

# 江信汇福定期开放债券型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:江信基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

大华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52

8.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	59
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	江信汇福定期开放债券型证券投资基金
基金简称	江信汇福
基金主代码	002448
交易代码	002448
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月05日
基金管理人	江信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	194,759,289.71份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>由于本基金存在开放期与封闭期，在开放期与封闭期将实行不同的投资策略。</p> <p>在开放期内本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> <p>在封闭期内的投资将依托基金管理人自身信用评级体系和信用风险控制措施。采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，实现风险和收益的最佳配比。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的3个月期定期存款基准利率（税后）×2。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日，根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

## 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		江信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	付明	石立平
	联系电话	010-57380855	010-63639180
	电子邮箱	customer@jxfund.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-622-0583	95595
传真		010-57380988	010-63639132
注册地址		北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100086	100033
法定代表人		孙楨磬	王江

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jxfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	大华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市海淀区西四环中路16号院7号楼8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	8,912,854.57	9,265,569.48	16,926,572.46
本期利润	7,413,652.96	9,865,386.10	13,152,370.84
加权平均基金份额本期利润	0.0381	0.0493	0.0334
本期加权平均净值利润率	3.39%	4.58%	3.22%
本期基金份额净值增长率	3.46%	4.69%	3.43%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	6,753,931.57	-2,165,339.79	-11,575,247.53
期末可供分配基金份额利润	0.0347	-0.0111	-0.0574
期末基金资产净值	221,907,087.23	214,260,379.82	212,234,242.96
期末基金份额净值	1.1394	1.1013	1.0520
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	16.94%	13.03%	7.97%

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

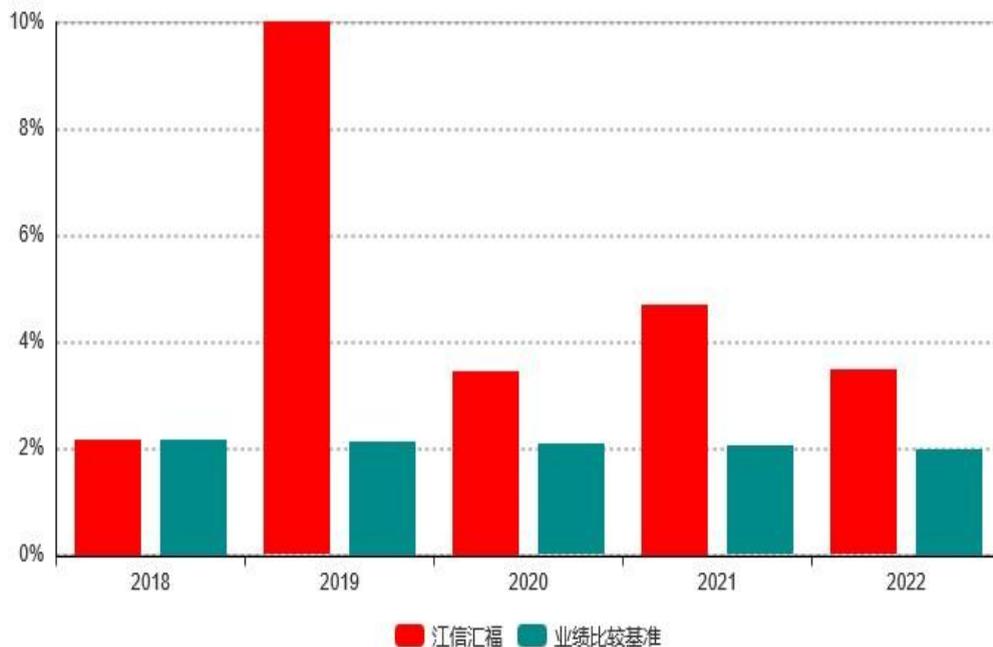
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.01%	0.05%	0.49%	0.01%	-0.50%	0.04%
过去六个月	1.46%	0.04%	0.99%	0.01%	0.47%	0.03%
过去一年	3.46%	0.04%	1.98%	0.01%	1.48%	0.03%
过去三年	12.02%	0.07%	6.19%	0.01%	5.83%	0.06%
过去五年	25.87%	0.16%	10.76%	0.01%	15.11%	0.15%
自基金合同生效起至今	16.94%	0.17%	14.86%	0.01%	2.08%	0.16%

#### 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

江信汇福定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年05月05日-2022年12月31日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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

江信基金管理有限公司是2012年12月经中国证监会（证监基字[2012]1717号文）批准设立的基金管理公司，注册资本1.8亿元人民币，股东为：国盛证券有限责任公司、安徽恒生阳光控股有限公司、金麒麟投资有限公司、鹰潭红石投资管理有限合伙企业、鹰潭聚福投资管理有限合伙企业。目前，各家持股比例分别为：30%、17.5%、17.5%、17.5%、17.5%。公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2022年12月31日，本基金管理人管理的开放式基金为：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、江信祺福债券型证券投资基金、江信添福债券型证券投资基金、江信洪福纯债债券型证券投资基金、江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信一年定期开放债券型证券投资基金、江信增利货币市场基金。同时，公司还管理着多个资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨鹏飞	本基金的基金经理	2020-12-02	-	11年	杨鹏飞先生，经济学硕士，2011年7月至2016年11月先后担任中航证券有限公司研究员、投资经理。2016年12月至2017年5月担任国都证券股份有限公司的基金经理助理，从事固定收益投资研究工作。2017年6月至2018年7月担任国都聚益定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017年6月至2019年1月担任国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金基金经

					理。2019年6月加入江信基金管理有限公司。现任江信添福债券型证券投资基金、江信增利货币市场基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

- (1) 任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期或基金成立日期填写；
- (2) 证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 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

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理办法》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和资产管理计划的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

公司建立了科学的投资决策体系，不断完善投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各基金经理的投资权限。加强交易执行环节的内部控制，实行集中交易制度，交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，系统强制启动公平交易程序。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，以保证公司管理的不同投资组合获得公平对待，保护投资者合法权益。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理办法》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和特定客户资产管理组合的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人通过不断完善研究方法和投资决策流程，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合享有公平的投资决策机会；公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离的原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；公司不断加强对投资交易行为的监察稽核力度，确保做好对公平交易各环节的监控和分析评估工作。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

### 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

2022年是黑天鹅与灰犀牛频发、交织的一年，俄乌战争、美国暴力加息、疫情全国范围扩散、在建地产停工并愈演愈烈等，资本市场波动巨大。国内债券市场在央行逆周期调节下，长端利率前期呈现区间震荡，年底受疫情防控放开和地产强力支持政策出台影响，利率转而大幅上行。

上半年，尽管出现因疫情扩散较快导致上海等超大城市封城的不利情况，但在地方政府债券发行前置和区域地产政策放松等对冲下，10年国债利率整体处于2.70%-2.85%区间内震荡。然而受李克强总理明确表态“不会出台超大规模刺激措施”的讲话以及央行年内二次降息的影响，10年国债快速下行至2.60%以下，市场乐观程度暴增，一度打开了利率下行空间的想象。但是其后央行出现较为罕见的连续20亿逆回购操作量，触发长端利率拐点出现，机构开始归于谨慎。最大的变化还是出现在四季度，随着疫情防控基调的根本性转变以及地产支持政策由区域性政府抬高到全局层面，利率短期突升，导致理财产品大范围破净，并引发赎回潮，市场流动性负反馈机制进一步促使利率上行。虽然央行及时投放以呵护流动性，但在微观结构的修复过程中，市场依然发生了余震。10年期国债收益率由8月初低点最高上行30bp以上，银行二级资本债、城投债等更是普遍上行100bp以上。

报告期内，管理人根据市场变化和产品特点，在高度重视组合流动性的基础上，以稳健配置策略为主，适度灵活、积极投资，并通过逆回购策略增强收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信汇福基金份额净值为1.1394元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.46%，同期业绩比较基准收益率为1.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

大疫三年，全国人民工作生活殊为不易，第一波感染高峰已经度过，虽然参考国外经历，疫情反复可能还会持续数轮，但逐渐消退的大趋势基本不会改变。2023年国内整体发展重心转向经济发展，相对于国外经济体，国内已经开启弱复苏周期，这次的周期不同步已经转向对我国有利局面，这也会映射到资本市场表现上。

展望2023年，受疤痕效应影响，居民部门信心修复仍待时日，参考邻国经验，消费复苏晚于疫情过峰一个季度。受疫情影响，企业部门生产受阻，资产收缩导致资产负债表受损，修复同样需要时间与政策支持。房地产投资仍处于底部区间，“保交房”是首要任务，在政策加持下，有望在下半年走出负增长。在全球经济放缓、外需走弱的背景下，短期国内经济增长、信用修复的动力主要来自政策端发力，随着私人部门资产负债表得到实质性改善，经济增长将迎来内生性动力。综合考虑，预计2023年GDP增速将落在5%-5.5%区间。

对债券市场而言，经济的恢复将带动利率的上行，意味着今年债券市场趋势性资本利得牛市的可能性较低。但从另一方面看，2022年四季度利率上行幅度较大，当前利率水平已经到了一个比较有吸引力的水平，预计今年票息策略收益可观。

此外，需要重点关注美国市场，一方面要关注美国高通胀的黏性，另一方面需要重点防范美国在高通胀局势下，政府债务高企对其经济的反噬，不排除下半年美国经济出现较大衰退的可能性。

#### 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，本基金管理人进一步完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告。按照法律法规的要求，认真做好基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。同时定期不定期地组织合规培训，进一步加强对员工的合规教育。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会负责人为公司总经理，成员包括投资管理总部、运营保障总部、研究发展部、风控稽核总部等部门的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

截止本报告期末，本基金运作正常，无需预警说明。

## §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，中国光大银行股份有限公司在江信汇福定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了

全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

## 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《江信汇福定期开放债券型证券投资基金2022年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §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	大华审字[2023]001258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	江信汇福灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了江信汇福灵活配置混合型证券投资基金(以下简称江信汇福基金)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。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了江信汇福基金2022

	年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和现金流量。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于江信汇福基金，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。
强调事项	无
其他事项	江信汇福基金管理层对其他信息负责。其他信息包括《江信汇福灵活配置混合型证券投资基金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。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	江信汇福基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，江信汇福基金管理人负责评估江信汇福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，除非管理人计划清算江信汇福基金、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，

	<p>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：1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。2. 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。3. 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。4. 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对江信汇福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告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江信汇福基金不能持续经营。5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与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。我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施（如适用）。</p>	
会计师事务所的名称	大华会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈静	孟琪
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路16号院7号楼8层	
审计报告日期	2023-03-20	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：江信汇福定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	470,601.15	1,111,760.21
结算备付金		3,538,677.53	1,200,860.18
存出保证金		5,174.10	2,043.60
交易性金融资产	7.4.7.2	197,635,986.87	173,712,300.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		197,635,986.87	173,712,300.00
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	132,906,607.10	125,810,284.82
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	7.4.7.5	0.00	3,829,306.79
资产总计		334,557,046.75	305,666,555.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>

<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		112,262,449.58	91,100,000.00
应付清算款		-	42,178.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		112,867.69	108,955.69
应付托管费		18,811.29	36,318.53
应付销售服务费		56,433.82	54,477.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,554.14	14,478.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	182,843.00	49,767.01
负债合计		112,649,959.52	91,406,175.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	194,759,289.71	194,557,115.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	27,147,797.52	19,703,264.02
净资产合计		221,907,087.23	214,260,379.82
负债和净资产总计		334,557,046.75	305,666,555.60

## 7.2 利润表

会计主体：江信汇福定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、营业总收入		11,517,390.24	14,192,036.81

1.利息收入		5,175,251.86	13,525,992.12
其中：存款利息收入	7.4.7.9	63,395.76	97,884.60
债券利息收入		-	7,536,059.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,111,856.10	5,892,048.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,830,059.76	66,152.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	0.00	0.00
基金投资收益	7.4.7.11	0.00	0.00
债券投资收益	7.4.7.12	7,830,059.76	66,152.88
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,499,201.61	599,816.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,280.23	75.19
<b>减：二、营业总支出</b>		4,103,737.28	4,326,650.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,312,998.05	1,292,748.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	250,672.91	430,916.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	656,499.20	646,374.21
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,646,631.34	1,821,169.64
其中：卖出回购金融资产支出		1,646,631.34	1,821,169.64
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		19,735.78	16,840.55
8. 其他费用	7.4.7.19	217,200.00	118,601.87

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,413,652.96	9,865,386.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,413,652.96	9,865,386.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,413,652.96	9,865,386.10

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：江信汇福定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年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）	194,557,115.80	-	19,703,264.02	214,260,379.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	194,557,115.80	-	19,703,264.02	214,260,379.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	202,173.91	-	7,444,533.50	7,646,707.41
（一）、综合收益总额	-	-	7,413,652.96	7,413,652.96
（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）	202,173.91	-	30,880.54	233,054.45
其中：1.基金申购款	637,037.37	-	87,173.66	724,211.03
2.基金赎回款	-434,863.46	-	-56,293.12	-491,156.58

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	194,759,289.71	-	27,147,797.52	221,907,087.23
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)	201,739,554.77	-	10,494,688.19	212,234,242.96
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)	201,739,554.77	-	10,494,688.19	212,234,242.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,182,438.97	-	9,208,575.83	2,026,136.86
(一)、综合收益总额	-	-	9,865,386.10	9,865,386.10
(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)	-7,182,438.97	-	-656,810.27	-7,839,249.24
其中：1.基金申购款	70,605.33	-	5,136.23	75,741.56
2.基金赎回款	-7,253,044.30	-	-661,946.50	-7,914,990.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	194,557,115.80	-	19,703,264.02	214,260,379.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

焦毛

付明

刘健菲

-----

-----

-----

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

江信汇福定期开放债券型证券投资基金(简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")证监许可【2015】788号文《关于核准江信汇福定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由江信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,定期开放申购和赎回,首次设立募集不包括认购资金利息共募集223,100,487.07元,已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2016]000358号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年5月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为223,115,342.17份基金份额,其中认购资金利息折合14,855.10基金份额。本基金的基金管理人为江信基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的国债、中央银行票据、政策性金融债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、短期融资券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购、中期票据、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股股票所派发的权证和因投资可分离交易可转债而产生的权证等。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,本基金不受前述比例限制。开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券资产占基金资产净值的比例不低于5%,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等(在封闭期内,本基金不受此限制)。

本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的3个月期定期存款基准利率（税后） $\times 2$ 。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日，根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。

本财务报表由本基金的基金管理人江信基金管理有限公司于2023年03月30日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》和具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于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等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

本基金根据所管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以下三类：

- （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。
- （3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金以摊余成本计量的金融资产主要包括货币资金、买入返售金融资产等，本基金没有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

#### 2、金融负债的分类

本基金根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。

#### 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

##### 1、金融资产的初始确认、后续计量

金融资产在初始确认时以公允价值计量，但是因销售商品或提供服务等产生的应收账款或应收票据未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的融资成分的，按照交易价格进行初始计量。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益，其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

金融资产的后续计量取决于其分类，当且仅当本公司改变管理金融资产的业务模式时，才对所有受影响的相关金融资产进行重分类。

##### (1) 分类为以摊余成本计量的金融资产

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

本基金对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。除下列情况外，本基金根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本基金自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。

2) 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本基金在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，本基金转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

##### (2) 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

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，且管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标，则本基金将该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。

本基金对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入。除利息收入、减值损失及汇兑差额确认为当期损益外，其余公允价值变动计入其他综合收益。当该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

### (3) 指定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

在初始确认时，本基金可以单项金融资产为基础不可撤销地将非交易性权益工具投资指定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。

此类金融资产的公允价值变动计入其他综合收益，不需计提减值准备。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本基金持有该权益工具投资期间，在本基金收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本基金，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。本基金对此类金融资产在其他权益工具投资项目下列报。

权益工具投资满足下列条件之一的，属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：取得该金融资产的目的主要是为了近期出售；初始确认时属于集中管理的可辨认金融资产工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式；属于衍生工具（符合财务担保合同定义的以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外）。

### (4) 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

不符合分类为以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件、亦不指定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均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。

本基金对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本基金对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

### (5) 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

在初始确认时，本基金为了消除或显著减少会计错配，可以单项金融资产为基础不可撤销地将金融资产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。

混合合同包含一项或多项嵌入衍生工具，且其主合同不属于以上金融资产的，本基金可以将其整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。但下列情况除外：

- 1) 嵌入衍生工具不会对混合合同的现金流量产生重大改变。
- 2) 在初次确定类似的混合合同是否需要分拆时，几乎不需分析就能明确其包含的嵌入衍生工具不应分拆。如嵌入贷款的提前还款权，允许持有人以接近摊余成本的金额提前偿还贷款，该提前还款权不需要分拆。

本基金对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本基金对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

## 2、金融负债的初始确认、后续计量

金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

金融负债的后续计量取决于其分类：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此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）和初始确认时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。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始确认时，为了提供更相关的会计信息，本基金将满足下列条件之一的金融负债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负债：

1) 能够消除或显著减少会计错配。

2) 根据正式书面文件载明的企业风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在企业内部以此为基础向关键管理人员报告。

本基金对此类金融负债采用公允价值进行后续计量，除由本基金自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益之外，其他公允价值变动计入当期损益。除非由本基金自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配，本基金将所有公允价值变动（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

(2) 其他金融负债

除下列各项外，本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，对此类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益：

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

3) 不属于本条前两类情形的财务担保合同，以及不属于本条第1)类情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

财务担保合同是指当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求发行方向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。不属于指定为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，在初始确认后按照损失准备金额以及初始确认金额扣除担保期内的累计摊销额后的余额孰高进行计量。

### 3、金融资产和金融负债的终止确认

(1) 金融资产满足下列条件之一的，终止确认金融资产，即从其账户和资产负债表内予以转销：

- 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，且该转移满足金融资产终止确认的规定。

#### (2) 金融负债终止确认条件

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

本基金与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，或对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，则终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债，账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，计入当期损益。

本基金回购金融负债一部分的，按照继续确认部分和终止确认部分在回购日各自的公允价值占整体公允价值的比例，对该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，应当计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 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：

- (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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。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直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。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收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。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。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期末未发生外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 在交易所上市的有价证券（包括股票、可转换债券、权证等），根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，以收盘价估值，上市债券以收盘净价估值，期货合约以结算价格估值。交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。本基金以其估值日

在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价；交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括资产支持债券等），采用估值技术确定公允价值。如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

（2）在交易所发行的未上市品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，首次发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按本文附件确定公允价值。本基金分为以下几类进行估值：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4) 已经发行未上市期间的债券按以下原则处理：①交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。②对银行间市场未上市，且第三方未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用成本估值。③分离交易可转债，上市日前，按未上市有价证券估值原则分别对债券和获配的权证进行估值；自上市日起，债券和获配的权证按上市有价证券估值原则进行估值

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。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、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 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

根据《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号-金融资产转移》、《企业会计准则第24号-套期会计》、《企业会计准则第37号-金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求,本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:摊余成本;以公允价值计量且其变动计入其他综合收益;以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中,不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目,反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。

本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中,其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示

执行新金融工具准则对本期期初资产负债表相关项目的影响列示如下:

项目	2021年12月31日	累积影响金额			2022年1月1日
		分类和 计量影响 (注1)	金融资产 减值影响 (注2)	小计	
银行存款	1,111,760.21	1,609.10		1,609.10	1,113,369.31
结算备付金	1,200,860.18	594.44		594.44	1,201,454.62
存出保证金	2,043.60	0.99		0.99	2,044.59
交易性金融资产	173,712,300.00	3,710,959.75		3,710,959.75	177,423,259.75
买入返售金融资产	125,810,284.82	116,142.51		116,142.51	125,926,427.33

项目	2021 年 12 月 31 日	累积影响金额			2022 年 1 月 1 日
		分类和 计量影响 (注 1)	金融资产 减值影响 (注 2)	小计	
应收利息	3,829,306.79	-3,829,306.79		-3,829,306.79	
卖出回购金融资产	91,100,000.00	-31,633.84			91,068,366.16
应付利息	-31,633.84	31,633.84			

由于本基金本年度财务报表需采用中国证券监督管理委员会下发的“证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度和中期报告》（2022年08月26日）”报告模板，在该报告模板中，财务报表删除应收利息、应付利息、应付交易费用以及交易费用科目，故本基金本年度财务报表中上年度末的应收利息余额列入其他资产科目列报，上年度末的应付利息余额及应付交易费用余额列入其他负债科目列报，上年度可比期间的交易费用发生额列入其他费用科目列报，相应调整附注数据。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 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	470,601.15	1,111,760.21
等于：本金	470,456.80	1,111,760.21
加：应计利息	144.35	-
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	-	-
合计	470,601.15	1,111,760.21

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

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

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	126,058,981.31	2,095,155.36	127,475,755.36	-678,381.31
	银行间市场	68,802,538.00	1,110,931.51	70,160,231.51	246,762.00
	合计	194,861,519.31	3,206,086.87	197,635,986.87	-431,619.31
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		194,861,519.31	3,206,086.87	197,635,986.87	-431,619.31
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	132,714,717.70	-	133,166,300.00	451,582.30
	银行间市场	39,930,000.00	-	40,546,000.00	616,000.00
	合计	172,644,717.70	-	173,712,300.00	1,067,582.30
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		172,644,717.70	-	173,712,300.00	1,067,582.30

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2022年12月31日），本基金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	132,906,607.10	-
银行间市场	-	-
合计	132,906,607.10	-
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	95,930,000.00	-
银行间市场	29,880,284.82	-
合计	125,810,284.82	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2022年12月31日），本基金无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	-	3,829,306.79
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	0.00	3,829,306.79

本报告期末（2022年12月31日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）

#### 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	-	-
应付交易费用	2,843.00	1,400.85
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	2,843.00	1,400.85

应付利息	-	-31,633.84
预提费用	180,000.00	80,000.00
合计	182,843.00	49,767.01

#### 7.4.7.7 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,557,115.80	194,557,115.80
本期申购	637,037.37	637,037.37
本期赎回（以“-”号填列）	-434,863.46	-434,863.46
本期末	194,759,289.71	194,759,289.71

申购含红利再投份额。

#### 7.4.7.8 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	-2,165,339.79	21,868,603.81	19,703,264.02
本期利润	8,912,854.57	-1,499,201.61	7,413,652.96
本期基金份额交易产生的变动数	6,416.79	24,463.75	30,880.54
其中：基金申购款	12,834.29	74,339.37	87,173.66
基金赎回款	-6,417.50	-49,875.62	-56,293.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,753,931.57	20,393,865.95	27,147,797.52

#### 7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日

活期存款利息收入	29,569.43	54,986.67
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	33,760.87	42,668.23
其他	65.46	229.70
合计	63,395.76	97,884.60

注：本报告期内“其他”为结算保证金利息收入

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期末（2022年12月31日），本基金无股票投资收益。

#### 7.4.7.11 基金投资收益

本报告期末（2022年12月31日），本基金无股票投资收益。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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	7,952,020.77	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-121,961.01	66,152.88
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	7,830,059.76	66,152.88

##### 7.4.7.12.2 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	146,518,061.34	108,492,850.72

兑付)成交总额		
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	141,485,366.69	106,055,036.62
减: 应计利息总额	5,153,101.34	2,371,661.22
减: 交易费用	1,554.32	-
买卖债券差价收入	-121,961.01	66,152.88

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本报告期(2022年1月1日至2022年12月31日)本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期(2022年1月1日至2022年12月31日)本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期(2022年1月1日至2022年12月31日)本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本报告期(2022年1月1日至2022年12月31日)本基金无股利收益。

#### 7.4.7.17 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2 022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
1.交易性金融资产	-1,499,201.61	599,816.62
——股票投资	-	-
——债券投资	-1,499,201.61	599,816.62
——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	-1,499,201.61	599,816.62

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	120.23	75.19
其他	11,160.00	-
合计	11,280.23	75.19

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	100,000.00	-
帐户维护费	36,000.00	35,880.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
跨市场转托管手续费	-	1,000.00
交易费用	-	521.87
合计	217,200.00	118,601.87

### 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

截止本报告期期末（2022年12月31日），本基金无重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告日止，本公司无应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）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

关联方名称	与本基金的关系
国盛证券有限责任公司	本基金管理人股东。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金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 2022年01月01日至202 2年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,312,998.05	1,292,748.40
其中：支付销售机构的客户维护费	5,185.85	5,370.61

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提，基金管理费每日计算，逐日累计至每自然季度季末，按季支付。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年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	250,672.91	430,916.04

注：基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提，基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

**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
国盛证券有限责任公司	3,095.20
中国光大银行股份有限公司	1,972.18
江信基金管理有限公司	646,008.64
合计	651,076.02
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
国盛证券有限责任公司	5,689.64
中国光大银行股份有限公司	1,902.68
江信基金管理有限公司	632,691.78
合计	640,284.10

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E前一日基金资产净值

**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**

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金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 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	5,095,801.06
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	5,095,801.06
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

本报告期末（2022年12月31日），除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年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
中国光大银行股份有限公司	470,601.15	29,569.43	1,111,760.21	54,986.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）本基金无利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额19,006,740.65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
102281055	22中化股MTN002	2023-01-05	101.02	100,000	10,102,397.26
102281208	22中电投MTN016	2023-01-05	101.42	100,000	10,142,057.53
合计				200,000	20,244,454.79

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额93,255,708.93元，于2023年1月3日、2023年1月5日、2023年1月6日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式

回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人风险管理组织体系由三级构成：第一级次为董事会层面的合规与风险管理委员会、督察长；第二级次为经营层面的总经理、风险控制委员会、风控稽核总部；第三级次为公司各业务部门对各自部门的风险控制负责。

本基金的基金管理人主要采取定量和定性相结合的方法。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在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。

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信用风险。通过内部信用评级制度，结合外部信用评级，进行信用风险管理；根据交易对手的资质、交易记录、信用记录和交收违约记录等因素对交易对手进行信用评级。

于2022年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为64.75%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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	19,416,119.18	19,992,000.00
合计	19,416,119.18	19,992,000.00

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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	81,466,405.49	30,556,000.00
AAA以下	42,801,719.18	41,342,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	124,268,124.67	71,898,000.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中无国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低

成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放期内投资人的连续大量赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

#### 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开放期内为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。因此除附注十二中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本期末（2022年12月31日），除卖出回购金融资产款余额中有112,199,771.50元将在1个月以到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的金融负债的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(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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是由于市场条件（包括但不限于利率、汇率、股票价格和商品价格等因素）发生不利变化，给公司或客户投资带来损失的风险。其中利率水平的变动，将直接影响到基金拟投资债券、利率及债券衍生品等投资品种的价格波动，进而影响基金的收益水平。股票、商品的市场价格变化，将直接作用于股票及股票衍生金融工具、商品及商品衍生工具的市场价格。而当所投资基金在持有的资产组合或金融工具暴露于某外汇币种的情形下，将会可能受到外汇价格变化导致的折价损失，即汇率风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金部分投资于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 2022年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	470,601.15	-	-	-	470,601.15
结算备付金	3,538,677.53	-	-	-	3,538,677.53
存出保证金	5,174.10	-	-	-	5,174.10
交易性金融资产	70,257,020.56	114,084,697.27	13,294,269.04	-	197,635,986.87
买入返售金融资产	132,906,607.10	-	-	-	132,906,607.10
资产总计	207,178,080.44	114,084,697.27	13,294,269.04	-	334,557,046.75
负债					
卖出回购金融资产款	112,262,449.58	-	-	-	112,262,449.58
应付管理人报酬	-	-	-	112,867.69	112,867.69
应付托管费	-	-	-	18,811.29	18,811.29
应付销售服务费	-	-	-	56,433.82	56,433.82
应交税费	-	-	-	16,554.14	16,554.14
其他负债	-	-	-	182,843.00	182,843.00
负债总计	112,262,449.58	-	-	387,509.94	112,649,959.52
利率敏感度缺口	94,915,630.86	114,084,697.27	13,294,269.04	-387,509.94	221,907,087.23
上年度末 2021年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,111,760.21	-	-	-	1,111,760.21
结算备付金	1,200,860.18	-	-	-	1,200,860.18
存出保证金	2,043.60	-	-	-	2,043.60
交易性金融	77,056,300.00	76,476,000.00	20,180,000.00	-	173,712,300.00

资产					
买入返售金融资产	125,810,284.82	-	-	-	125,810,284.82
应收利息	-	-	-	3,829,306.79	3,829,306.79
资产总计	205,181,248.81	76,476,000.00	20,180,000.00	3,829,306.79	305,666,555.60
负债					
卖出回购金融资产款	91,100,000.00	-	-	-	91,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	42,178.46	42,178.46
应付管理人报酬	-	-	-	108,955.69	108,955.69
应付托管费	-	-	-	36,318.53	36,318.53
应付销售服务费	-	-	-	54,477.85	54,477.85
应付交易费用	-	-	-	1,400.85	1,400.85
应交税费	-	-	-	14,478.24	14,478.24
应付利息	-	-	-	-31,633.84	-31,633.84
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	91,100,000.00	-	-	306,175.78	91,406,175.78
利率敏感度缺口	114,081,248.81	76,476,000.00	20,180,000.00	3,523,131.01	214,260,379.82

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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
	市场利率上升25.00bp	-848,203.59	-625,851.79
	市场利率下降25.00bp	860,192.00	631,595.58

#### 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。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。在开放期内本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前十个工作日、开放期及开放期结束后十个工作日的期间内，本基金不受前述比例限制。

开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券资产占基金资产净值的比例不低于5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等（在封闭期内，本基金不受此限制）。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末（2022年12月31日），本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他价格风险敞口。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末（2021年12月31日），本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(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

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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	197,635,986.87	173,712,300.00
第三层次	-	-
合计	197,635,986.87	173,712,300.00

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本报告期内，本基金不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本报告期内，本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值不存在第三层级。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期内，本基金不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本报告期内，本基金不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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

3	固定收益投资	197,635,986.87	59.07
	其中：债券	197,635,986.87	59.07
	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	132,906,607.10	39.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,009,278.68	1.20
8	其他各项资产	5,174.10	0.00
9	合计	334,557,046.75	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本期末，本基金未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本期末，本基金未持有港股通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本期末，本基金未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本期末，本基金未持有股票。

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

本期末，本基金未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本期末，本基金未持有股票。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	38,555,410.14	17.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,396,332.88	6.94
	其中：政策性金融债	15,396,332.88	6.94
4	企业债券	73,524,012.34	33.13
5	企业短期融资券	19,416,119.18	8.75
6	中期票据	50,744,112.33	22.87
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	197,635,986.87	89.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019643	20国债13	200,000	20,431,490.41	9.21
2	102002093	20中建四局M TN002	200,000	20,341,726.03	9.17
3	018008	国开1802	150,000	15,396,332.88	6.94
4	019679	22国债14	150,000	15,102,842.47	6.81
5	152286	19西峡债	150,000	12,207,061.64	5.50

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

本报告期本基金无资产支持证券投资。

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

本期末本基金未持有贵金属。

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

本期末本基金未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本期末本基金未持有国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，除以下证券外，本基金投资的前十名其他证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

1、本基金持有的国开1802（代码：018008.SH）的发行主体为国家开发银行，2022年3月21日中国银行保险监督管理委员会对其采取罚款的行政处罚（银保监罚决字〔2022〕8号）。

2、本基金持有的21国君G3（代码：188127.SH）的发行主体为国泰君安证券股份有限公司，2022年1月12日中国证券监督管理委员会对其采取出具警示函的监管措施；2022年11月9日中国证券监督管理委员会对其采取责令改正的监管措施。

3、本基金持有的21招证G7（代码：188482.SH）的发行主体为招商证券股份有限公司，2022年4月1日中国证券监督管理委员会深圳监管局对其采取责令改正的行政监管措施（行政监管措施决定书(2022)47号）；2022年6月23日中国证券监督管理委员会对其采取出具警示函的行政监管措施；2022年8月3日中国证券监督管理委员会对其采取改正违法行为、没收业务收入、罚款的行政处罚（处罚字〔2022〕143号）；2022年8月3日中国证券监督管理委员会深圳监管局对其采取出具警示函的监管措施（行政监管措施决定书(2022)123号）；2022年9月19日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 0382022020 号）及《行政处罚决定书》（〔2022〕50号）；2022年11月9日中国证券监督管理委员会对其采取出具警示函的监管措施。

8.12.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	5,174.10
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	5,174.10

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
698	279,024.77	191,332,631.78	98.24%	3,426,657.93	1.76%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	39,311.29	0.02%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研部	0~10

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年05月05日)基金份额总额	223,115,342.17
本报告期期初基金份额总额	194,557,115.80
本报告期基金总申购份额	637,037.37
减：本报告期基金总赎回份额	434,863.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	194,759,289.71

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，本基金管理人于2022年11月聘任焦毛先生担任总经理。本基金管理人于2022年6月聘任原亮先生、汪鹏先生为副总经理，聘任郑清丽女士为副总经理兼任财务负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的大华会计师事务所（特殊普通合伙）为第七年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的审计费为人民币捌万（80,000.00）元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 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	
		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
民族证券	1	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	27,296,010.00	15.23%	2,441,506,500.00	31.99%	-	-	-	-
长城证券	10,076,950.00	5.62%	391,778,500.00	5.13%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	88,315,000.00	1.16%	-	-	-	-
恒泰证券	69,456,900.00	38.76%	1,318,500,000.00	17.28%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	72,376,720.30	40.39%	1,890,329,000.00	24.77%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	1,501,179,300.00	19.67%	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2021年第四季度报告	网站	2022-01-24
2	江信基金2021年第四季度报告提示性公告	证券日报	2022-01-24
3	江信汇福定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告(2022年2月)	网站、证券日报	2022-02-14
4	关于江信基金管理有限公司旗下部分基金降低管理费率和托管费率并修改基金合同和托管协议的公告	网站、证券日报	2022-02-21
5	江信汇福基金合同（2022年2月更新）	网站	2022-02-21
6	江信汇福托管协议（2022年2月更新）	网站	2022-02-21
7	江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（2022年第1次）	网站	2022-02-24
8	江信汇福定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新（2022年第1号）	网站	2022-02-24
9	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2021年年度报告	网站	2022-03-29
10	江信基金2021年年度报告提示性公告	证券日报	2022-03-29
11	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2022年第一季度报告	网站	2022-04-22
12	江信基金2022年第一季度报告提示性公告	证券日报	2022-04-22
13	江信基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司销售旗下基金的公告	网站、证券日报	2022-05-12
14	江信汇福定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告(2022年5月)	网站、证券日报	2022-05-13
15	江信基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司销售旗下基金的公告	网站、证券日报	2022-05-13
16	江信基金管理有限公司增聘副总经理的公告	网站、证券日报	2022-06-13
17	江信基金管理有限公司增聘副总经理的公告	网站、证券日报	2022-06-13
18	江信基金管理有限公司增聘副总经理兼财务	网站、证券日报	2022-06-13

	负责人的公告		
19	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2022年第二季度报告	网站	2022-07-20
20	江信基金2022年第二季度报告提示性公告	证券日报	2022-07-20
21	江信汇福定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告(2022年8月)	网站、证券日报	2022-08-15
22	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2022年中期报告	网站	2022-08-30
23	江信基金2022年中期报告提示性公告	证券日报	2022-08-30
24	江信汇福定期开放债券型证券投资基金2022年第三季度报告	网站	2022-10-25
25	江信基金2022年第三季度报告提示性公告	证券日报	2022-10-25
26	江信基金管理有限公司总经理变更公告	网站、证券日报	2022-11-04
27	江信汇福定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告(2022年11月)	网站、证券日报	2022-11-14

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20221231	191,332,631.78	0.00	0.00	191,332,631.78	98.24%
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《江信汇福定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《江信汇福定期开放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和营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.jxfund.cn>。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

江信基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十日