

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:国元证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30日止

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	39
§9 开放式基金份额变动	39
§10 重大事件揭示	39

10.1 基金份额持有人大会决议	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§11 备查文件目录	41
11.1 备查文件目录	41
11.2 存放地点	41
11.3 查阅方式	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划
基金简称	国元元赢四个月定开债
基金主代码	970070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月28日
基金管理人	国元证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	514,534,739.20份
基金合同存续期	3年

2.2 基金产品说明

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

	CS) 收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划，高于货币市场基金、货币型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国元证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 张社平	张燕
人	联系电话 0551-62207188	0755-83199084
	电子邮箱 95578@gyzq. com. cn	yan_zhang@cmbchina. com
客户服务电话	95578/4008888777	95555
传真	0551-62696501	0755-83195201
注册地址	安徽省合肥市梅山路18号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	230001	518040
法定代表人	俞仕新	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任	北京市西城区太平桥大街17号

	公司	
--	----	--

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标		报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益		10,654,965.61
本期利润		13,732,649.65
加权平均基金份额本期利润		0.0281
本期加权平均净值利润率		2.68%
本期基金份额净值增长率		2.69%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润		27,660,404.20
期末可供分配基金份额利润		0.0538
期末基金资产净值		546,690,195.85
期末基金份额净值		1.0625
3.1.3 累计期末指标		报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率		3.80%

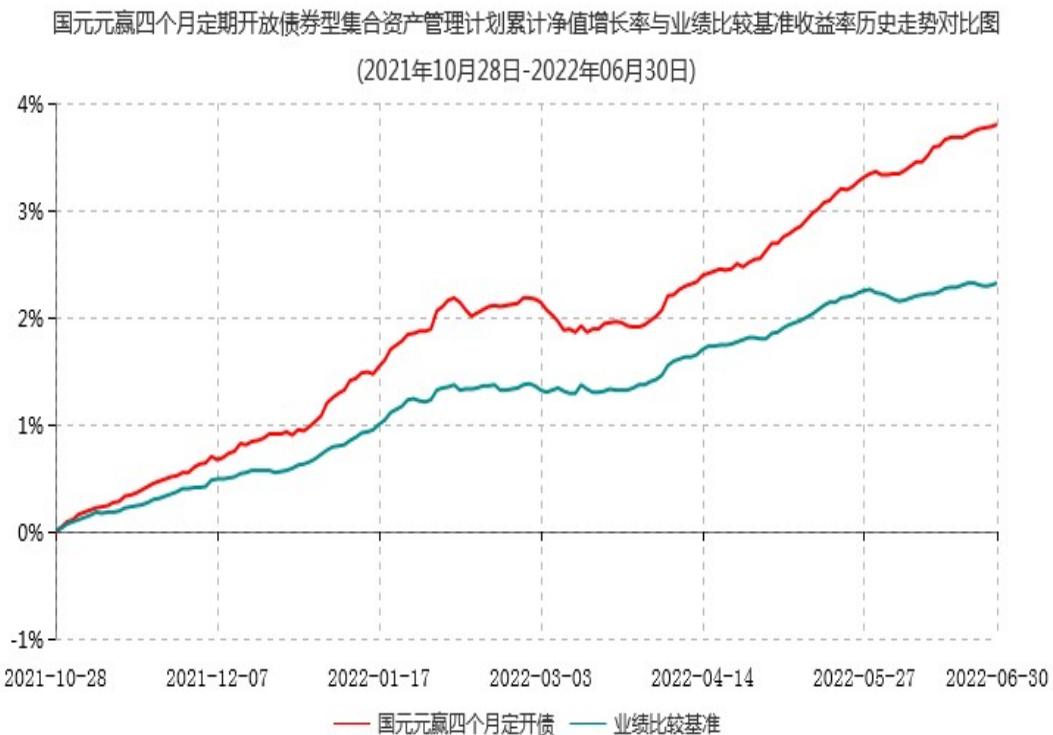
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.43%	0.02%	0.09%	0.02%	0.34%	0.00%
过去三个月	1.75%	0.03%	0.89%	0.02%	0.86%	0.01%
过去六个月	2.69%	0.04%	1.59%	0.02%	1.10%	0.02%

自基金合同生效起至今	3. 80%	0. 03%	2. 32%	0. 02%	1. 48%	0. 01%
------------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

4. 1 基金管理人及基金经理情况

4. 1. 1 基金管理人及其管理基金的经验

国元证券股份有限公司由原安徽省国际信托投资公司和原安徽省信托投资公司作为发起人发起成立于2001年10月，并于2007年10月，公司借壳“北京化二”在深圳证券交易所成功上市，股票代码：000728。公司法人代表为俞仕新先生，目前公司注册资本43.64亿元人民币，注册地安徽省合肥市。

截止2022年6月底，国元证券资产管理业务管理资管计划213只，管理资产净值为292.83亿元，其中集合资产管理计划管理资产净值73.62亿元。

国元证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》操作指引》的要求对原大集合产品进行公募化改造，截至2022年6月30日，旗下已有4只大集合产品完成公募化改造，分别为：国元元赢30天持有期债券型集

合资产管理计划、国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划、国元元赢六个月定期开放债券型集合资产管理计划、国元元增利货币型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏真辉	大集合产品投资经理	2013-05-29	-	14	中国科学技术大学金融学硕士。2008年2月加入国元证券客户资产管理总部，历任研究员、投资助理，现任国元元赢四个月定开债、国元元赢六个月定开债投资经理。
李雅婷	大集合产品投资经理	2019-11-08	-	13	南开大学金融学硕士。曾任职于中国工商银行安徽省分行营业部，2012年8月加入国元证券资管总部，历任投资助理，现任国元元赢30天持有期债、国元元赢四个月定开债、国元元增利货币投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 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。本报告期内管理人管理的所有大集合投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债市回顾：上半年债市受俄乌战争、疫情反弹等因素影响，整体呈震荡下行走势，同时，美联储的快速加息以及国内宽信用的预期，也形成对无风险收益率进一步下行的掣肘，十年国债在2.62%-2.86%之间窄幅震荡。

转债市场回顾：可转债经过去年一年的上涨后，年初即出现调整，俄乌战争爆发后调整幅度明显加大，4月底开始转债市场跟随正股出现V型反弹，溢价率快速压缩，中证转债指数上半年最终收跌4.07%。

组合操作：我们继续严格遵照产品合同的相关约定，优化资产配置结构，提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢四个月定期开放债券基金份额净值为1.0625元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.69%，同期业绩比较基准收益率为1.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年债券市场挑战与机遇并存，中央表示“不会为了过高增长而出台超大规模刺激措施”，预计经济复苏斜率较2020年更为缓和，但极度宽松的资金面或有所收敛，关注下半年政治局会议和二十大的政策指引。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计

划份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

§ 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

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,140,610.49	1,723,837.01
结算备付金		465,614.48	3,449,926.24
存出保证金		21,722.03	10,722.00

交易性金融资产	6. 4. 7. 2	514, 805, 939. 49	453, 343, 762. 95
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		494, 444, 651. 82	428, 298, 762. 95
资产支持证券 投资		20, 361, 287. 67	25, 045, 000. 00
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 3	72, 902, 007. 77	43, 830, 000. 00
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券 投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		994, 430. 14	4, 187, 459. 46
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	10, 039, 299. 41
资产总计		590, 330, 324. 40	516, 585, 007. 07
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		43, 200, 866. 43	55, 000, 000. 00
应付清算款		—	—

应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		224, 118. 36	195, 318. 44
应付托管费		67, 235. 51	58, 595. 52
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		54, 365. 29	61, 441. 94
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6. 4. 7. 4	93, 542. 96	68, 564. 35
负债合计		43, 640, 128. 55	55, 383, 920. 25
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 5	514, 534, 739. 20	445, 732, 460. 88
其他综合收益		—	—
未分配利润	6. 4. 7. 6	32, 155, 456. 65	15, 468, 625. 94
净资产合计		546, 690, 195. 85	461, 201, 086. 82
负债和净资产总计		590, 330, 324. 40	516, 585, 007. 07

6.2 利润表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
一、营业总收入		15, 735, 482. 76
1. 利息收入		718, 030. 04
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 7	28, 269. 97
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		689, 760. 07
其他利息收入		—

2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,936,424.52
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.8	11,617,622.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.9	318,802.17
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	3,077,684.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	3,344.16
减：二、营业总支出		2,002,833.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,267,301.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	380,190.42
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		185,712.41
其中：卖出回购金融资产支出		185,712.41
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		38,865.07
8. 其他费用	6.4.7.12	130,763.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,732,649.65
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,732,649.65
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		13,732,649.65

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	445,732,460. 88	-	15,468,625.9 4	461,201,086. 82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	445,732,460. 88	-	15,468,625.9 4	461,201,086. 82
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	68,802,278.3 2	-	16,686,830.7 1	85,489,109.0 3
(一)、综合收益总额	-	-	13,732,649.6 5	13,732,649.6 5
(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)	68,802,278.3 2	-	2,954,181.06	71,756,459.3 8
其中：1. 基金申购款	134,588,896. 27	-	5,814,203.94	140,403,100. 21
2. 基金赎回款	-65,786,617. 95	-	-2,860,022.8 8	-68,646,640. 83
(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)	514,534,739. 20	-	32,155,456.6 5	546,690,195. 85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

沈和付

吴边

司开铭

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

投资范围：本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具。本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转债转股和可交换债券换股所形成的股票，必须在转股后10个交易日内卖出。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本集合计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本财务报表的实际编制期间自2022年1月1日至2022年6月30日止。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

增值税及附加税金

根据财政部和国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，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。此外，应按照增值税的7%计算

城市建设维护税，按增值税的3%计算教育费附加，地方教育附加应按照本集合计划管理人所在当地税务机关规定的比例计算。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

所得税

本集合计划非所得税纳税主体。资产管理计划份额持有人从资产管理计划中获得的各项收益，由资产管理计划份额持有人根据国家的法律法规，自行申报并履行纳税义务。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	1,140,610.49
等于：本金	1,140,031.69
加：应计利息	578.80
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	1,140,610.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	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	327,214,260.70	7,627,624.53	338,106,294.84
	银行间市场	152,386,153.80	3,382,856.98	156,338,356.98
	合计	479,600,414.50	11,010,481.51	494,444,651.82
资产支持证券	20,000,000.00	323,287.67	20,361,287.67	38,000.00
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	499,600,414.50	11,333,769.18	514,805,939.49	3,871,755.81

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	账面余额
交易所市场	72,902,007.77	-
银行间市场	-	-
合计	72,902,007.77	-

6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2022年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	240. 40
其中：交易所市场	-
银行间市场	240. 40
应付利息	-
预提费用-审计费	24, 795. 19
预提费用-信息披露费	59, 507. 37
预提费用-账户维护费	9, 000. 00
合计	93, 542. 96

6.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	445, 732, 460. 88	445, 732, 460. 88
本期申购	134, 588, 896. 27	134, 588, 896. 27
本期赎回（以“-”号填列）	-65, 786, 617. 95	-65, 786, 617. 95
本期末	514, 534, 739. 20	514, 534, 739. 20

6.4.7.6 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	14, 199, 357. 79	1, 269, 268. 15	15, 468, 625. 94
本期利润	10, 654, 965. 61	3, 077, 684. 04	13, 732, 649. 65
本期基金份额交易产生的变动数	2, 806, 080. 80	148, 100. 26	2, 954, 181. 06
其中：基金申购款	5, 476, 877. 58	337, 326. 36	5, 814, 203. 94
基金赎回款	-2, 670, 796. 78	-189, 226. 10	-2, 860, 022. 88
本期已分配利润	-	-	-

本期末	27,660,404.20	4,495,052.45	32,155,456.65
-----	---------------	--------------	---------------

6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	14,824.09
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	13,253.23
其他	192.65
合计	28,269.97

6.4.7.8 债券投资收益

6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	10,699,792.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	917,830.17
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	11,617,622.35

6.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	171,511,508.34

成交总额	
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	162,540,034.28
减: 应计利息总额	8,051,467.75
减: 交易费用	2,176.14
买卖债券差价收入	917,830.17

6.4.7.9 资产支持证券投资收益

6.4.7.9.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	438,552.17
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-119,750.00
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	318,802.17

6.4.7.9.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	25,462,325.00
减: 卖出资产支持证券成本总额	25,119,750.00
减: 应计利息总额	462,325.00
减: 交易费用	-

资产支持证券投资收益	-119,750.00
------------	-------------

6.4.7.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	3,077,684.04
——股票投资	-
——债券投资	2,964,934.04
——资产支持证券投资	112,750.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-
合计	3,077,684.04

6.4.7.11 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	3,152.38
其他	191.78
合计	3,344.16

6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	34,795.19
信息披露费	59,507.37
TA服务费	9,461.32
其他费用_账户维护费_中债登	22,500.00
其他费用_账户维护费_上清所	4,500.00
合计	130,763.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或重大厉害关系的关联方发生变化

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国元证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
国元证券股份有限公司	117,134,337.21	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
国元证券股份有限公司	1,191,912,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,267,301.33
其中：支付销售机构的客户维护费	-

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	380,190.42

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

截至2022年6月30日，管理人运用固有资金持有的本集合计划份额余额为4,014,411.53份。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,140,610.49	14,824.09

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本集合计划未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期内未持有流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至2022年6月30日，本集合计划从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为0。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至2022年6月30日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为43,200,866.43元，在2022年7月1日到期。该类交易要求集合计划转入质押库的债券，按照证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

集合计划的管理人董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，履行以下职责：（一）推进风险文化建设；（二）审议批准公司全面风险管理的基本制度；（三）审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；（四）审议公司定期风险评估报告；（五）任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；（六）建立与首席风险官的直接沟通机制；（七）公司章程规定的其他风险管理职责。董事会设立

风险管理委员会，按照公司章程和董事会《风险管理委员会工作细则》的规定履行职责和义务。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在非集中交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	40,517,123.29	-
合计	40,517,123.29	-

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	262,687,214.31	279,961,878.80
AAA以下	191,240,314.22	148,336,884.15
未评级	-	-
合计	453,927,528.53	428,298,762.95

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	20,361,287.67	25,045,000.00
未评级	-	-
合计	20,361,287.67	25,045,000.00

6.4.13.3 流动性风险

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

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划

单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,140,610.49	-	-	-	1,140,610.49
结算备付金	465,614.48	-	-	-	465,614.48
存出保证金	21,722.03	-	-	-	21,722.03
交易性金融资产	124,846,785.08	308,251,926.19	81,707,228.22	-	514,805,939.49
买入返售金融资产	72,902,007.77	-	-	-	72,902,007.77
应收清算款	-	-	-	994,430.14	994,430.14

资产总计	199,376,739.85	308,251,926.19	81,707,228.22	994,430.14	590,330,324.40
负债					
卖出回购金融资产款	43,200,866.43	—	—	—	43,200,866.43
应付管理人报酬	—	—	—	224,118.36	224,118.36
应付托管费	—	—	—	67,235.51	67,235.51
应交税费	—	—	—	54,365.29	54,365.29
其他负债	—	—	—	93,542.96	93,542.96
负债总计	43,200,866.43	—	—	439,262.12	43,640,128.55
利率敏感度缺口	156,175,873.42	308,251,926.19	81,707,228.22	555,168.02	546,690,195.85
上年度末 2021年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,723,837.01	—	—	—	1,723,837.01
结算备付金	3,449,926.24	—	—	—	3,449,926.24
存出保证金	10,722.00	—	—	—	10,722.00
交易性金融资产	148,473,021.68	176,452,000.00	128,418,741.27	—	453,343,762.95
买入返售金融资产	43,830,000.00	—	—	—	43,830,000.00
应收证券清算款	—	—	—	4,187,459.46	4,187,459.46
应收利息	—	—	—	10,039,299.41	10,039,299.41
资产总计	197,487,506.93	176,452,000.00	128,418,741.27	14,226,758.87	516,585,007.07

负债					
卖出回购金融资产款	55,000,000.00	-	-	-	55,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	195,318.44	195,318.44
应付托管费	-	-	-	58,595.52	58,595.52
应付交易费用	-	-	-	3,205.04	3,205.04
应交税费	-	-	-	61,441.94	61,441.94
应付利息	-	-	-	15,359.31	15,359.31
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	55,000,000.00	-	-	383,920.25	55,383,920.25
利率敏感度缺口	142,487,506.93	176,452,000.00	128,418,741.27	13,842,838.62	461,201,086.82

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 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，所面临的最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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022年06月30日		2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	494,444,651.82	90.44	428,298,762.95	92.87
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	20,361,287.67	3.72	25,045,000.00	5.43
合计	514,805,939.49	94.17	453,343,762.95	98.30

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	29,512,544.12	428,298,762.95

第二层次	485,293,395.37	25,045,000.00
第三层次	—	—
合计	514,805,939.49	453,343,762.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	514,805,939.49	87.21
	其中：债券	494,444,651.82	83.76
	资产支持证券	20,361,287.67	3.45
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	72,902,007.77	12.35

	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, 606, 224. 97	0. 27
8	其他各项资产	1, 016, 152. 17	0. 17
9	合计	590, 330, 324. 40	100. 00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	15, 996, 513. 70	2. 93

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	350,882,853.15	64.18
5	企业短期融资券	40,517,123.29	7.41
6	中期票据	20,792,668.49	3.80
7	可转债(可交换债)	66,255,493.19	12.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	494,444,651.82	90.44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	184097	21六安债	400,000	42,384,712.33	7.75
2	152586	20蒙城债	300,000	32,123,178.08	5.88
3	132009	17中油EB	256,820	27,188,794.60	4.97
4	2080102	20井开债	250,000	25,271,780.82	4.62
5	152297	19张建发	200,000	21,064,372.60	3.85

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	183626	汴京01优	200,000	20,361,287.67	3.72

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体未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。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票资产。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,722.03
2	应收清算款	994,430.14
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	1,016,152.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值

号				比例 (%)
1	132009	17中油EB	27,188,794.60	4.97
2	132011	17浙报EB	6,828,451.38	1.25
3	113052	兴业转债	3,678,472.97	0.67
4	113013	国君转债	3,408,012.33	0.62
5	113044	大秦转债	2,705,843.17	0.49
6	110073	国投转债	2,300,603.08	0.42
7	113042	上银转债	2,154,224.25	0.39
8	132021	19中电EB	2,131,847.53	0.39
9	110059	浦发转债	1,802,016.30	0.33
10	113043	财通转债	1,440,822.05	0.26
11	113050	XD南银转	1,257,444.73	0.23
12	113011	XD光大转	1,222,804.45	0.22
13	127012	招路转债	1,142,213.70	0.21
14	127045	牧原转债	1,032,038.36	0.19
15	123077	汉得转债	1,009,293.15	0.18
16	113037	N紫银转	675,244.93	0.12
17	128132	交建转债	593,225.34	0.11
18	127033	中装转2	578,520.55	0.11
19	110067	华安转债	495,731.10	0.09
20	113584	家悦转债	493,552.79	0.09
21	113623	凤21转债	344,145.21	0.06
22	127017	万青转债	243,298.08	0.04
23	123101	拓斯转债	224,069.59	0.04
24	113033	利群转债	222,141.51	0.04
25	123128	首华转债	212,178.41	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,023	170,206.66	39,959,057.03	7.77%	474,575,682.17	92.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	6,474,493.82	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年10月28日)基金份额总额	248,122,373.96
本报告期期初基金份额总额	445,732,460.88
本报告期基金总申购份额	134,588,896.27
减：本报告期基金总赎回份额	65,786,617.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	514,534,739.20

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金管理人自2022年2月24日起，沈和付担任国元证券股份有限公司总经理职务，陈新先生不再担任国元证券股份有限公司总经理职位，于强先生不再担任国元证券股份有限公司副总经理的职位。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金	占当期	成交金	占当期

		债券成 交总额 的比例		债券回 购成交 总额的 比例	额	权证成 交总额 的比例	额	基金成 交总额 的比例
国元证 券	117,134,33 7.21	100.00%	1,191,912,00 0.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

11.3 查阅方式

上述文件可在国元证券网站上查阅，或者在营业时间内到国元证券查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国元证券股份有限公司。

客户服务中心电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

国元证券股份有限公司
二〇二二年八月三十一日