中加丰泽纯债债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 18
6.3 净资产（基金净值）变动表 19
6.4 报表附注 22
§7 投资组合报告 50
7.1 期末基金资产组合情况 50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
7.12 投资组合报告附注 52
§8 基金份额持有人信息 53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 53

§9 开放式基金份额变动 54
§10 重大事件揭示 54
10.1 基金份额持有人大会决议 54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 55
10.8 其他重大事件 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57
12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 57
12.3 查阅方式 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加丰泽纯债债券型证券投资基金
基金简称	中加丰泽纯债债券
基金主代码	003417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	942,892,118.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中加基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披	姓名	刘凌	田东辉

露负责人	联系电话	400-00-95526	010-68858113
	电子邮箱	service@bobbns.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-00-95526	95580
传真		010-83197627	010-68858120
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100050	100808
法定代表人		夏英	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年01月01日- 2022年06月30日）
本期已实现收益	14,161,269.56
本期利润	16,633,368.68
加权平均基金份额本期利润	0.0222

本期加权平均净值利润率	2.11%
本期基金份额净值增长率	2.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2022年06月30日）
期末可供分配利润	22,477,715.69
期末可供分配基金份额利润	0.0238
期末基金资产净值	988,753,275.05
期末基金份额净值	1.049
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2022年06月30日）
基金份额累计净值增长率	29.12%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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。

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

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
过去一个月	0.10%	0.05%	-0.24%	0.03%	0.34%	0.02%
过去三个月	0.95%	0.05%	0.29%	0.04%	0.66%	0.01%
过去六个月	2.32%	0.05%	0.38%	0.05%	1.94%	0.00%
过去一年	5.05%	0.06%	1.83%	0.05%	3.22%	0.01%
过去三年	12.04%	0.07%	3.53%	0.06%	8.51%	0.01%
自基金合同生效起至今	29.12%	0.06%	5.84%	0.07%	23.28%	-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



§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十二只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金(A/C)、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中

加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金(A/C)、中加核心智造混合型证券投资基金(A/C)、中加优势企业混合型证券投资基金(A/C)、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金(A/C)、中加中证500指数增强型证券投资基金(A/C)、中加科享混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加消费优选混合型证券投资基金（A/C）、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加龙头精选混合型证券投资基金（A/C）、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加量化研选混合型证券投资基金（A/C）、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

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）	证券	说明

		期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
袁素	本基金基金经理	2022-04-29	-	10	袁素女士，复旦大学经济学学士，北京大学西方经济学硕士。2011年至2020年，曾先后任安信证券固定收益部研究员、投资助理；民生加银基金专户理财部投资助理、投资经理。2020年加入中加基金管理有限公司，曾任中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金（2020年10月16日至2022年1月6日）、中加博裕纯债债券型证券投资基金（2020年10月23日至2022年1月6日）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（2020年10月23日至2022年1月7日）的基金经理，现任中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（2020年10月23日至今）、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金（2020年11月30日至今）、中加民丰纯债债券型证券投资基金（2020年11月30日至今）、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（2020年12月14日至今）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金（2021年2月23日至

					今）、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金（2021年6月25日至今）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金（2021年9月8日至今）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金（2022年4月29日至今）的基金经理。
杨宇俊	原本基金基金经理	2016-12-19	2022-04-29	13	杨宇俊先生，金融工程博士，北京银行博士后，具有多年债券市场投资研究经验。曾任北京银行总行资金交易部分析师，负责债券市场和货币市场的研究与投资工作。2013年加入中加基金，任专户投资经理，具备基金从业资格。曾任中加丰尚纯债债券型证券投资基金（2016年8月19日至2020年3月20日）、中加丰享纯债债券型证券投资基金（2016年11月11日至2020年3月20日）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（2016年11月28日至2020年3月20日）、中加瑞盈债券型证券投资基金（2016年3月23日至2020年7月15日）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金（2019年1月17日至2020年10月23日）、中加颐智纯债债券型证券投资基金（2019年4月29日至2020年11月

					23日）、中加优选中高等级债券型证券投资基金（2019年12月5日至2021年11月15日）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（2016年6月17日至2022年1月6日）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金（2016年12月19日至2022年4月29日）、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金（2016年11月2日至2022年5月13日）、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（2016年11月11日至2022年4月29日）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金（2018年6月8日至2022年5月13日）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（2019年7月31日至2022年4月29日）、中加科鑫混合型证券投资基金（2021年5月26日至2022年6月17日）、中加博裕纯债债券型证券投资基金（2022年1月6日至2022年6月17日）、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金（2022年4月12日至2022年6月17日）的基金经理。

1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：因个人原因，杨宇俊先生于2022年4月29日离任本基金基金经理。
3、证券从业年限的计算标准遵从《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、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

一季度，债券市场收益率总体宽幅震荡。去年12月的中央经济工作会议明确了稳增长作为今年经济工作重点，货币政策、财政政策和其他行业政策配合的节奏及效果决定了收益率波动的方向。1月份，为降低实体经济融资成本，为今年经济良好开局，货币政策先行，各品种政策利率先后调降，同时银行间流动性保持充裕，债券收益率相应陡峭化下行，收益率降至绝对偏低水平。2月开始债券收益率总体震荡上行。两会提出了5.5%的全年经济增长目标。为尽快实现实物工作量，信贷投放集中发力，社融总量数据增速向好。在去年地产调控已见成效的基础上，地产政策因城施策，部分城市根据实际

情况对限购政策边际放松或调降居民房贷利率。地方债发行节奏和项目审批速度较快。微观机构行为方面，理财产品净值化之后，全市场负债端不稳定性提高。以上因素使得收益率曲线平坦化上行。二季度开始，疫情因素对消费和生产均形成了较广泛的冲击，打断了两会后的经济扩张节奏，部分地区生产活动和消费活动停滞，第三产业受到的冲击更为明显。为了对冲疫情对于经济活动的不利影响，货币政策和财政政策均积极应对。财政通过留抵退税减轻微观主体的税负压力，帮助小微企业持续经营。央行和央企上缴留存利润，央行进行了一次降准操作，并调降了LPR利率，通过量价工具有效降低了实体经济融资成本。对于债券市场，由于实体融资需求疲弱，流动性驻留银行间市场，使得资金利率持续显著低于政策利率，债券收益率曲线趋于陡峭化，信用利差明显压缩。

报告期内，我们根据市场变化灵活调整仓位，把握了市场收益率下行带来的机会，并保持了较积极的杠杆水平，充分获取了套息收益和信用利差压缩收益。在债券的品种选择方面，在严格甄别信用风险的前提下，结合行业特点，深挖资质佳、久期适当、收益率相对较高的个券获取票息收益，持仓以中高等级城投债和产业龙头为主。同时，以这些信用债作为底仓，积极捕捉利率债波段交易机会，赚取价差收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加丰泽纯债债券基金份额净值为1.049元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.32%，同期业绩比较基准收益率为0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在疫情因素的扰动下，经济增长面临诸多干扰，且在注重经济增长质量和结构优化的前提下，可选政策工具受限，未来经济修复的过程将较为温和。因此，债券市场总体仍将延续震荡，关注实体经济融资需求恢复的速度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

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历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

5、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、截至2022年6月30日，本基金在本报告期内利润分配合计9,621,720.74元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在中加丰泽纯债债券型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金共进行利润分配9,621,720.74元

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中加丰泽纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	189,635.49	621,574.22
结算备付金		163,932.19	1,740,756.23
存出保证金		60,642.70	8,842.13
交易性金融资产	6.4.7.2	1,232,058,202.66	677,824,700.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,232,058,202.66	677,824,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	10,778,848.18
资产总计		1,232,472,413.04	690,974,720.76
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		240,085,051.52	121,499,750.00
应付清算款		-	510,152.05
应付赎回款		3,074,411.93	1,299.96
应付管理人报酬		249,863.74	144,475.21
应付托管费		83,287.90	48,158.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		85,693.76	75,441.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	140,829.14	243,702.76
负债合计		243,719,137.99	122,522,980.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	942,892,118.96	549,006,612.47
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	45,861,156.09	19,445,128.01

净资产合计		988,753,275.05	568,451,740.48
负债和净资产总计		1,232,472,413.04	690,974,720.76

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.049元，基金份额942,892,118.96份。

6.2 利润表

会计主体：中加丰泽纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
一、营业总收入		20,045,619.42	25,198,936.47
1.利息收入		98,493.90	27,756,061.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	41,568.14	28,592.44
债券利息收入		-	27,686,762.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,925.76	40,706.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,459,428.83	-4,214,948.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,459,428.83	-4,214,948.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
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）	6.4.7.15	2,472,099.12	1,657,823.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,597.57	0.16
减：二、营业总支出		3,412,250.74	5,044,954.85
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,162,845.70	1,629,598.90
2．托管费	6.4.10.2.2	387,615.18	543,199.62
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		1,705,286.99	2,657,872.31
其中：卖出回购金融资产支出		1,705,286.99	2,657,872.31
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		43,683.32	76,261.31
8．其他费用	6.4.7.18	112,819.55	138,022.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,633,368.68	20,153,981.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,633,368.68	20,153,981.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,633,368.68	20,153,981.62

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中加丰泽纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	549,006,612.47	-	19,445,128.01	568,451,740.48
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）	549,006,612.47	-	19,445,128.01	568,451,740.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	393,885,506.49	-	26,416,028.08	420,301,534.57
（一）、综合收益总额	-	-	16,633,368.68	16,633,368.68
（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）	393,885,506.49	-	19,404,380.14	413,289,886.63
其中：1.基金申购款	686,316,689.17	-	33,152,958.13	719,469,647.30
2.基金赎回款	-292,431,182.68	-	-13,748,577.99	-306,179,760.67
（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）	-	-	-9,621,720.74	-9,621,720.74

（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）	942,892,118.96	-	45,861,156.09	988,753,275.05
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,143,643,476.52	-	23,893,454.40	1,167,536,930.92
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）	1,143,643,476.52	-	23,893,454.40	1,167,536,930.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,962,291.35	-	-5,128,682.83	-95,090,974.18
（一）、综合收益总额	-	-	20,153,981.62	20,153,981.62
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-89,962,291.35	-	-2,185,095.79	-92,147,387.14
其中：1.基金申购款	5,936,129.44	-	118,082.29	6,054,211.73
2.基金赎回款	-95,898,420.79	-	-2,303,178.08	-98,201,598.87
（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）	-	-	-23,097,568.66	-23,097,568.66

（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）	1,053,681,185.17	-	18,764,771.57	1,072,445,956.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

夏英	陈昕	陈昕
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中加丰泽纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金") 依据中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）于2016年4月6日证监许可［2016］672号《关于准予中加丰泽纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准，由中加基金管理有限公司（以下简称"中加基金"）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加丰泽纯债债券债券型投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称"邮储银行"）。

本基金通过中加基金的直销中心及北京银行股份有限公司（以下简称"北京银行"）共同发售，募集期为2016年9月30日至2016年12月14日。本基金于2016年12月19日成立，成立之日基金实收份额为200,329,036.53份(含利息转份额人民币289.20元)，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中加丰泽纯债债券型证券投资基金合同》和《中加丰泽纯债债券型证券投资招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80％；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债

券投资比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况、自2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2022年1月1日至2022年6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(一)金融资产的分类

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。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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：

1.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；

2. 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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地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。

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。

(二)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。

1. 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。

2. 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(一)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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。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。

(二)金融工具的后续计量

1.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。

2.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。

3.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

4.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。

(三)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：

1.收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

2.该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

3.该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产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：

4.所转移金融资产的账面价值；

5.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）。

(四)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：

1. 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。

对于应收账款，本基金始终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。

除应收账款外，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：

2. 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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。

6.4.4.6 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：

（1）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；

(2)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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入"未分配利润"。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用于进行债券等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认为当期损益。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直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管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。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的支出差异较小的可采用合同利率。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

(一) 新金融工具准则

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

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

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务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。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(1) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，对应的账面价值分别为人民币621,574.22元、1,740,756.23元、8,842.13元、10,778,848.18元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金，对应的账面价值分别为人民币623,519.64元、1,741,617.86元、8,846.53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677,824,700.00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688,600,736.73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、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币121,499,750.00元、510,152.05元、1,299.96元、144,475.21元、48,158.38元、34,120.05元、75,441.92元、-17.29元、209,600.00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、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应交税费、和其他负债，对应的账面价值分别为人民币121,499,732.71元、510,152.05元、1,299.96元、144,475.21元、48,158.38元、75,441.92元和243,720.05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。

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

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

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税［2002］128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税［2004］78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税［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：

（1）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。

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

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票

（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、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。

(3) 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	189,635.49
等于：本金	189,505.59
加：应计利息	129.90
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	189,635.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		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	50,760,467.04	795,722.18	51,530,977.18	-25,212.04
	银行间市场	1,163,318,578.75	14,008,725.48	1,180,527,225.48	3,199,921.25
	合计	1,214,079,045.79	14,804,447.66	1,232,058,202.66	3,174,709.21
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,214,079,045.79	14,804,447.66	1,232,058,202.66	3,174,709.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,609.59
其中：交易所市场	-
银行间市场	37,609.59
应付利息	-
预提费用	103,219.55
合计	140,829.14

注：预提费用包括预提信息披露费、预提审计费和预提账户维护费。

6.4.7.7 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06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	549,006,612.47	549,006,612.47
本期申购	686,316,689.17	686,316,689.17
本期赎回（以“-”号填列）	-292,431,182.68	-292,431,182.68
本期末	942,892,118.96	942,892,118.96

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 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	7,322,995.54	12,122,132.47	19,445,128.01
本期利润	14,161,269.56	2,472,099.12	16,633,368.68
本期基金份额交易产生的变动数	10,615,171.33	8,789,208.81	19,404,380.14
其中：基金申购款	16,815,867.24	16,337,090.89	33,152,958.13
基金赎回款	-6,200,695.91	-7,547,882.08	-13,748,577.99
本期已分配利润	-9,621,720.74	-	-9,621,720.74
本期末	22,477,715.69	23,383,440.40	45,861,156.09

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	18,235.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	16,288.44
其他	7,044.68
合计	41,568.14

注：其他为存出保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	16,932,762.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	526,666.77
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	17,459,428.83

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,810,899,418.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,783,854,126.05
减：应计利息总额	26,490,920.75
减：交易费用	27,704.51
买卖债券差价收入	526,666.77

注：本基金本报告期内无债转股业务。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.15 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2022年06月30日
1.交易性金融资产	2,472,099.12
——股票投资	-
——债券投资	2,472,099.12
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,472,099.12

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	14,894.61
转换费收入	702.96

合计	15,597.57

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他费用	600.00
合计	112,819.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人

北京银行股份有限公司	基金管理人股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,162,845.70	1,629,598.90
其中：支付销售机构的客户维护费	116,555.38	46,349.71

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	387,615.18	543,199.62

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行	-	-	-	-	142,850,000.00	61,209.05

本基金上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	189,635.49	18,235.02	1,926,152.87	12,653.32

股份有限公司				

注：本基金的活期存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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	2022-06-22	2022-06-22	0.100	6,420,201.06	3,201,519.68	9,621,720.74	-
合计			0.100	6,420,201.06	3,201,519.68	9,621,720.74	-

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额240,085,051.52元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012280734	22汉江国资SCP001	2022-07-01	101.05	200,000	20,210,186.30
101800408	18成都开投MTN002	2022-07-04	104.03	300,000	31,208,822.47
101901427	19珠海港MTN003	2022-07-01	106.07	200,000	21,213,925.48
102002363	20昆山国创MTN002	2022-07-04	104.12	300,000	31,235,810.96
102100694	21诚通控股MTN001	2022-07-04	102.14	200,000	20,427,802.74
102100711	21苏高新城MTN001	2022-07-01	102.54	100,000	10,253,545.21
102101005	21中建投资MTN001	2022-07-01	101.44	100,000	10,143,916.71
102101005	21中建投资MTN001	2022-07-04	101.44	253,000	25,664,109.28
102102266	21中节能MTN003	2022-07-01	102.50	400,000	41,001,589.04
210312	21进出12	2022-07-01	101.67	50,000	5,083,390.41
220401	22农发01	2022-07-01	100.52	375,000	37,694,753.43
合计				2,478,000	254,137,852.03

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2022年6月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，

由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人在银行间同业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；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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	40,570,421.91	20,204,000.00
A-1以下	-	-
未评级	489,174,088.23	4,992,500.00
合计	529,744,510.14	25,196,500.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期融资券。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	347,459,987.95	108,299,000.00
AAA以下	288,183,294.98	292,669,200.00
未评级	66,670,409.59	251,660,000.00
合计	702,313,692.52	652,628,200.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。针对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。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	189,635.49	-	-	-	189,635.49

结算备付金	163,932.19	-	-	-	163,932.19
存出保证金	60,642.70	-	-	-	60,642.70
交易性金融资产	707,384,403.02	524,673,799.64	-	-	1,232,058,202.66
资产总计	707,798,613.40	524,673,799.64	-	-	1,232,472,413.04
负债					
卖出回购金融资产款	240,085,051.52	-	-	-	240,085,051.52
应付赎回款	-	-	-	3,074,411.93	3,074,411.93
应付管理人报酬	-	-	-	249,863.74	249,863.74
应付托管费	-	-	-	83,287.90	83,287.90
应交税费	-	-	-	85,693.76	85,693.76
其他负债	-	-	-	140,829.14	140,829.14
负债总计	240,085,051.52	-	-	3,634,086.47	243,719,137.99
利率敏感度缺口	467,713,561.88	524,673,799.64	-	-3,634,086.47	988,753,275.05
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	621,574.22	-	-	-	621,574.22
结算备付金	1,740,756.23	-	-	-	1,740,756.23
存出保证金	8,842.13	-	-	-	8,842.13
交易性金融资产	107,725,000.00	498,497,700.00	71,602,000.00	-	677,824,700.00
其他资	-	-	-	10,778,848.18	10,778,848.18

产					
资产总计	110,096,172.58	498,497,700.00	71,602,000.00	10,778,848.18	690,974,720.76
负债					
卖出回购金融资产款	121,499,750.00	-	-	-	121,499,750.00
应付清算款	-	-	-	510,152.05	510,152.05
应付赎回款	-	-	-	1,299.96	1,299.96
应付管理人报酬	-	-	-	144,475.21	144,475.21
应付托管费	-	-	-	48,158.38	48,158.38
应交税费	-	-	-	75,441.92	75,441.92
其他负债	-	-	-	243,702.76	243,702.76
负债总计	121,499,750.00	-	-	1,023,230.28	122,522,980.28
利率敏感度缺口	-11,403,577.42	498,497,700.00	71,602,000.00	9,755,617.90	568,451,740.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,184,158.70	4,965,065.93
	市场利率上升25个基点	-3,184,158.70	-4,965,065.93

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持有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。本基金报告期末主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有交易性权益类投资品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	1,232,058,202.66	124.61	677,824,700.00	119.24
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,232,058,202.66	124.61	677,824,700.00	119.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,232,058,202.66	677,824,700.00
第三层次	-	-
合计	1,232,058,202.66	677,824,700.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021年06月30日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产 和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,232,058,202.66	99.97
	其中：债券	1,232,058,202.66	99.97
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	353,567.68	0.03
8	其他各项资产	60,642.70	0.00
9	合计	1,232,472,413.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	13,356,940.84	1.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	97,298,824.39	9.84
	其中：政策性金融债	45,291,127.40	4.58
4	企业债券	68,844,027.57	6.96
5	企业短期融资券	476,179,832.31	48.16
6	中期票据	576,378,577.55	58.29
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,232,058,202.66	124.61

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	102102266	21中节能MTN003	400,000	41,001,589.04	4.15
2	102280038	22乌高新MTN001	400,000	40,883,320.55	4.13

3	102101005	21中建投资MTN001	400,000	40,575,666.85	4.10
4	220401	22农发01	400,000	40,207,736.99	4.07
5	102001831	20农十二师MTN002	300,000	32,082,986.30	3.24

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	60,642.70
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,642.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
329	2,865,933.49	939,290,194.94	99.62%	3,601,924.02	0.38%

8.2 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	1,889.04	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	200,329,036.53
本报告期期初基金份额总额	549,006,612.47
本报告期基金总申购份额	686,316,689.17
减：本报告期基金总赎回份额	292,431,182.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	942,892,118.96

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内人事变动情况：无。

基金托管人的专门基金托管部门本报告期内人事变动情况：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚；基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

（1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；

（2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（3）研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

（1）投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

（2）公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

（3）券商名单及相应的席位租用安排确定后,由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的比例		购成交总额的比例		交总额的比例		交总额的比例
招商证券	551,811,768.87	100.00%	1,810,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加丰泽纯债债券型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
2	中加基金管理有限公司关于中加丰泽纯债债券型证券投资基金增加销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-19
3	中加丰泽纯债债券型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
4	中加基金管理有限公司关于旗下中加丰泽纯债债券型证券投资基金增加销售机构、开通基金定期定额投资业务并调整最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-15
5	中加丰泽纯债债券型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-30
6	中加丰泽纯债债券型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
7	中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
8	中加丰泽纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-09
9	中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-09
10	中加丰泽纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含转	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-20

	换转入、定期定额投资）业务的公告		
11	中加丰泽纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220124	145,207,163.60	0.00	145,207,163.60	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中加丰泽纯债债券型证券投资基金设立的文件

2、《中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《中加丰泽纯债债券型证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区金融大街3号A座

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日