

平安合正定期开放纯债债券型发起式证券  
投资基金  
2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 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。

基金托管人平安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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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                | 12        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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 | 13        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>13</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 13        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 13        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>15</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 15        |
| 7.2 利润表                                 | 17        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 18        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                            | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                               | 47        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                         | 48        |
| 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            | 48        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                          | 48        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                         | 48        |
| 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           | 48        |
| 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        | 49        |
| 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        | 49        |
| 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           | 49        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                    | 49        |
| 8.11 投资组合报告附注                                | 49        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b>                         | <b>52</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                        | 52        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                     | 53        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况             | 53        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 | 53        |
| 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况                          | 53        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b>                        | <b>53</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b>                           | <b>54</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议                             | 54        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动             | 54        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼                  | 54        |
| 11.4 基金投资策略的改变                               | 54        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况                        | 54        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况                | 54        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况                       | 54        |
| 11.8 其他重大事件                                  | 58        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>                   | <b>60</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况           | 60        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息                          | 60        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b>                           | <b>60</b> |
| 13.1 备查文件目录                                  | 60        |
| 13.2 存放地点                                    | 61        |
| 13.3 查阅方式                                    | 61        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                                                                                       |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金                                                                                                                                                                |
| 基金简称       | 平安合正定开债                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 005127                                                                                                                                                                                |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（含）或自每一开放期结束之日次日起（含）至 3 个月（含）后对应日的前一日止（若该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一工作日）。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起（含）进入开放期，本基金每个开放期最长不超过 10 个工作日，最短不少于 5 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。 |
| 基金合同生效日    | 2018 年 1 月 19 日                                                                                                                                                                       |
| 基金管理人      | 平安基金管理有限公司                                                                                                                                                                            |
| 基金托管人      | 平安银行股份有限公司                                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 935,476,546.02 份                                                                                                                                                                      |
| 基金合同存续期    | 不定期                                                                                                                                                                                   |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                     |
| 投资策略   | 本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用，主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，深入挖掘价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合。本基金将灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，获得债券市场的整体回报率及超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（总财富）                                                                                                                                                                                                |
| 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          |      | 平安基金管理有限公司                      | 平安银行股份有限公司                         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陈特正                             | 李帅帅                                |
|             | 联系电话 | 0755-22626828                   | 0755-25878287                      |
|             | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn       | LISHUAI130@pingan.com.cn           |
| 客户服务电话      |      | 400-800-4800                    | 95511-3                            |
| 传真          |      | 0755-23997878                   | 0755-82080387                      |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号               |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼 |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 518048 | 518001 |
| 法定代表人 | 罗春风    | 谢永林    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                     |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                                                                |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层                                     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                            |
|--------|----------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼     |
| 注册登记机构 | 平安基金管理有限公司           | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 |

# § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年         | 2021 年         | 2020 年           |
|---------------|----------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 20,901,266.02  | 91,995,500.12  | 147,370,597.46   |
| 本期利润          | 16,702,245.98  | 96,978,254.04  | 121,274,508.55   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0179         | 0.0407         | 0.0413           |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.73%          | 3.92%          | 3.90%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.76%          | 3.95%          | 4.01%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末        | 2021 年末        | 2020 年末          |
| 期末可供分配利润      | 32,886,923.84  | 11,985,659.89  | 79,918,006.62    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0352         | 0.0128         | 0.0272           |
| 期末基金资产净值      | 969,982,521.70 | 953,280,383.80 | 3,035,051,323.02 |
| 期末基金份额净值      | 1.0369         | 1.0190         | 1.0339           |

| 3.1.3 累计<br>期末指标    | 2022 年末 | 2021 年末 | 2020 年末 |
|---------------------|---------|---------|---------|
| 基金份额累<br>计净值增长<br>率 | 23.92%  | 21.78%  | 17.16%  |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 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，而非当期发生数）；

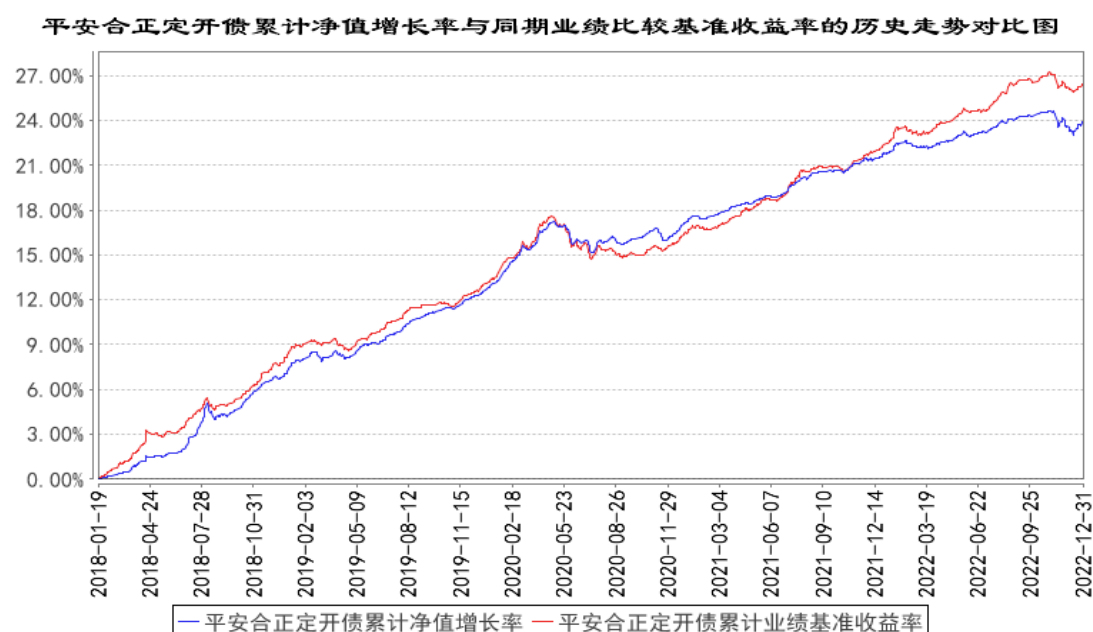
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 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<br>值增长<br>率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.28%           | 0.09%               | -0.02%         | 0.08%                 | -0.26% | 0.01%  |
| 过去六个月          | 0.55%            | 0.07%               | 1.45%          | 0.06%                 | -0.90% | 0.01%  |
| 过去一年           | 1.76%            | 0.06%               | 3.31%          | 0.06%                 | -1.55% | 0.00%  |
| 过去三年           | 10.01%           | 0.06%               | 11.80%         | 0.07%                 | -1.79% | -0.01% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 23.92%           | 0.06%               | 26.46%         | 0.07%                 | -2.54% | -0.01% |

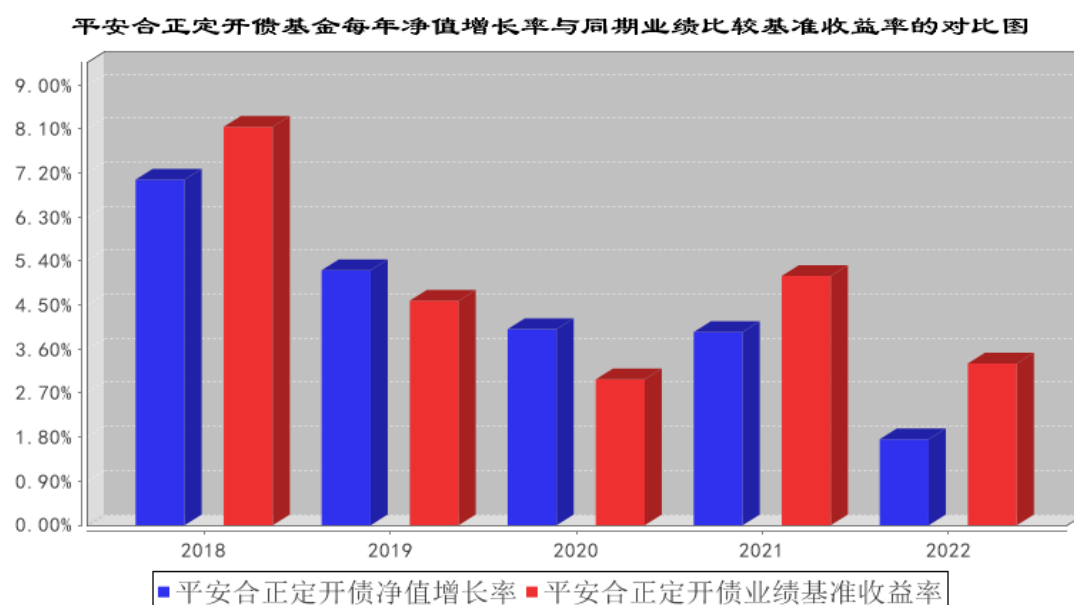
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2018 年 1 月 19 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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



注：本基金合同于 2018 年 01 月 19 日正式生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分<br>红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总<br>额 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|-------------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2022 年 | -                 | -              | -             | -              | -  |
| 2021 年 | 0.5500            | 148,451,138.59 | -             | 148,451,138.59 | -  |
| 2020 年 | 0.4000            | 116,974,428.75 | 427,977.46    | 117,402,406.21 | -  |
| 合计     | 0.9500            | 265,425,567.34 | 427,977.46    | 265,853,544.80 | -  |

## § 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2022 年 12 月 31 日，平安基金共管理 181 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5080.52 亿元人民币。

#### 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                   |
|----|----------------------------|----------------------|------|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                            | 任职日期                 | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                      |
| 唐煜 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2022 年 11 月 15 日     | -    | 7 年        | 唐煜先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任广发银行股份有限公司资产管理部固定收益处投资经理、太平洋资产管理有限公司固定收益部固定收益经理、西部利得基金管理有限公司公募投资部基金经理。2022 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现任平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠智纯债债券型证券投资基金基金经理。 |
| 盛豪 | 平安合正                       | 2022 年               | -    | 6 年        | 盛豪杰先生，清华大学金融学专业硕士，                                                                                                                                                   |

|    |                            |                |                  |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|----|----------------------------|----------------|------------------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 杰  | 定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理助理   | 12 月 16 日      |                  |      | 曾担任广发基金管理有限公司研究员。2020 年 8 月加入平安基金管理有限公司，现担任固定收益投资中心高级研究员，同时担任平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠智纯债债券型证券投资基金基金经理助理。                                                                                                                                                                 |
| 张恒 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2018 年 2 月 2 日 | 2022 年 11 月 18 日 | 11 年 | 张恒先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015 年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资部投资经理。现任平安惠添纯债债券型证券投资基金、平安中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、平安季季享 3 个月持有期债券型证券投资基金、平安鑫瑞混合型证券投资基金、平安惠盈纯债债券型证券投资基金、平安稳健增长混合型证券投资基金、平安双季盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,严格执行法律法规及制度要求,从以下五个方面对交易行为进行严格控制:一是搭建平等的投资信息平台,合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则,建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,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。四是明确报告制度和路线,根据法规及公司内部要求,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估,形成分析报告,由法律合规监察部、督察长、总经理签署后,妥善保存备查,如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为,及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口,对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析,各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差,不存在不公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,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%。

## 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 年前三季度,经济下行压力较大,地产销售疲弱,疫情反复导致消费进一步走弱。但四季度开始稳增长诉求较强,防疫政策调整,地产政策持续加码,财政货币政策持续发力。四季度

经济增长预期修复。具体看，2022 年，收益率先下后上，收益率曲线平坦化。信用债有所调整，信用利差整体走阔。

报告期内本产品以利率债和商金债投资为主，赚取稳定票息和骑乘收益的同时，结合市场环境动态调整组合久期和杠杆，力争增强组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0369 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

#### 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。经济修复，通胀存在抬头可能。实体信贷需求回暖，资金从宽松走向收敛，资金分层加剧。

经济修复，通胀抬头，资金收敛，整体呈现对利率不利局面。

组合操作以防守反击思路为主。

#### 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，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，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

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关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相

关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

**4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

**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**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

**§ 6 审计报告**

**6.1 审计报告基本信息**

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2023)第 20374 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 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金全体基金 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 审计意见            | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“平安合正定开债基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了平安合正定开债基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安合正定开债基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                         |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 其他信息            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>平安合正定开债基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安合正定开债基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安合正定开债基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安合正定开债基金的财务报告过程。</p>                                    |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p>                                                                                                                                                                   |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安合正定开债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平安合正定开债基金不能持续经营。</p> <p>（五） 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |
| 注册会计师的姓名  | 郭素宏                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 李崇 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    |
| 审计报告日期    | 2023 年 3 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产   | 附注号     | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：  |         |                         |                          |
| 银行存款  | 7.4.7.1 | 914,275.74              | 1,465,992.93             |
| 结算备付金 |         | 228,159.04              | 7,773,667.31             |

|               |            |                                 |                                  |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金         |            | 2,537.63                        | 575,502.84                       |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 1,338,461,404.72                | 1,078,254,000.00                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 1,338,461,404.72                | 1,078,254,000.00                 |
| 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    | -                               | -                                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | 19,845,751.65                    |
| 资产总计          |            | 1,339,606,377.13                | 1,107,914,914.73                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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     |            | 369,060,015.30                  | 153,999,569.00                   |
| 应付清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 246,290.92                      | 242,247.05                       |
| 应付托管费         |            | 82,096.97                       | 80,749.01                        |
| 应付销售服务费       |            | -                               | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | -                               | 40,840.95                        |
| 应付利润          |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                               | -                                |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 235,452.24                      | 271,124.92                       |
| 负债合计          |            | 369,623,855.43                  | 154,634,530.93                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 935,476,546.02                  | 935,476,651.00                   |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                               | -                                |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 34,505,975.68                   | 17,803,732.80                    |



|          |  |                  |                  |
|----------|--|------------------|------------------|
| 净资产合计    |  | 969,982,521.70   | 953,280,383.80   |
| 负债和净资产总计 |  | 1,339,606,377.13 | 1,107,914,914.73 |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0369 元，基金份额总额 935,476,546.02 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 22,672,894.52                             | 112,739,534.81                                 |
| 1. 利息收入                |          | 692,120.33                                | 105,067,719.78                                 |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13 | 63,704.87                                 | 428,941.51                                     |
| 债券利息收入                 |          | -                                         | 98,964,520.34                                  |
| 资产支持证券利息收入             |          | -                                         | 2,565,101.21                                   |
| 买入返售金融资产收入             |          | 628,415.46                                | 3,109,156.72                                   |
| 证券出借利息收入               |          | -                                         | -                                              |
| 其他利息收入                 |          | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 26,179,794.23                             | 2,689,061.10                                   |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14 | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                 |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15 | 26,179,794.23                             | 2,689,061.10                                   |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.16 | -                                         | -                                              |
| 收益                     |          | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17 | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18 | -                                         | -                                              |
| 股利收益                   | 7.4.7.19 | -                                         | -                                              |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |          | -                                         | -                                              |
| 其他投资收益                 |          | -                                         | -                                              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | -4,199,020.04                             | 4,982,753.92                                   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.21 | -                                         | 0.01                                           |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 5,970,648.54                              | 15,761,280.77                                  |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2.1 | 2,894,409.36  | 7,472,669.74  |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 964,803.09    | 2,490,889.86  |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 投资顾问费            |            | -             | -             |
| 5. 利息支出             |            | 1,875,783.96  | 5,135,835.20  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 1,875,783.96  | 5,135,835.20  |
| 6. 信用减值损失           | 7.4.7.22   | -             | -             |
| 7. 税金及附加            |            | 6,452.13      | 295,471.03    |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.23   | 229,200.00    | 366,414.94    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 16,702,245.98 | 96,978,254.04 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 16,702,245.98 | 96,978,254.04 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -             | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 16,702,245.98 | 96,978,254.04 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |        |               |                |
|-----------------|----------------------------------------|--------|---------------|----------------|
|                 | 实收基金                                   | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 935,476,651.00                         | -      | 17,803,732.80 | 953,280,383.80 |
| 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) | 935,476,651.00                         | -      | 17,803,732.80 | 953,280,383.80 |
| 三、本期增减变         | -104.98                                | -      | 16,702,242.88 | 16,702,137.90  |

|                                          |                |   |               |                |
|------------------------------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 动额(减少以“-”号填列)                            |                |   |               |                |
| (一)、综合收益总额                               | -              | - | 16,702,245.98 | 16,702,245.98  |
| (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)      | -104.98        | - | -3.10         | -108.08        |
| 其中:1.基金申购款                               | 3.84           | - | 0.12          | 3.96           |
| 2.基金赎回款                                  | -108.82        | - | -3.22         | -112.04        |
| (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)                          | 935,476,546.02 | - | 34,505,975.68 | 969,982,521.70 |
| 项目                                       | 上年度可比期间        |   |               |                |

|                                     | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |        |                 |                   |
|-------------------------------------|----------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
|                                     | 实收基金                             | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 2,935,474,741.73                 | -      | 99,576,581.29   | 3,035,051,323.02  |
| 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)                     | 2,935,474,741.73                 | -      | 99,576,581.29   | 3,035,051,323.02  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -1,999,998,090.73                | -      | -81,772,848.49  | -2,081,770,939.22 |
| (一)、综合收益总额                          | -                                | -      | 96,978,254.04   | 96,978,254.04     |
| (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) | -1,999,998,090.73                | -      | -30,299,963.94  | -2,030,298,054.67 |
| 其中:1.基金申购款                          | 2,105.07                         | -      | 38.87           | 2,143.94          |
| 2.基金赎回款                             | -2,000,000,195.80                | -      | -30,300,002.81  | -2,030,300,198.61 |
| (三)、                                | -                                | -      | -148,451,138.59 | -148,451,138.59   |

|                                      |                |   |               |                |
|--------------------------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 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)                      | 935,476,651.00 | - | 17,803,732.80 | 953,280,383.80 |

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：

罗春风

林婉文

张南南

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

平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(原名为平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1480号《关于准予平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币509,999,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0035号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年1月19

日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 509,999,000.00 份基金份额，无认购资金利息份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

根据《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(包括基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(包括该日)3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起至 3 个月后的对应日前一日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 3 个月后的对应日前一日的期间，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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(协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、现金以及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，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。本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%，但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，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%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数(总财富)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

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

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

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

## (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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。

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

## (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

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



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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

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

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；

对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算

的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

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

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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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和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确认。

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金的收益分配政策为：(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(红利再投资不受封闭期限制)；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该类基金份额净值减去该类基金份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 每份基金份额享有同等分配权；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 1,465,992.93 元、7,773,667.31 元、575,502.84 元和 19,845,751.65 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 1,466,845.20 元、7,777,165.41 元、575,761.84 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,078,254,000.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,098,095,142.28 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 153,999,569.00 元、242,247.05 元、80,749.01 元、36,874.31 元和 15,250.61 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 154,014,819.61 元、242,247.05 元、80,749.01 元、36,874.31 元和 0.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

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

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 活期存款   | 914,275.74         | 1,465,992.93        |
| 等于：本金  | 913,838.34         | 1,465,992.93        |
| 加：应计利息 | 437.40             | —                   |
| 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             | 914,275.74 | 1,465,992.93 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>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 | 49,778,883.56            | 530,958.91    | 50,175,958.91    | -133,883.56   |
|               | 银行间市场 | 1,278,480,544.76         | 16,263,045.81 | 1,288,285,445.81 | -6,458,144.76 |
|               | 合计    | 1,328,259,428.32         | 16,794,004.72 | 1,338,461,404.72 | -6,592,028.32 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                        | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                        | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 1,328,259,428.32         | 16,794,004.72 | 1,338,461,404.72 | -6,592,028.32 |
| 项目            |       | 上年度末<br>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 | 20,002,542.47            | -             | 19,466,000.00    | -536,542.47   |
|               | 银行间市场 | 1,060,644,465.81         | -             | 1,058,788,000.00 | -1,856,465.81 |
|               | 合计    | 1,080,647,008.28         | -             | 1,078,254,000.00 | -2,393,008.28 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                        | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                        | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 1,080,647,008.28         | -             | 1,078,254,000.00 | -2,393,008.28 |



**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**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

**7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**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**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息  | -                       | 19,845,751.65            |
| 其他应收款 | -                       | -                        |
| 待摊费用  | -                       | -                        |
| 合计    | -                       | 19,845,751.65            |

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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      | 34,452.24               | 36,874.31                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 34,452.24               | 36,874.31                |
| 应付利息        | -                       | 15,250.61                |
| 预提费用        | 201,000.00              | 219,000.00               |
| 合计          | 235,452.24              | 271,124.92               |

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 935,476,651.00                         | 935,476,651.00 |
| 本期申购          | 3.84                                   | 3.84           |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -108.82                                | -108.82        |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                      | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                      | -              |
| 本期申购          | -                                      | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -              |
| 本期末           | 935,476,546.02                         | 935,476,546.02 |

注：根据《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告》的相关规定，本基金的运作周期为自 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效）起或自每一自由开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间。本基金自运作周期结束之后第一个工作日起进入自由开放期，每个自由开放期为 5 至 10 个工作日。在自由开放期间本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | 11,985,659.89 | 5,818,072.91  | 17,803,732.80 |
| 本期利润           | 20,901,266.02 | -4,199,020.04 | 16,702,245.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2.07         | -1.03         | -3.10         |
| 其中：基金申购款       | 0.08          | 0.04          | 0.12          |
| 基金赎回款          | -2.15         | -1.07         | -3.22         |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 32,886,923.84 | 1,619,051.84  | 34,505,975.68 |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 60,676.28                   | 133,325.06                       |
| 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 | 2,046.72                    | 291,319.98                       |
| 其他        | 981.87                      | 4,296.47                         |
| 合计        | 63,704.87                   | 428,941.51                       |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息 | 29,664,351.24               | -                                |

|                                      |               |              |
|--------------------------------------|---------------|--------------|
| 收入                                   |               |              |
| 债券投资收益——买卖<br>债券（债转股及债券到<br>期兑付）差价收入 | -3,484,557.01 | 2,689,061.10 |
| 债券投资收益——赎回<br>差价收入                   | -             | -            |
| 债券投资收益——申购<br>差价收入                   | -             | -            |
| 合计                                   | 26,179,794.23 | 2,689,061.10 |

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券<br>到期兑付）成交总额   | 4,117,154,929.82                | 11,182,901,517.18                    |
| 减：卖出债券（债转股及<br>债券到期兑付）成本总额 | 4,071,555,898.61                | 11,034,845,830.42                    |
| 减：应计利息总额                   | 49,028,048.32                   | 145,366,625.66                       |
| 减：交易费用                     | 55,539.90                       | -                                    |
| 买卖债券差价收入                   | -3,484,557.01                   | 2,689,061.10                         |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

单位：人民币元

| 项目                 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|--------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总<br>额   | -                               | 158,038,390.80                       |
| 减：卖出资产支持证券成本<br>总额 | -                               | 154,500,000.00                       |
| 减：应计利息总额           | -                               | 3,538,390.80                         |

|            |   |      |
|------------|---|------|
| 减：交易费用     | - | -    |
| 资产支持证券投资收益 | - | 0.00 |

#### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.17 贵金属投资收益

#### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

### 7.4.7.18 衍生工具收益

#### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

### 7.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -4,199,020.04                             | 4,982,753.92                                   |
| 股票投资       | -                                         | -                                              |
| 债券投资       | -4,199,020.04                             | 4,982,753.92                                   |
| 资产支持证券投资   | -                                         | -                                              |
| 基金投资       | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资      | -                                         | -                                              |
| 其他         | -                                         | -                                              |

|                        |               |              |
|------------------------|---------------|--------------|
| 2. 衍生工具                | -             | -            |
| 权证投资                   | -             | -            |
| 3. 其他                  | -             | -            |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -             | -            |
| 合计                     | -4,199,020.04 | 4,982,753.92 |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                      | 0.01                                        |
| 合计      | -                                      | 0.01                                        |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费计入基金财产的比例根据《平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》确定。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用    | 72,000.00                              | 90,000.00                                   |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                  |
| 证券出借违约金 | -                                      | -                                           |
| 账户维护费   | 36,000.00                              | 34,950.00                                   |
| 其他      | 1,200.00                               | 1,200.00                                    |
| 交易费用    | -                                      | 120,264.94                                  |
| 合计      | 229,200.00                             | 366,414.94                                  |

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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             |
|--------------------|---------------------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 基金托管人               |

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 大华资产管理有限公司               | 基金管理人的股东      |
| 三亚盈湾旅业有限公司               | 基金管理人的股东      |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东      |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)   | 基金管理人的子公司     |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”) | 基金管理人的最终控股母公司 |

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

##### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,894,409.36                           | 7,472,669.74                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                                      | -                                           |

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}。$$

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

|                | 月 31 日     | 12 月 31 日    |
|----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 964,803.09 | 2,490,889.86 |

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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

注：本基金本报告期内及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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

##### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）持有的基金份额 | —                                      | —                                           |
| 报告期初持有的基金份额                     | 11,114,022.88                          | 11,114,022.88                               |
| 报告期内申购/买入总份额                    | 0.00                                   | 0.00                                        |
| 报告期内因拆分变动份额                     | 0.00                                   | 0.00                                        |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                  | 0.00                                   | 0.00                                        |
| 报告期末持有的基金份额                     | 11,114,022.88                          | 11,114,022.88                               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 1.1881%                                | 1.1881%                                     |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。



2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

注：无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |            |
|---------|----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------|------------|
|         | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                        | 当期利息收入     |
| 平安银行-活期 | 914,275.74                             | 60,676.28 | 1,465,992.93                                | 133,325.06 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

注：本基金本期末无因认购新发/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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 369,060,015.30 元，是以如下债券作为抵押：

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         |
|--------|------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 200407 | 20 农发 07   | 2023 年 1 月 3 日 | 101.75 | 600,000   | 61,049,490.41  |
| 220017 | 22 付息国债 17 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.48  | 800,000   | 79,580,847.83  |
| 220019 | 22 付息国债 19 | 2023 年 1 月 3 日 | 98.64  | 2,000,000 | 197,272,486.19 |

|         |                   |                |        |           |                |
|---------|-------------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 220203  | 22 国开 03          | 2023 年 1 月 3 日 | 101.87 | 198,000   | 20,169,853.15  |
| 220404  | 22 农发 04          | 2023 年 1 月 3 日 | 100.91 | 30,000    | 3,027,320.55   |
| 2228037 | 22 交通银行<br>小微债 01 | 2023 年 1 月 3 日 | 101.28 | 281,000   | 28,460,642.33  |
| 合计      |                   |                |        | 3,909,000 | 389,560,640.46 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本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由金融工具产生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持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 100.74%（上年末：18.58%）。

### 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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 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》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，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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 7.4.12。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 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内

可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                    | 914,275.74     | -              | -              | -          | 914,275.74       |
| 结算备付金                   | 228,159.04     | -              | -              | -          | 228,159.04       |
| 存出保证金                   | 2,537.63       | -              | -              | -          | 2,537.63         |
| 交易性金融资产                 | 84,292,535.89  | 977,315,534.81 | 276,853,334.02 | -          | 1,338,461,404.72 |
| 资产总计                    | 85,437,508.30  | 977,315,534.81 | 276,853,334.02 | -          | 1,339,606,377.13 |
| 负债                      |                |                |                |            |                  |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -              | 246,290.92 | 246,290.92       |
| 应付托管费                   | -              | -              | -              | 82,096.97  | 82,096.97        |
| 卖出回购金融资产款               | 369,060,015.30 | -              | -              | -          | 369,060,015.30   |
| 其他负债                    | -              | -              | -              | 235,452.24 | 235,452.24       |

|                          |                 |                |                |               |                  |
|--------------------------|-----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 负债总计                     | 369,060,015.30  | -              | -              | 563,840.13    | 369,623,855.43   |
| 利率敏感度缺口                  | -283,622,507.00 | 977,315,534.81 | 276,853,334.02 | -563,840.13   | 969,982,521.70   |
| 上年度末<br>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                     | 1,465,992.93    | -              | -              | -             | 1,465,992.93     |
| 结算备付金                    | 7,773,667.31    | -              | -              | -             | 7,773,667.31     |
| 存出保证金                    | 575,502.84      | -              | -              | -             | 575,502.84       |
| 交易性金融资产                  | 239,839,000.00  | 565,403,000.00 | 273,012,000.00 | -             | 1,078,254,000.00 |
| 其他资产                     | -               | -              | -              | 19,845,751.65 | 19,845,751.65    |
| 资产总计                     | 249,654,163.08  | 565,403,000.00 | 273,012,000.00 | 19,845,751.65 | 1,107,914,914.73 |
| 负债                       |                 |                |                |               |                  |
| 应付管理人报酬                  | -               | -              | -              | 242,247.05    | 242,247.05       |
| 应付托管费                    | -               | -              | -              | 80,749.01     | 80,749.01        |
| 卖出回购金融资产款                | 153,999,569.00  | -              | -              | -             | 153,999,569.00   |
| 应交税费                     | -               | -              | -              | 40,840.95     | 40,840.95        |
| 其他负债                     | -               | -              | -              | 271,124.92    | 271,124.92       |
| 负债总计                     | 153,999,569.00  | -              | -              | 634,961.93    | 154,634,530.93   |
| 利率敏感度缺口                  | 95,654,594.08   | 565,403,000.00 | 273,012,000.00 | 19,210,789.72 | 953,280,383.80   |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2022 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点      | -11,143,161.14              | -12,109,263.85         |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 11,328,420.51               | 12,422,271.63          |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场

价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险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它价格风险，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

### 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 1,338,461,404.72        | 1,078,254,000.00         |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 1,338,461,404.72        | 1,078,254,000.00         |

##### 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的当期期初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。

#### 7.4.14.2.3 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

注：于本报告期末及上年度报告期末本基金无属于第三层次的金融资产。

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

注：于本报告期末及上年度报告期末未使用不可观察输入值。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本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            | 1,338,461,404.72 | 99.91         |
|    | 其中：债券             | 1,338,461,404.72 | 99.91         |
|    | 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      | 1,142,434.78     | 0.09          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,537.63         | 0.00          |
| 9  | 合计                | 1,339,606,377.13 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

## 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      | 276,853,334.02   | 28.54         |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,011,432,111.79 | 104.27        |
|    | 其中：政策性金融债 | 84,450,400.00    | 8.71          |
| 4  | 企业债券      | 50,175,958.91    | 5.17          |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | -                | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,338,461,404.72 | 137.99        |

## 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  | 220019  | 22 附息国债 19 | 2,000,000 | 197,272,486.19 | 20.34         |
| 2  | 2128010 | 21 光大银行小微债 | 900,000   | 93,302,950.68  | 9.62          |
| 3  | 2120028 | 21 宁波银行 01 | 900,000   | 93,162,269.59  | 9.60          |
| 4  | 2220052 | 22 河北银行永   | 950,000   | 93,077,147.95  | 9.60          |



|   |         |         |         |               |      |
|---|---------|---------|---------|---------------|------|
|   |         | 续债      |         |               |      |
| 5 | 2220073 | 22 上海银行 | 900,000 | 89,391,821.92 | 9.22 |

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2022-01-19 作出京汇罚（2022）5 号处罚决定，由于中国光大银行股份有限公司违反《国家外汇管理局关于境内银行境外直接投资外汇管理有关问题的通知》（汇发〔2010〕31 号）第二条，违反外汇登记管理规定，根据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条规定，对中国光大银行股份有限公司给予警告，处 25000 元人民币的罚款。

中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2022 年 2 月 14 日作出沪银保监罚决字（2022）13 号处罚决定，由于 2015 年 3 月至 7 月，上海银行股份有限公司同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，对上海银行股份有限公司责令改正，并处罚款 240 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）15 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送其他担保类业务 EAST 数据；七、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十一、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十二、EAST

系统《对公信贷业务借据》表错报；十三、EAST 系统《关联关系》表漏报；十四、理财产品登记不规范；十五、2018 年行政处罚问题依然存在，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对交通银行股份有限公司罚款 420 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）18 号处罚决定，由于光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报抵押物价值 EAST 数据；四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；五、漏报权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送其他担保类业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十三、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十四、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十七、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十八、2018 年行政处罚问题依然存在，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对中国光大银行股份有限公司罚款 490 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）19 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（以下简称“公司”）：监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差三、漏报贸易融资业务 EAST 数据四、漏报抵押物价值 EAST 数据五、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据六、漏报债券投资业务 EAST 数据七、未报送权益类投资业务 EAST 数据八、漏报公募基金投资业务 EAST 数据九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据十、漏报贷款承诺业务 EAST 数据十一、漏报委托贷款业务 EAST 数据十二、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致十四、漏报分户账 EAST 数据十五、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报十六、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报十七、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报十八、EAST 系统《关联关系》表漏报，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对华夏银行股份有限公司处以罚款 460 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）13 号处罚决定，由于中国银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，根据相关规定，对其处以罚款 480 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字(2022)28 号处罚决定, 由于宁波银行股份有限公司(以下简称“公司”)信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位, 根据相关规定, 对其处以罚款 220 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字(2022)30 号处罚决定, 由于宁波银行股份有限公司(以下简称“公司”)代理保险销售不规范, 根据相关规定, 对其处以罚款 30 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 21 日作出甬银保监罚决字(2022)35 号处罚决定, 由于宁波银行股份有限公司(以下简称“公司”)薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错, 根据相关规定, 对其处以罚款 270 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 5 月 27 日作出甬银保监罚决字(2022)44 号处罚决定, 由于宁波银行股份有限公司(以下简称“公司”)非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺, 根据相关规定, 对其处以罚款 290 万元。

中国人民银行杭州中心支行于 2022 年 5 月 23 日作出杭银处罚字(2022)30 号处罚决定, 由于杭州银行股份有限公司(以下简称“公司”)1. 未按规定履行客户身份识别义务; 2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录; 3. 未按规定履行大额和可疑交易报告义务; 4. 与身份不明的客户进行交易, 根据相关规定, 对其处以罚款 580 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 5 月 24 日作出银保监罚决字(2022)31 号处罚决定, 由于中国光大银行股份有限公司(以下简称“公司”)银行理财业务存在以下违法违规行为: 一、老产品规模在部分时点出现反弹, 二、托管机构未及时发现理财产品集中度超标, 三、托管业务违反资产独立性要求, 操作管理不到位, 根据相关规定, 对其处以罚款 400 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 5 月 26 日作出银保监罚决字(2022)29 号处罚决定, 由于中国银行股份有限公司(以下简称“公司”)银行理财业务存在违法违规行为, 即老产品规模在部分时点出现反弹, 根据相关规定, 对其处以罚款 200 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 9 月 8 日作出甬银保监罚决字(2022)60 号处罚决定, 由于宁波银行股份有限公司柜面业务内控管理不到位, 根据相关规定, 对其处以 25 万元人民币的罚款。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 9 月 9 日作出银保监罚决字〔2022〕46 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司个人经营贷款挪用至房地产市场，个人消费贷款违规流入房地产市场，总行对分支机构管控不力承担管理责任，依据相关规定，对其处以罚款 500 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的经营情况暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券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。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余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。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额       |
|----|-------|----------|
| 1  | 存出保证金 | 2,537.63 |
| 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    | 2,537.63 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.6 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。

## § 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<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>(%) | 持有份额 | 占总份额比例<br>(%) |
|-----|--------------|----------------|---------------|------|---------------|
| 234 | 3,997,763.02 | 935,476,546.02 | 100.00        | -    | -             |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

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

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 11,114,022.88 | 1.19                        | 10,000,000.00 | 1.07                    | 3 年            |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                           | -             | -                       | -              |
| 基金经理等人员     | -             | -                           | -             | -                       | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -                           | -             | -                       | -              |
| 其他          | -             | -                           | -             | -                       | -              |
| 合计          | 11,114,022.88 | 1.19                        | 10,000,000.00 | 1.07                    | 3 年            |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）<br>基金份额总额 | 509,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 935,476,651.00 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 3.84           |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 108.82         |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 935,476,546.02 |

## § 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，本基金管理人—平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）董事陈宁先生因工作变动，经公司 2022 年 1 月 19 日召开的 2022 年第一次股东会审议，不再出任公司第四届董事会董事，并由李佩锋先生接替陈宁先生任职公司的董事。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 72,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 安信证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 渤海证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 财通证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | —  |
| 长江证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | —  |

|                      |   |   |   |   |   |    |
|----------------------|---|---|---|---|---|----|
| 川财证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 大通证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 东北证券                 | 3 | - | - | - | - | -  |
| 东方财富<br>证券           | 2 | - | - | - | - | -  |
| 东方证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 东吴证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 东兴证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 方正证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 光大证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 广发证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 国盛证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 国泰君安<br>证券           | 1 | - | - | - | - | -  |
| 国信证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 海通证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 恒泰证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 华宝证券                 | 2 | - | - | - | - | 退租 |
| 华创证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 华林证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 华泰证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 开源证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 民生证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 平安证券                 | 4 | - | - | - | - | -  |
| 申万宏源<br>证券           | 2 | - | - | - | - | -  |
| 世纪证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 太平洋证<br>券            | 2 | - | - | - | - | -  |
| 天风证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 万联证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 西部证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 西南证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 兴业证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 银河证券                 | 2 | - | - | - | - | -  |
| 英大证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 中泰证券                 | 1 | - | - | - | - | -  |
| 中信建投<br>证券           | 2 | - | - | - | - | -  |
| 中信证券                 | 3 | - | - | - | - | -  |
| 中银国际                 | 1 | - | - | - | - | -  |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 证券 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）研究实力
- （2）业务服务水平
- （3）综合类研究服务对投资业绩贡献度
- （4）专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |                 |
|--------|------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 安信证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 渤海证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 财通证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 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   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 光大证    | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |



|            |                   |        |   |   |   |   |
|------------|-------------------|--------|---|---|---|---|
| 券          |                   |        |   |   |   |   |
| 广发证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 国盛证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 国泰君<br>安证券 | -                 | -      | - | - | - | - |
| 国信证<br>券   | 69,155,300.<br>00 | 100.00 | - | - | - | - |
| 海通证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 恒泰证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 华宝证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 华创证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 华林证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 华泰证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 开源证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 民生证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 平安证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 申万宏<br>源证券 | -                 | -      | - | - | - | - |
| 世纪证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 太平洋<br>证券  | -                 | -      | - | - | - | - |
| 天风证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 万联证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 西部证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 西南证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 兴业证<br>券   | -                 | -      | - | - | - | - |
| 银河证        | -                 | -      | - | - | - | - |

|                          |   |   |   |   |   |   |
|--------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 券                        |   |   |   |   |   |   |
| 英大证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国<br>际金融<br>股份有<br>限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建<br>投证券               | - | - | - | - | - | - |
| 中信证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国<br>际证券               | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式       | 法定披露日期           |
|----|--------------------------------------------|--------------|------------------|
| 1  | 关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告                  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 01 月 01 日 |
| 2  | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 01 月 12 日 |
| 3  | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 01 月 24 日 |
| 4  | 关于平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 02 月 26 日 |
| 5  | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年年度报告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 03 月 31 日 |
| 6  | 平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 04 月 02 日 |
| 7  | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 04 月 22 日 |
| 8  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 04 月 29 日 |
| 9  | 平安基金管理有限公司关于上海攀赢基金销售有限公司新增旗下部分基金为销售机构的公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 05 月 19 日 |
| 10 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 05 月 31 日 |
| 11 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式                           | 中国证监会规定报刊及   | 2022 年 05 月 31 日 |

|    |                                            |              |                  |
|----|--------------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 证券投资基金招募说明书（更新）                            | 网站           |                  |
| 12 | 关于平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 11 日 |
| 13 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 30 日 |
| 14 | 平安基金管理有限公司关于暂停乾道基金销售有限公司办理相关销售业务的公告        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 07 月 18 日 |
| 15 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 07 月 21 日 |
| 16 | 平安基金管理有限公司关于新增华宝证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 08 月 03 日 |
| 17 | 平安基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司销售业务合作的公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 08 月 19 日 |
| 18 | 平安基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告                     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 08 月 24 日 |
| 19 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年中期报告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 08 月 31 日 |
| 20 | 关于平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 09 月 14 日 |
| 21 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 10 月 25 日 |
| 22 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 10 月 26 日 |
| 23 | 平安基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 10 月 28 日 |
| 24 | 平安基金管理有限公司关于终止与国开证券股份有限公司相关销售业务的公告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 11 日 |
| 25 | 平安基金管理有限公司关于终止与深圳信诚基金销售有限公司销售业务合作的公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 14 日 |
| 26 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 16 日 |
| 27 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 16 日 |
| 28 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式                           | 中国证监会规定报刊及   | 2022 年 11 月 16 日 |

|    |                                         |              |                  |
|----|-----------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 证券投资基金基金经理变更公告                          | 网站           |                  |
| 29 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 19 日 |
| 30 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 19 日 |
| 31 | 平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 19 日 |
| 32 | 关于平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 12 月 17 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|---------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比(%) |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 1              | 2022/01/01--2022/12/31  | 924,360,718.85 | 0.00 | 0.00 | 924,360,718.85 | 98.81   |
| 个人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | -              | -                       | -              | -    | -    | -              | -       |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                |                         |                |      |      |                |         |
| <p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |                |                         |                |      |      |                |         |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同
- （3）平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日