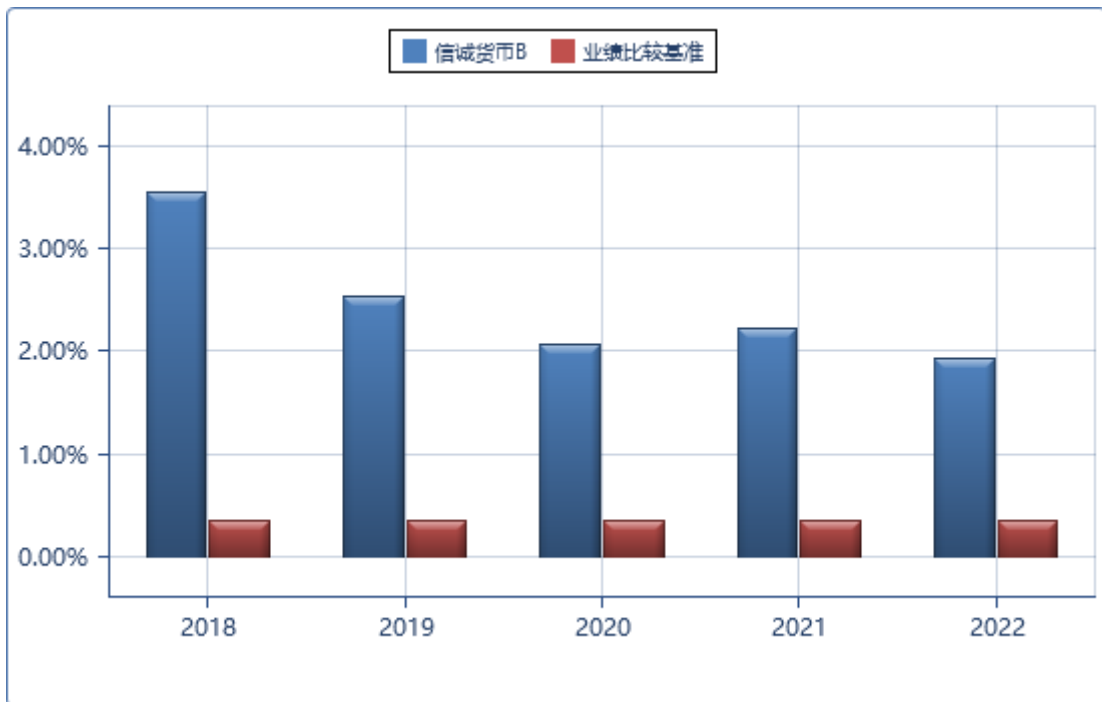


3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

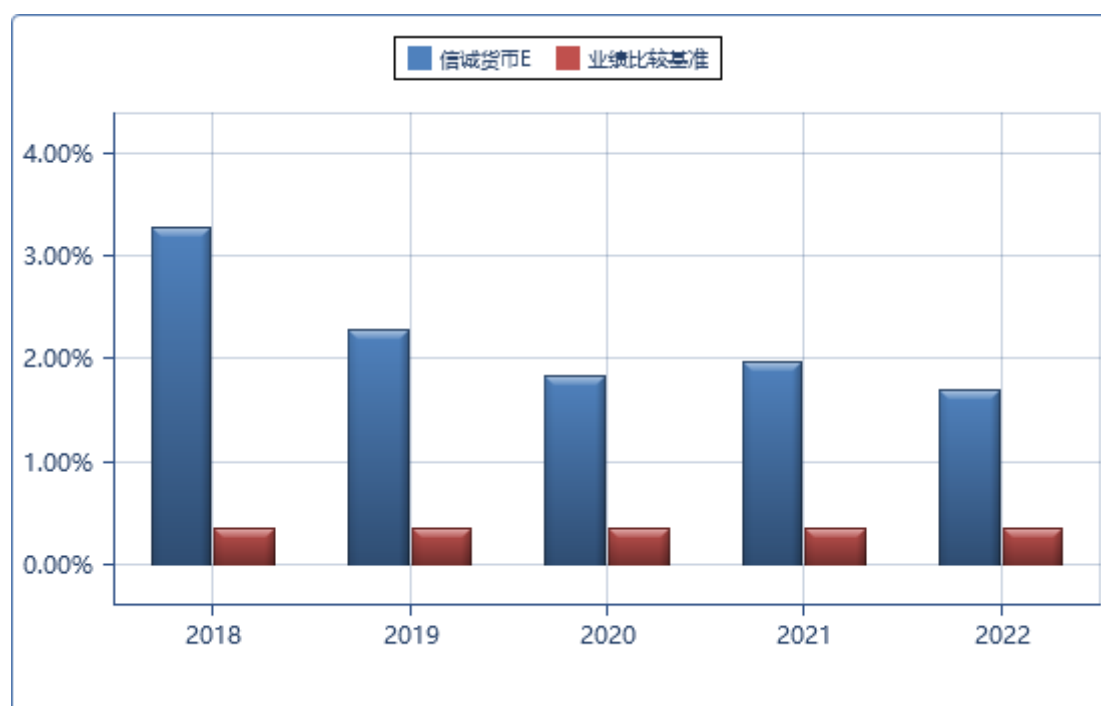
信诚货币 A



信诚货币 B



信诚货币 E



3.3 过去三年基金的利润分配情况

信诚货币 A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2022 年	2,584,812.05	-	-	2,584,812.05	-
2021 年	3,943,160.99	-	-	3,943,160.99	-
2020 年	2,489,381.21	-	-	2,489,381.21	-
合计	9,017,354.25	-	-	9,017,354.25	-

信诚货币 B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2022 年	112,885,479.79	-	-	112,885,479.79	-
2021 年	66,208,407.22	-	-	66,208,407.22	-
2020 年	71,358,944.63	-	-	71,358,944.63	-
合计	250,452,831.64	-	-	250,452,831.64	-

信诚货币 E

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2022 年	568,225.87	-	-	568,225.87	-
2021 年	517,250.59	-	-	517,250.59	-
2020 年	10,647.93	-	-	10,647.93	-
合计	1,096,124.39	-	-	1,096,124.39	-

§ 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

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中基金为 75 只，分别为：信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型

证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
席行懿	固定收益部副总监、基金经理	2016 年 03 月 18 日	-	13	席行懿女士，工商管理硕士。曾任职于德勤华永会计师事务所，担任高级审计师。2009 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任基金会计经理、交易员、固定收益研究员。现任固定收益部副总监，信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证

					券投资基金的基金经理。
臧淑玲	基金经理	2022 年 09 月 05 日	-	10	臧淑玲女士,工商管理硕士。曾担任毕马威华振会计师事务所审计助理经理。2012 年 1 月加入中信保诚基金管理有限公司,历任财务经理、高级交易员、研究员。现任信诚智惠金货币市场基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚货币市场证券投资基金的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚货币市场证券投资基金基金合同》、《信诚货币市场证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生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

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(以下简称公平交易制度)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、资产管理计划),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与

相对独立；同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等, 确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程；借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库，规范二级市场、集中竞价市场的操作，建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括：公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，确保一般情况下不同投资合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；同时原则上禁止同日反向交易，如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括：定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析，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合同向交易的交易价差进行分析，对反向交易等进行价差分析。同时，合规及内部审计人员会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅，签字确认，如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资合同同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好, 未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品之间未出现参与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 5% 的交易。未发生

主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每周对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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，全球能源和粮食供应紧张，加上发达国家的刺激政策的后遗症和全球供给瓶颈等因素，使得海外整体处在高通胀环境中，美联储加息缩表，流动性收紧，全球衰退预期上升，主要发达经济体在稳物价和稳增长之间艰难权衡，外需疲弱导致全年出口增速下行，同时，国内经济循环受阻，需求端消费、地产疲软，居民资产负债表修复缓慢，稳增长政策推动基建和制造业投资表现较好。国内稳地产和稳增长措施频繁出台，货币政策维持宽松，政策发力对社融有脉冲式的影响，全年 GDP 增速 3%，社融增速 9.6%。通胀整体温和，CPI 前低后高，全年均值 2%，PPI 整体呈回落趋势，全年均值 4.2%。

货币政策全年维持宽松，资金利率中枢明显低于政策利率。2022 年 4 月、12 月两次全面降准各 0.25 个百分点，1 月、8 月两次全面降息各 10bp，1 月、5 月、8 月下调 LPR 报价。央行在总量宽松的同时，加强结构性货币政策工具的使用，引导重点领域的信贷投放，降低企业融资成本。

从债券市场看，2022 年国内经济处于下行周期，流动性整体宽松，债券市场反复博弈宽信用预期和弱复苏现实，前三季度弱经济与宽货币组合促使利率震荡下行，四季度金融支持地产，叠加流动性边际收敛，利率明显调整，10Y 国债全年在 2.55%-2.95%之间震荡。信用债收益率前三季度有所下行，四季度因经济基本面好转预期和理财赎回等影响上行较多，信用利差随之走扩。

组合配置上，组合主要以流动性管理为主，整体配置较为中性，2022 年 1 月、2 月受降准降息影响，短端利率持续维持低位，随着季末银行存款缺口较大，存单利率高企，组合拉长剩余期限至 60 天，并辅以一定杠杆以增加收益弹性；进入二季度，经济下行压力有所增大，组合通过增配半年内利率债和高等级信用债迅速拉长剩余期限提高组合静态收益率，5 月中下旬，PMI 等领先数据反弹，组合转为中性配置，至 6 月底剩余期限回落至 50 天附近；三季度组合主要采取哑铃型配置，短期交易所回购搭配 3M-6M 左右的存款存单配置，组合剩余期限维持在 40-60 天之间。同时，绝对收益率水平较低，组合择机用利率债或者大行存单做少量交易性策略，以增加组合收益弹性；四季度组合主要采取纺锤形配置，11 月和 12 月存单调整幅度较为剧烈，1 年期国股存单利率一度上行至政策利率上方，组合加大了剩余期限 3-6 个月左右资产的配置力度，拉长了组合剩余期限。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚货币 A 份额净值收益率为 1.6908%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%；信诚货币 B 份额净值收益率为 1.9351%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%；信诚货币 E 份额净值收益率为 1.6917%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，海外政策收缩面临拐点，全球经济或进入下行周期。预计美联储加息周期有望结束，前期货币紧缩的滞后和累积效应逐渐显现，美国经济可能轻度衰退。国内方面，随着外需整体回落，国内增长动能向内需转换。适度超前开展基础设施建设背景下，基建可能仍然是 2023 年经济增长的重要支撑力量；前期出口回落可能使得制造业投资有下行压力，但预计政策仍将支持制造业投资增长，整体或维持偏高水平；经济复苏带动居民资产负债表逐渐修复，预期转变可能会带动居民消费和购房需求有所回暖，地产或逐步企稳，对经济的影响减小。随着消费场景放开，人口流动逐渐回归正常，居民收入可能出现修复，储蓄率有望下降，带动消费增长。通胀方面，基准情形下，预计 CPI 前高后低，PPI 低位震荡，全年通胀压力整体可控。政策方面，稳增长重要性提升，需要货币政策进一步发力，财政发力仍需前置，随着经济好转，财政的收支也有望得到改善。

债券市场投资方面，国内经济有望走向复苏阶段，全年来看预计债券利率波动中枢会小幅上行；信用债或将仍然集中在中高等级展开配置，随着理财净值化影响深入，广义基金对信用债的配置可能会进一步向资质和流动性较好的债券集中，信用利差或延续分化局面。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管要求，将保护基金份额持有人的合法权益放在首位，继续致力于完善公司内部控制机制与合规管理体系，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司内控制度建设，完善公司内控制度体系；对产品合同及各类法律文书进行审核；对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易和利用未公开信息交易，切实维护基金份额持有人、股东和本公司的合法权益；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；根据审计工作计划开展内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作；开展合规培训、法规咨询、更新法规汇编；根据监管部门要求完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规完成向监管部门的各项数据报送工作等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，继续加强公

司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人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。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日，本基金管理人使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基础，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元（基金份额持有人数量不满二百人）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

本报告期，中国建设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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2300251 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	信诚货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的信诚货币市场证券投资基金（以下简称“信诚货币市场基金”）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（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了信诚货币市场基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信诚货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	<p>信诚货币市场基金管理人中信保诚基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括信诚货币市场基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>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。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估信诚货币市场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，除非信诚货币市场基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督信诚货币市场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>(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</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价该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>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对信诚货币市场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信诚货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	虞京京 侯雯
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层
审计报告日期	2023年03月28日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信诚货币市场证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,423,755,918.28	206,328,444.65
结算备付金		-	-
存出保证金		374.41	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,103,732,814.59	4,601,778,531.78

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,103,732,814.59	4,601,778,531.78
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	1,250,764,459.49	1,450,003,295.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		78,690,842.19	130,564.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	10,602,602.33
资产总计		5,856,944,408.96	6,268,843,438.33
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
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		-	39,999,860.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		726,862.83	457,189.48
应付托管费		242,287.61	149,109.15
应付销售服务费		135,208.52	50,644.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		116,767.67	102,224.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	399,493.53	380,938.67
负债合计		1,620,620.16	41,139,966.55
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	5,855,323,788.80	6,227,703,471.78
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		5,855,323,788.80	6,227,703,471.78
负债和净资产总计		5,856,944,408.96	6,268,843,438.33

注：截止本报告期末，基金份额净值为 1.0000 元，基金份额总额 5,855,323,788.80 份。其中信诚货币 A 为 145,378,708.40 份，信诚货币 B 为 4,612,551,102.63 份，信诚货币 E 为 1,097,393,977.77 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚货币市场证券投资基金

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 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		132,354,151.36	87,184,995.83
1. 利息收入		36,620,544.14	86,147,352.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	7,503,414.73	6,610,521.86
债券利息收入		-	58,136,673.14
资产支持证券利息收入		-	695,338.87
买入返售金融资产收入		29,117,129.41	20,704,818.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		95,733,607.22	1,036,948.03
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	95,733,607.22	1,036,948.03
资产支持证券投资收益	7.4.7.11	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	695.35
减：二、营业总支出		16,315,633.65	16,516,177.03
1. 管理人报酬		9,328,869.89	10,220,806.29
2. 托管费		3,109,623.18	3,107,781.00
3. 销售服务费		1,055,719.85	871,392.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,450,302.51	1,957,431.22
其中：卖出回购金融资产支出		2,450,302.51	1,957,431.22
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		48,071.54	43,588.16
8. 其他费用	7.4.7.17	323,046.68	315,177.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		116,038,517.71	70,668,818.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		116,038,517.71	70,668,818.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		116,038,517.71	70,668,818.80

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信诚货币市场证券投资基金

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）	6,227,703,471.78	-	-	6,227,703,471.78
二、本期期初净资产（基金净值）	6,227,703,471.78	-	-	6,227,703,471.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-372,379,682.98	-	-	-372,379,682.98
（一）、综合收益总额	-	-	116,038,517.71	116,038,517.71
（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）	-372,379,682.98	-	-	-372,379,682.98
其中：1. 基金申购款	48,724,825,779.07	-	-	48,724,825,779.07
2. 基金赎回款	-49,097,205,462.05	-	-	-49,097,205,462.05
（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）	-	-	-116,038,517.71	-116,038,517.71
四、本期期末净资产（基金净值）	5,855,323,788.80	-	-	5,855,323,788.80
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 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）	5,803,755,171.00	-	-	5,803,755,171.00
二、本期期初净资产（基金净值）	5,803,755,171.00	-	-	5,803,755,171.00
三、本期增减变动	423,948,300.78	-	-	423,948,300.78

额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	70,668,818.80	70,668,818.80
（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）	423,948,300.78	-	-	423,948,300.78
其中：1. 基金申购款	23,068,099,097.25	-	-	23,068,099,097.25
2. 基金赎回款	-22,644,150,796.47	-	-	-22,644,150,796.47
（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）	-	-	-70,668,818.80	-70,668,818.80
四、本期期末净资产（基金净值）	6,227,703,471.78	-	-	6,227,703,471.78

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：

张翔燕

陈逸辛

刘卓

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

信诚货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准信诚货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]21号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚货币市场证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2011年3月23日生效。根据《关于信诚货币市场证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同的公告》,中信保诚基金管理有限公司于2017年8月1日起对本基金增设E类基金份额,同时开放E类份额的申购赎回业务,并对本基金的基金合同作相应修改。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币3,010,254,386.11元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》，经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准，公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”，并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚货币市场证券投资基金基金合同》和《信诚货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体如下：现金；通知存款；短期融资券；1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券；期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购；期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有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。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a) 金融工具的初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融

负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应

当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括

基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基础，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，当日已实现收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零，若当日已实现收益小于零时，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。

7.4.4.11 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

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

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

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来,而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

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

本基金按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终

止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(b)修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》编制财务报表时,调整了部分财务报表项目的列报和披露,未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下:

(i)金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 206,328,444.65 元、1,450,003,295.00 元、10,602,602.33 元和 130,564.57 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产和应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 207,148,911.66 元、1,450,986,401.27 元和 130,564.57 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值为人民币 4,601,778,531.78 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值为人民币 4,610,577,560.83 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 39,999,860.00 元、457,189.48 元、149,109.15 元、50,644.98 元、54,083.12 元、2,555.55 元和 324,300.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 40,002,415.55 元、457,189.48 元、149,109.15 元、50,644.98 元和 378,383.12 元。

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

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

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

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

本基金在本报告期间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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税

[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的债券，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债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	180,129.14	328,444.65
等于：本金	176,543.69	328,444.65
加：应计利息	3,585.45	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	1,423,575,789.14	206,000,000.00
等于：本金	1,422,000,000.00	206,000,000.00
加：应计利息	1,575,789.14	-
合计	1,423,755,918.28	206,328,444.65

注：其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

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			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,103,732,814.59	3,103,956,770.96	223,956.37	0.0038
	合计	3,103,732,814.59	3,103,956,770.96	223,956.37	0.0038
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,103,732,814.59	3,103,956,770.96	223,956.37	0.0038
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,601,778,531.78	4,603,415,000.00	1,636,468.22	0.0263
	合计	4,601,778,531.78	4,603,415,000.00	1,636,468.22	0.0263
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,601,778,531.78	4,603,415,000.00	1,636,468.22	0.0263

注：偏离金额=影子定价—按实际利率计算的账面价值，偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	250,053,424.66	-
银行间市场	1,000,711,034.83	-
合计	1,250,764,459.49	-
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	-	-
银行间市场	1,450,003,295.00	-
合计	1,450,003,295.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 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	-	10,602,602.33
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	10,602,602.33

7.4.7.6 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	75,193.53	54,083.12
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	75,193.53	54,083.12
应付利息	-	2,555.55
应付审计费	95,000.00	95,000.00
应付信息披露费	220,000.00	220,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
其他	300.00	300.00
合计	399,493.53	380,938.67

7.4.7.7 实收基金

信诚货币 A

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	124,869,923.78	124,869,923.78
本期申购	449,368,101.33	449,368,101.33
本期赎回（以“-”号填列）	-428,859,316.71	-428,859,316.71
本期末	145,378,708.40	145,378,708.40

信诚货币 B

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	6,102,757,427.80	6,102,757,427.80
本期申购	46,906,017,073.34	46,906,017,073.34
本期赎回（以“-”号填列）	-48,396,223,398.51	-48,396,223,398.51
本期末	4,612,551,102.63	4,612,551,102.63

信诚货币 E

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	76,120.20	76,120.20
本期申购	1,369,440,604.40	1,369,440,604.40
本期赎回（以“-”号填列）	-272,122,746.83	-272,122,746.83
本期末	1,097,393,977.77	1,097,393,977.77

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.8 未分配利润

信诚货币 A

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	-	-	-
本期利润	2,584,812.05	-	2,584,812.05
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,584,812.05	-	-2,584,812.05
本期末	-	-	-

信诚货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	112,885,479.79	-	112,885,479.79
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-112,885,479.79	-	-112,885,479.79
本期末	-	-	-

信诚货币 E

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	-	-	-
本期利润	568,225.87	-	568,225.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-568,225.87	-	-568,225.87
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

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01月01日至2021年12月31日
活期存款利息收入	12,871.86	4,948.32
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	7,490,446.63	6,603,188.06
结算备付金利息收入	90.31	2,319.41
其他	5.93	66.07
合计	7,503,414.73	6,610,521.86

注：1、其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
债券投资收益--利息收入	93,232,134.66	-
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,501,472.56	1,036,948.03
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	95,733,607.22	1,036,948.03

7.4.7.10.2 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01月01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	24,518,212,587.02	16,470,930,980.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,458,611,669.66	16,419,328,667.85
减：应计利息总额	57,099,444.80	50,565,365.03
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	2,501,472.56	1,036,948.03

7.4.7.11 资产支持证券投资收益

7.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.11.2 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2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日

卖出资产支持证券成交总额	-	52,551,879.46
减：卖出资产支持证券成本总额	-	51,000,000.00
减：应计利息总额	-	1,551,879.46
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.12.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.15 其他收入

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01月01日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	695.35
合计	-	695.35

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失（上年度可比期间：不适用）。

7.4.7.17 其他费用

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01月01日至2021年12月31日
审计费用	95,000.00	95,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	71,146.68	63,397.71

账户维护费	35,700.00	35,580.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	323,046.68	315,177.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无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
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,328,869.89	10,220,806.29
其中：支付销售机构的客户维护费	867,613.55	777,402.16

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,109,623.18	3,107,781.00

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	合计
中信保诚基金	34,547.88	408,159.96	2.93	442,710.77
建设银行	95,381.55	-	-	95,381.55
合计	129,929.43	408,159.96	2.93	538,092.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E	合计
中信保诚基金	19,092.87	246,161.01	4.57	265,258.45
建设银行	97,620.02	96.44	-	97,716.46
合计	116,712.89	246,257.45	4.57	362,974.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日信诚货币 A 基金资产净值 0.25%、前一日信诚货币 B 基金资产净值 0.01%、前一日信诚货币 E 基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。计算公式为：

信诚货币 A 日基金销售服务费=前一日信诚货币 A 基金资产净值×0.25%/当年天数

信诚货币 B 日基金销售服务费=前一日信诚货币 B 基金资产净值×0.01%/当年天数

信诚货币 E 日基金销售服务费=前一日信诚货币 E 基金资产净值×0.25%/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

本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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自有资金投资本基金的情况

信诚货币 A

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01月01日至2021年 12月31日
基金合同生效日(2011年03月23日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	81,980.35
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	81,980.35
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	-	-

信诚货币 B

份额单位：份

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01月01日至2021年12月31日
基金合同生效日(2011年03月23日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	41,050,979.03	-
报告期内申购/买入总份额	268,474,720.95	226,132,749.77
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	173,000,000.00	185,081,770.74
报告期末持有的基金份额	136,525,699.98	41,050,979.03
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.33%	0.66%

注：本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行。

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

信诚货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2022年12月31日		2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信信托有限责任公司	25,133,416.67	0.43%	301,824,338.27	4.85%
中信保诚人寿保险有限公司	78,374,721.25	1.34%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行。

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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年01月01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
建设银行	180,129.14	12,871.86	328,444.65	4,948.32

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

信诚货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
2,584,812.05	-	-	2,584,812.05	-

信诚货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
112,885,479.79	-	-	112,885,479.79	-

信诚货币 E

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
568,225.87	-	-	568,225.87	-

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等等。董事会下设审计与风控委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险等情况。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和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	540,924,908.27	500,220,126.42
合计	540,924,908.27	500,220,126.42

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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	2,266,389,230.38	4,051,480,535.47
合计	2,266,389,230.38	4,051,480,535.47

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

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	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	296,418,675.94	50,077,869.89
合计	296,418,675.94	50,077,869.89

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即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《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、流动性受限资产占比,并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。本报告期末,本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例超过 20%(不含基金管理人固有资金投资的基金份额),本基金投资组合的平均剩余期限未超过 90 天,平均剩余存续期未超过 180 天,本基金持有的现金、国债、中央银行

票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 20%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 10%。

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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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未来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。

本基金持有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5	5 年以	不计息	合 计
-----	--------	--------	----------	-----	------	-----	-----

2022 年 12 月 31 日				年	上		
资产							
银行存款	753,186,196.01	570,416,666.63	100,153,055.64	-	-	-	1,423,755,918.28
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	374.41	-	-	-	-	-	374.41
交易性金融资产	322,423,013.39	2,014,991,444.09	766,318,357.11	-	-	-	3,103,732,814.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,250,764,459.49	-	-	-	-	-	1,250,764,459.49
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	78,690,842.19	78,690,842.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,326,374,043.30	2,585,408,110.72	866,471,412.75	-	-	78,690,842.19	5,856,944,408.96
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	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	726,862.83	726,862.83
应付托管费	-	-	-	-	-	242,287.61	242,287.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	135,208.52	135,208.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	116,767.67	116,767.67
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	-	399,493.53	399,493.53
负债总计	-	-	-	-	-	-	1,620,620.16	1,620,620.16
利率敏感度缺口	2,326,374,043.30	2,585,408,110.72	866,471,412.75	-	-	-	77,070,222.03	5,855,323,788.80
上年度末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息		合计
资产								
银行存款	61,328,444.65	145,000,000.00	-	-	-	-	-	206,328,444.65
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	928,826,513.90	3,473,966,726.71	198,985,291.17	-	-	-	-	4,601,778,531.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,450,003,295.00	-	-	-	-	-	-	1,450,003,295.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	130,564.57	130,564.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	10,602,602.33	10,602,602.33
资产总计	2,440,158,253.55	3,618,966,726.71	198,985,291.17	-	-	-	10,733,166.90	6,268,843,438.33
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	39,999,860.00	-	-	-	-	-	-	39,999,860.00
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	457,189.48	457,189.48
应付托管费	-	-	-	-	-	-	149,109.15	149,109.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	50,644.98	50,644.98

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	102,224.27	102,224.27
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	380,938.67	380,938.67
负债总计	39,999,860.00	-	-	-	-	1,140,106.55	41,139,966.55
利率敏感度缺口	2,400,158,393.55	3,618,966,726.71	198,985,291.17	-	-	9,593,060.35	6,227,703,471.78

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2022年12月31日)	上年度末(2021年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	1,828,521.84	1,990,071.85
市场利率上升 25 个基点	-1,825,775.76	-1,988,131.77	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金未持有证券交易所上市的股票，因此无重大其他价格风险。

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	-	-
第二层次	3,103,732,814.59	4,601,778,531.78
第三层次	-	-
合计	3,103,732,814.59	4,601,778,531.78

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。

本基金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

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	固定收益投资	3,103,732,814.59	52.99
	其中：债券	3,103,732,814.59	52.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,250,764,459.49	21.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,423,755,918.28	24.31
4	其他各项资产	78,691,216.60	1.34
5	合计	5,856,944,408.96	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.60	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

注：本基金合同约定，本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在 120 天以内，以规避较长期限债券的利率风险。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	39.66	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	40.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	7.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	98.52	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	按实际利率计算的 账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	130,046,301.12	2.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	296,418,675.94	5.06
	其中：政策性金融债	296,418,675.94	5.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	410,878,607.15	7.02
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,266,389,230.38	38.71
8	其他	-	-
9	合计	3,103,732,814.59	53.01
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计算的账 面价值	占基金资产净值 比例（%）
1	112220207	22 广发银行 CD207	2,000,000	199,172,832.08	3.40

2	112212185	22 北京银行 CD185	1,500,000	149,214,451.33	2.55
3	112202007	22 工商银行 CD007	1,500,000	149,203,683.93	2.55
4	112212194	22 北京银行 CD194	1,500,000	149,173,683.60	2.55
5	112219302	22 恒丰银行 CD302	1,500,000	149,077,145.17	2.55
6	210312	21 进出 12	1,300,000	133,414,549.37	2.28
7	112203027	22 农业银行 CD027	1,300,000	129,109,524.28	2.20
8	200202	20 国开 02	1,000,000	101,381,657.09	1.73
9	012283759	22 华能新能 SCP005	1,000,000	100,219,428.66	1.71
10	012284318	22 中铝集 SCP006	1,000,000	100,057,655.44	1.71

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0824%
报告期内偏离度的最低值	-0.0581%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0288%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

8.9.2 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，报告编制日前一年内，广发银行股份有限公司受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会处罚（银罚决字[2022]12号、银保监罚决字[2022]23号）；北京银行股份有限公司受到国家外汇管理局处罚（京汇罚[2022]20号）；中国工商银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字[2022]11号）；恒丰银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局山东省分局处罚（银保监罚决字[2022]26号、鲁汇罚[2022]5号）；中国进出口银行受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]9号）；中国农业银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]12号、银保监罚决字[2022]52号）。国家开发银行受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]8号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、中国银行保险监督管理委员会及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	374.41
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	78,690,842.19
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	78,691,216.60

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中摊余成本占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信诚货币 A	12,040	12,074.64	16,890,221.49	11.62%	128,488,486.91	88.38%
信诚货币 B	56	82,366,983.98	4,584,600,165.55	99.39%	27,950,937.08	0.61%
信诚货币 E	26,045	42,134.54	559,893,779.48	51.02%	537,500,198.29	48.98%
合计	38,141	153,517.84	5,161,384,166.52	88.15%	693,939,622.28	11.85%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	券商类机构	400,167,307.03	6.83%
2	基金类机构	366,897,032.22	6.27%
3	其他机构	300,020,995.07	5.12%
4	其他机构	220,104,630.89	3.76%
5	券商类机构	200,095,119.01	3.42%
6	其他机构	200,095,119.01	3.42%
7	券商类机构	200,027,190.55	3.42%
8	其他机构	200,025,211.26	3.42%
9	其他机构	180,085,607.10	3.08%
10	其他机构	160,127,286.48	2.73%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（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	信诚货币 A	8,052.60	0.01%
	信诚货币 B	-	-
	信诚货币 E	70,024.10	0.01%
	合计	78,076.70	0.00%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（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	信诚货币 A	0~10
	信诚货币 B	0
	信诚货币 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚货币 A	0
	信诚货币 B	0
	信诚货币 E	0~10
	合计	0~10

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

项目	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
基金合同生效日（2011 年 03 月 23 日）基金份额总额	993,402,234.67	2,016,852,151.44	-
本报告期期初基金份额总额	124,869,923.78	6,102,757,427.80	76,120.20
本报告期基金总申购份额	449,368,101.33	46,906,017,073.34	1,369,440,604.40
减：本报告期基金总赎回份额	428,859,316.71	48,396,223,398.51	272,122,746.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	145,378,708.40	4,612,551,102.63	1,097,393,977.77

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 95,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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	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 03 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警告、30000 元罚款
受到稽查或处罚等措施的原因	未按规定向单一资产管理计划投资人披露信息
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司对此高度重视、举一反三，全面完成了相关问题整改。
其他	2022 年上半年，因前述原因，基金管理人及其部分高级管理人员分别收到中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施。公司对此高度重视，加强内控建设，并全面完成了相关问题整改。

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，基金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	
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

长城证券	2	-	-	-	--
长江证券	2	-	-	-	--
川财证券	2	-	-	-	--
大通证券	1	-	-	-	--
东北证券	2	-	-	-	--
东方财富 证券	1	-	-	-	--
东方证券	1	-	-	-	--
东吴证券	2	-	-	-	--
东兴证券	1	-	-	-	--
方正证券	1	-	-	-	--
高盛高华	1	-	-	-	--
光大证券	1	-	-	-	--
广发证券	1	-	-	-	--
国金证券	1	-	-	-	--
国联证券	1	-	-	-	--
国盛证券	2	-	-	-	--
国泰君安	1	-	-	-	--
国信证券	2	-	-	-	--
国元证券	1	-	-	-	--
海通证券	1	-	-	-	--
红塔证券	1	-	-	-	--
华宝证券	1	-	-	-	--
华创证券	3	-	-	-	--
华金证券	1	-	-	-	--
华融证券	1	-	-	-	--
华泰证券	2	-	-	-	--
华西证券	2	-	-	-	--
金通证券	1	-	-	-	--
开源证券	1	-	-	-	--
民生证券	1	-	-	-	--
平安证券	2	-	-	-	--
瑞银证券	1	-	-	-	--
山西证券	1	-	-	-	--
申港证券	1	-	-	-	--

申万宏源	4	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	1	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	14,998,113.34	100.00%	1,333,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚货币市场证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日

2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告	同上	2022 年 01 月 21 日
3	信诚货币市场证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	同上	2022 年 01 月 26 日
4	信诚货币市场证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 03 月 02 日
5	信诚货币市场证券投资基金更新招募说明书（2022 年 3 月）	同上	2022 年 03 月 02 日
6	信诚货币市场证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 03 月 02 日
7	信诚货币市场证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 03 月 02 日
8	信诚货币市场证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	同上	2022 年 03 月 30 日
9	信诚货币市场证券投资基金 2021 年年度报告	同上	2022 年 03 月 31 日
10	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	同上	2022 年 03 月 31 日
11	信诚货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	同上	2022 年 04 月 21 日
12	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	同上	2022 年 04 月 21 日
13	信诚货币市场证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	同上	2022 年 04 月 27 日
14	信诚货币市场证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	同上	2022 年 07 月 20 日
15	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	同上	2022 年 07 月 20 日
16	信诚货币市场证券投资基金 2022 年中期报告	同上	2022 年 08 月 27 日
17	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年中期报告提示性公告	同上	2022 年 08 月 27 日
18	信诚货币市场证券投资基金基金经理变更公告	同上	2022 年 09 月 07 日
19	信诚货币市场证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 09 月 08 日
20	信诚货币市场证券投资基金更新招募说明书	同上	2022 年 09 月 08 日
21	信诚货币市场证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 09 月 08 日
22	信诚货币市场证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 09 月 08 日
23	信诚货币市场证券投资基金暂停大额申	同上	2022 年 09 月 28 日

	购、大额转换转入、定期定额投资的公告		日
24	信诚货币市场证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	同上	2022 年 10 月 25 日
25	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	同上	2022 年 10 月 25 日
26	中信保诚基金管理有限公司关于在中信银行“零钱+”平台开通部分货币市场基金份额 T+0 快速赎回业务的公告	同上	2022 年 12 月 09 日
27	信诚货币市场证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 12 月 15 日
28	信诚货币市场证券投资基金更新招募说明书（2022 年 12 月）	同上	2022 年 12 月 15 日
29	信诚货币市场证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 12 月 15 日
30	信诚货币市场证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2022 年 12 月 15 日
31	信诚货币市场证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	同上	2022 年 12 月 29 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

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、信诚货币市场证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚货币市场证券投资基金基金合同
- 4、信诚货币市场证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2023 年 03 月 31 日