

# 国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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:2024年03月29日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划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。

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月29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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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2023年1月1日起至2023年12月31日止

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	3
1.1 重要提示 .....	3
1.2 目录.....	4
§2 基金简介 .....	7
2.1 基金基本情况.....	7
2.2 基金产品说明 .....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	13
§4 管理人报告 .....	14
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§5 托管人报告 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
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 .....	18
§6 审计报告 .....	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	19
§7 年度财务报表 .....	23
7.1 资产负债表.....	23

7.2 利润表 .....	25
7.3 净资产变动表 .....	28
7.4 报表附注 .....	31
§8 投资组合报告 .....	63
8.1 期末基金资产组合情况 .....	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	64
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 .....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
§9 基金份额持有人信息 .....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
§10 开放式基金份额变动 .....	70
§11 重大事件揭示 .....	70
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76

---

<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>76</b>
<b>13.1 备查文件目录</b> .....	<b>76</b>
<b>13.2 存放地点</b> .....	<b>76</b>
<b>13.3 查阅方式</b> .....	<b>77</b>

## §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	907,585,122.04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	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

	<p>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
	联系电话	0551-62207188
	电子邮箱	95578@gyzq.com.cn
		张姗
		400-61-95555
		zhangshan_1027@cmbchina.com



客户服务电话	95578/4008888777	400-61-95555
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	沈和付	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gyzq.com.cn/">http://www.gyzq.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
--------	----------------	----------------

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年10月28日 (基金合同生效日)-2021年12月31日
本期已实现收益	31,539,859.25	27,007,888.95	3,410,791.71
本期利润	46,341,031.03	15,371,085.45	4,698,704.16
加权平均基金份额 本期利润	0.0563	0.0217	0.0111
本期加权平均净值 利润率	5.24%	2.06%	1.08%
本期基金份额净值 增长率	5.52%	2.83%	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	63,503,469.72	36,080,429.09	14,199,357.79

期末可供分配基金份额利润	0.0700	0.0490	0.0319
期末基金资产净值	981,675,422.49	772,760,600.02	461,201,086.82
期末基金份额净值	1.0816	1.0490	1.0347
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率	9.69%	3.95%	1.08%

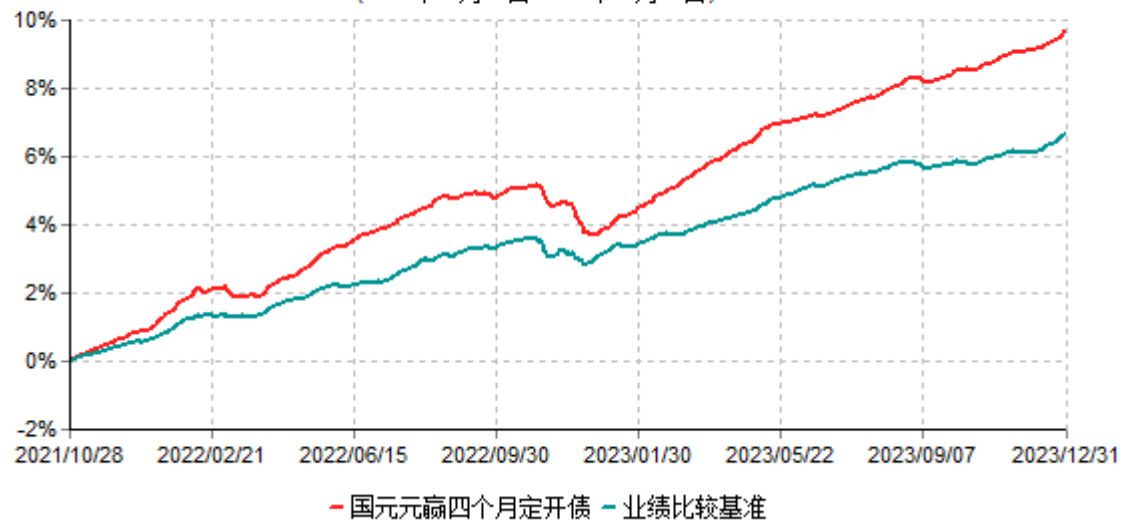
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

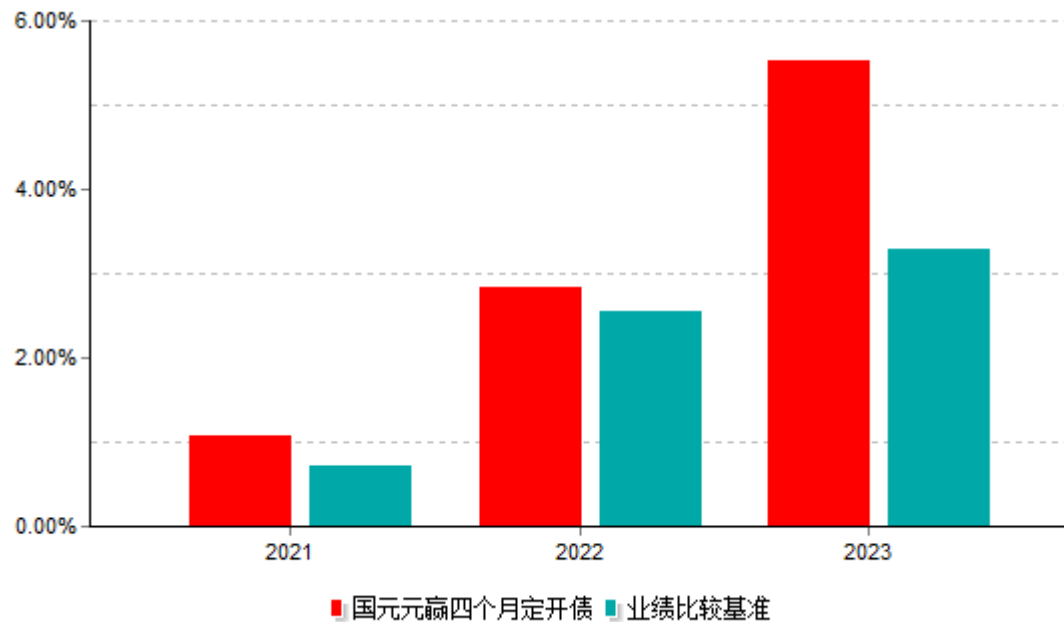
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.16%	0.02%	0.82%	0.02%	0.34%	0.00%
过去六个月	2.25%	0.02%	1.35%	0.02%	0.90%	0.00%
过去一年	5.52%	0.02%	3.29%	0.02%	2.23%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.69%	0.04%	6.67%	0.03%	3.02%	0.01%

### 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

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月28日-2023年12月31日)



### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	0.250	19,132,088.81	2,111,671.52	21,243,760.33	-
2022年	0.150	7,101,169.41	616,852.77	7,718,022.18	-
合计	0.400	26,233,258.22	2,728,524.29	28,961,782.51	-

## §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是经中国证监会证监公司字〔2007〕165号文核准，由北京化二股份有限公司定向回购股份、重大资产出售暨以新增股份吸收合并国元证券有限责任公司，于2007年10月25日登记注册，2007年10月30日在深交所成功上市，最新注册资本4,363,777,891元。2002年5月8日，中国证监会以证监机构字〔2002〕113号文核准国元证券有限责任公司从事受托投资管理业务资格，并自2004年2月1日起自动变更为客户资产管理业务资格。2005年12月12日，公司设立客户资产管理总部，致力于根据客户需求及风险偏好提供多样化的综合金融产品及资产管理服务。

截止2023年12月底，国元证券资产管理业务管理资管计划196只，管理资产净值为239.25亿元，其中集合资产管理计划管理资产净值113.12亿元。

#### 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	-	15	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》等有关法律法规及集合计划合同、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集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法（2020修订）》，建立了科学、合理的投资决策体系，加强了对交易环节的内部控制，并通过风控系统对投资、交易环节的控制来保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本集合计划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：2023年为新冠疫情防控转段后的第一年，消费成为拉动经济的主要力量；房地产投资依然为负增长，且行业风险仍未出清；基建逆势托底作用依然明显；出口冲高回落后逐步修复，中国经济总体呈现弱复苏形态。上半年在“强现实+强预期”逐步转变为“弱现实+弱预期”的基本面影响下，债券市场普遍走牛。7月政治局会议召开，对经济表态积极，宽信用预期重启，收益率出现回调。下半年债市出现分化，利率债和中高等级信用债在供给冲击、汇率贬值压力、宽信用政策扰动等因素的综合影响下，整体呈震荡走势，曲线走平。而低等级城投信用债受益于“一揽子化债”政策利好，收益率一路下行，信用利差压缩至历史低位。十年国债全年下行28BP，收于2.5553%。海外方面，美联储自8月开始连续暂停加息，虽核心通胀指标仍有粘性，但加息进程料已进入尾声。

转债市场回顾：转债在1月的快速拉升后进入横盘，8月开始进入震荡下行通道直至年尾。中证转债指数全年收十字星，跌幅0.48%。

组合操作：我们严格遵照产品合同的约定，顺应市场趋势，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开债基金份额净值为1.0816元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.52%，同期业绩比较基准收益率为3.29%。



#### 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2024年，美联储加息进程已接近尾声，人民币汇率压力有所减轻，外围掣肘因素有所缓解。国内经济恢复进程预计将延续，可能存在政策和数据扰动，但货币宽松基调应不变，利率上行空间有限，如若经济恢复不及预期，货币政策还存在进一步宽松的可能。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。

合规管理方面，公司紧跟最新法律法规要求，贯彻落实最新监管精神，通过合规审查、合规检查、合规咨询等多项措施，压实合规职责，提升内控质量，严格防范大集合业务可能出现的各类合规风险；以风险防范为导向实施差异化管理，对资管业务核心环节重点关注，加强合规检查，强化问题整改落实。同时，为提升员工合规意识，持续开展线上线下全方位、多角度的合规培训，如新员工合规培训、专项合规培训、法制专题宣传等，严把新员工入职的合规意识，并持续在员工执业过程中加强传导各项法律法规和监管政策精神，将合规文化贯穿于公司和每位员工的业务开展环节。

风险管理方面，公司风险监管部立足职责定位，负责督促客户资产管理总部落实公司风险管理决策和风险管理制度，对投资及交易重点指标进行监控，对异常或违规行为进行调查和报告，确保大集合业务符合公司风险偏好。

稽核方面，公司稽核审计部将公司大集合业务纳入公司整体稽核范畴，对大集合业务风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价，对资产管理业务定期开展稽核工作，通过实施询问、观察、检查、核对、分析性复核等必要的稽核程序，以监督、评价公司资产管理业务的经营业绩、内控制度的建立与执行、合规风控管理等情况。

此外，公司内控部门每年度定期组织开展公司层面内部控制评价工作和合规管理有效性评估工作，检查范围包括资产管理业务内部控制情况、产品设计、投资者保护、推广募集、投资运作、投资顾问、估值核算、信息披露和公平交易等内容，不断提高资管业务内部控制和合规管理水平，加强稽核监督力量。

#### 4.7 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。

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

本集合计划本报告期内未出现连续20个工作日集合计划份额持有人数低于200、资产净值低于5000万元的情形。报告期末持有人数为4318户。

## §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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、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 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	容诚审字[2024]230Z0412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	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了后附的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“元赢四个月定开债”）财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表和相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了元赢四个月定开债2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净值变动情况。

<p>形成审计意见的基础</p>	<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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国元证券股份有限公司（以下简称“管理人”）及其管理的元赢四个月定开债，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>元赢四个月定开债管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括元赢四个月定开债管理人2023年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>元赢四个月定开债管理人管理层（以下简称“管理层”）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估元赢四个月定开债的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算元赢四个月定开债、终止运营或别无其他现实的选择。元赢四个月定开债管理人治理层负责监督元赢四个月定开债的财务报告过程。</p>	
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。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：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序</p>	

以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对元赢四个月定开债的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元赢四个月定开债不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与元赢四个月定开债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。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪玉寿 洪雁南 范少君
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦 901-22至901-26
审计报告日期	2024-03-29

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	45,392,318.08	2,149,329.26
结算备付金		1,383,872.89	2,124,595.84
存出保证金		9,194.29	23,640.23
交易性金融资产	7.4.7.2	774,446,441.79	976,962,821.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		774,446,441.79	956,076,684.71
资产支持证券投资		-	20,886,136.99
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	160,132,190.94	-
应收清算款		1,049,274.30	1,000,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.4	250,000.00	312,500.00
资产总计		982,663,292.29	982,572,887.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
卖出回购金融资产款		-	209,090,448.34
应付清算款		-	-



应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		416,649.23	330,619.05
应付托管费		124,994.79	99,185.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		123,212.30	103,588.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	323,013.48	188,445.70
负债合计		987,869.80	209,812,287.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	907,585,122.04	736,680,170.93
未分配利润	7.4.7.7	74,090,300.45	36,080,429.09
净资产合计		981,675,422.49	772,760,600.02
负债和净资产总计		982,663,292.29	982,572,887.03

## 7.2 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：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		53,486,594.02	21,635,286.85
1.利息收入		762,612.69	1,747,757.84
其中：存款利息收入	7.4.7.8	117,668.05	123,180.53
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		644,944.64	1,624,577.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,922,178.04	31,520,464.06
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.9	37,671,048.79	30,624,138.01
资产支持证券投资	7.4.7.10	251,129.25	896,326.05
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	14,801,171.78	-11,636,803.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	631.51	3,868.45
<b>减：二、营业总支出</b>		7,145,562.99	6,264,201.40
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	4,419,087.79	3,711,986.35
2.托管费	7.4.10.2.2	1,325,726.39	1,113,595.96
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		954,880.48	1,104,783.45
其中：卖出回购金融资产支出		954,880.48	1,104,783.45
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		133,944.95	99,374.32
8.其他费用	7.4.7.13	311,923.38	234,461.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		46,341,031.03	15,371,085.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		46,341,031.03	15,371,085.45

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,341,031.03	15,371,085.45

### 7.3 净资产变动表

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：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	736,680,170.93	36,080,429.09	772,760,600.02
二、本期期初净资产	736,680,170.93	36,080,429.09	772,760,600.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	170,904,951.11	38,009,871.36	208,914,822.47
（一）、综合收益总额	-	46,341,031.03	46,341,031.03
（二）、本期基金份额交易产生的净	170,904,951.11	12,912,600.66	183,817,551.77

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	398,459,812.32	29,588,017.67	428,047,829.99
2.基金赎回款	-227,554,861.21	-16,675,417.01	-244,230,278.22
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-21,243,760.33	-21,243,760.33
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	907,585,122.04	74,090,300.45	981,675,422.49
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	445,732,460.88	15,468,625.94	461,201,086.82
二、本期期初净资产	445,732,460.88	15,468,625.94	461,201,086.82

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	290,947,710.05	20,611,803.15	311,559,513.20
（一）、综合收益总额	-	15,371,085.45	15,371,085.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	290,947,710.05	12,958,739.88	303,906,449.93
其中：1.基金申购款	829,777,489.71	41,916,970.95	871,694,460.66
2.基金赎回款	-538,829,779.66	-28,958,231.07	-567,788,010.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-7,718,022.18	-7,718,022.18
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	736,680,170.93	36,080,429.09	772,760,600.02

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:

沈和付	司开铭	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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“元赢四个月定开债”）是由国元证券股份有限公司作为设立人和管理人，由招商银行股份有限公司作为托管人的集合资产管理计划。

国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划（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开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，国元元赢四个月定开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%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表系按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定(包括《资产管理产品相关会计处理规定》)(以下统称企业会计准则)编制,同时,对于具体会计核算和信息披露方面,也参考了《证券投资基金会计核算业务指引》、《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>》。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了,真实、完整地反映了本集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年1月1日至2023年12月31日的经营成果和集合计划净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金额资产的分类

本集合计划的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、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管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。



本集合计划目前以交易目的持有的债券投资等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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划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。本集合计划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。本集合计划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

金融资产和金融负债于本集合计划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和金融负债，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已宣告但尚未发放的现金股利、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和金融负债，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，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，

应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收资金为对外发行的集合计划份额总额扣除分摊至其他综合收益和未分配利润部分后的余额。每份集合计划份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收资金变动分别于计划申购确认日及计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本集合计划转换所引起的转入本集合计划的实收资金增加和转出本集合计划的实收资金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- （1）管理人报酬按照元赢四个月定开债说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。
- （2）基金托管费按照元赢四个月定开债说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。
- （3）卖出回购证券支出在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

(4) 利息支出在借款期内逐日计提，并按借款本金与适用的利率计提的金额入账。

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 元赢四个月定开债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集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，元赢四个月定开债默认的收益分配方式是现金分红；

若投资者选择现金红利自动转为集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日；

(2) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本集合计划每一集合计划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。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局于2016年12月21日发布的《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[2016]140号）规定：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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号），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，通知自2018年1月1日起施行。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。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为0.5%，由出让方缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税[2008]1号）规定：

（1）对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（2）对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

（3）对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	45,392,318.08	2,149,329.26

等于：本金	45,389,624.81	2,148,166.02
加：应计利息	2,693.27	1,163.24
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	45,392,318.08	2,149,329.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023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	437,643,815.68	9,090,223.62	448,956,390.02	2,222,350.72
	银行间市场	314,547,910.67	9,206,051.77	325,490,051.77	1,736,089.33
	合计	752,191,726.35	18,296,275.39	774,446,441.79	3,958,440.05
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		752,191,726.35	18,296,275.39	774,446,441.79	3,958,440.05
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	604,063,677.86	13,781,824.91	610,039,968.37	-7,805,534.40
	银行间市场	338,405,797.33	10,636,116.34	346,036,716.34	-3,005,197.33
	合计	942,469,475.19	24,417,941.25	956,076,684.71	-10,810,731.73

资产支持证券	20,000,000.00	918,136.99	20,886,136.99	-32,000.00
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	962,469,475.19	25,336,078.24	976,962,821.70	-10,842,731.73

### 7.4.7.3 买入返售金融资产

#### 7.4.7.3.1 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 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	124,088,673.29	-
银行间市场	36,043,517.65	-
合计	160,132,190.94	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

### 7.4.7.4 其他资产



单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	250,000.00	312,500.00
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	250,000.00	312,500.00

#### 7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付交易费用	3,713.48	9,445.70
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	3,713.48	9,445.70
应付利息	-	-
预提费用-审计费	70,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	240,000.00	120,000.00
预提费用-账户维护费	9,300.00	9,000.00

合计	323,013.48	188,445.70
----	------------	------------

#### 7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	736,680,170.93	736,680,170.93
本期申购	398,459,812.32	398,459,812.32
本期赎回（以“-”号填列）	-227,554,861.21	-227,554,861.21
本期末	907,585,122.04	907,585,122.04

#### 7.4.7.7 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
上年度末	41,798,204.76	-5,717,775.67	36,080,429.09
本期期初	41,798,204.76	-5,717,775.67	36,080,429.09
本期利润	31,539,859.25	14,801,171.78	46,341,031.03
本期基金份额交易产生的变动数	11,409,166.04	1,503,434.62	12,912,600.66
其中：基金申购款	26,493,335.00	3,094,682.67	29,588,017.67
基金赎回款	-15,084,168.96	-1,591,248.05	-16,675,417.01

本期已分配利润	-21,243,760.33	-	-21,243,760.33
本期末	63,503,469.72	10,586,830.73	74,090,300.45

#### 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	63,488.46	83,103.98
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	53,913.76	39,744.71
其他	265.83	331.84
合计	117,668.05	123,180.53

#### 7.4.7.9 债券投资收益

##### 7.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	41,706,453.61	30,149,140.62

债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-4,035,404.82	474,997.39
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	37,671,048.79	30,624,138.01

7.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	1,401,052,941.24	1,736,948,487.39
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	1,341,381,670.63	1,693,524,709.24
减：应计利息总额	63,690,379.74	42,926,560.57
减：交易费用	16,295.69	22,220.19

买卖债券差价收入	-4,035,404.82	474,997.39
----------	---------------	------------

#### 7.4.7.10 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.10.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
资产支持证券投资收益—— 利息收入	251,129.25	1,016,076.05
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	251,129.25	896,326.05

##### 7.4.7.10.2 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 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
卖出资产支持证券成交总额	21,176,800.00	25,462,328.77
减：卖出资产支持证券成本总额	20,000,000.00	25,119,750.00
减：应计利息总额	1,176,800.00	462,328.77
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-119,750.00

#### 7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	14,801,171.78	-11,636,803.50
——股票投资	-	-
——债券投资	14,769,171.78	-11,679,553.50
——资产支持证券投资	32,000.00	42,750.00
——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	14,801,171.78	-11,636,803.50

#### 7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	631.51	3,676.67
其他	-	191.78
合计	631.51	3,868.45

#### 7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
TA服务费	65,173.38	9,461.32

其他费用_账户维护费_中债登	18,000.00	31,500.00
其他费用_账户维护费_上清所	18,450.00	13,500.00
其他费用	300.00	-
合计	311,923.38	234,461.32

#### 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

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国元证券股份有限公司	集合计划的管理人和销售机构
招商银行股份有限公司	集合计划的托管人
安徽国元金融控股集团有限责任公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
安徽国元信托有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东
建安投资控股集团有限公司	持有基金管理人5%以上股份的股东

注：因管理人关联方过多，此处仅披露管理人、托管人及持有管理人5%以上股份的股东。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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**

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。

**7.4.10.1.2 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。

**7.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国元证券 股份有限 公司	428,660,506.29	100.00%	770,782,145.83	100.00%

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	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 债券回 购成交 总额的 比例
国元证券 股份有限 公司	6,774,836,000.00	100.00%	5,821,385,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 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 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,419,087.79	3,711,986.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	4,419,087.79	3,711,986.35

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,325,726.39	1,113,595.96

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
基金合同生效日（2021年10月28日）持有的基金份额	0.00	4,014,411.53
报告期初持有的基金份额	0.00	4,014,411.53
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	4,014,411.53
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%
---------------------	-------	-------

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

本集合计划本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
招商银行股份有限公司	45,392,318.08	63,488.46	2,149,329.26	83,103.98

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本集合计划本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2023-08-10	2023-08-10	0.150	11,123,272.50	1,054,455.21	12,177,727.71	-
2	2023-12-11	2023-12-11	0.100	8,008,816.31	1,057,216.31	9,066,032.62	-
合计			0.250	19,132,088.81	2,111,671.52	21,243,760.33	-

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

本集合计划本报告期末未持有新发/增发证券等流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划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2023年12月31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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至2023年12月31日，本集合计划从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购清算款余额为0。

## 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

集合计划的管理人建立与实施内部控制，遵循下列原则：(1)全面性原则。公司风险管理应当覆盖公司经营所面临的所有风险类别，以及公司的所有业务、机构和人员，贯穿决策、执行、监督和反馈的全过程。(2)制衡性原则。公司风险管理应当通过制度、流程、系统管理等方式，实现不同业务环节的相互制约，以及前、中、后台相关部门、相关岗位之间的相互制衡与监督。履行风险管理职责的部门应独立于监管对象，客观独立地履行风险管理各项职责。(3)针对性原则。公司应对各风险进行等级划分，对不同等级风险采取不同的资源投入和风险应对措施。重点加强对高等级风险、内控薄弱环节和新业务风险的识别、监测和管控。(4)适应性原则。公司风险管理应当与公司的经营规模、风险状况、承受能力和创新发展要求等相匹配，符合监管及行业自律要求，与行业发展实际水平相适应，以合理的成本和措施实现风险管理目标。

公司建立健全对大集合业务有效的多级风险防范体系，并根据业务流程和风险特征，将大集合业务风险管理工作纳入公司风险管理体系之中。除董事会外，公司对大集合业务的风险控制体系共分四个层次：

- (1) 公司执行委员会、经营管理层及下设的风控与合规委员会等非常设机构；
- (2) 资产管理业务委员会及下设的资产管理业务审核小组等非常设机构；
- (3) 客户资产管理总部及下设的投资决策委员会；
- (4) 风险监管部、合规法务部、稽核审计部等履行合规风险管理相关职能的部门，客户资产管理总部内设的风险管理岗位。

公司执行委员会、经营管理层及下设的风控与合规委员会等非常设机构是大集合业务风险管理的决策机构，负责制定涉及公司各业务部门的大集合业务风险管理制度、流程与指标；资产管理业务委员会及下设的资产管理业务审核小组等非常设机构负责对大集合业务重大投资决策进行风险审核，并授权相关人员执行。客户资产管理总部及下设的投资决策委员会负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对大集合业务风险管理的有效性负直接责任。客户资产管理总部负责人是其部门风险管理的第一责任人，大集合产品投资经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。客户资产管理总部所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

风险监管部对大集合业务的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责；

合规法务部对大集合业务合同的签订、变更、终止等与客户相关的事项进行事前控制和审查，对投资交易行为的合法性予以检查；

稽核审计部将公司大集合业务纳入公司整体稽核范畴，对大集合业务风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价；运营总部、财务会计部、信息技术总部、资金计划部等部门形成大集合业务的风险管理支持体系，为大集合业务风险监管提供集中清算、财务核算、信息技术、流动性风险管理等支持。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,999,693.99	61,450,205.48
合计	20,999,693.99	61,450,205.48

## 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	49,253,829.65	41,995,960.18
合计	49,253,829.65	41,995,960.18

## 7.4.13.2.3 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	487,666,282.67	525,670,020.93
AAA以下	133,416,673.73	285,413,046.07
未评级	83,109,961.75	41,547,452.05
合计	704,192,918.15	852,630,519.05

## 7.4.13.2.4 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	上年度末



	2023年12月31日	2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	20,886,136.99
未评级	-	-
合计	-	20,886,136.99

### 7.4.13.3 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。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,392,318.08	-	-	-	45,392,318.08
结算备付金	1,383,872.89	-	-	-	1,383,872.89
存出保证金	9,194.29	-	-	-	9,194.29
交易性金融资产	351,829,339.18	412,144,736.49	10,472,366.12	-	774,446,441.79
买入返售金融资产	160,132,190.94	-	-	-	160,132,190.94
应收清算款	-	-	-	1,049,274.30	1,049,274.30
其他资产	-	-	-	250,000.00	250,000.00
资产总计	558,746,915.38	412,144,736.49	10,472,366.12	1,299,274.30	982,663,292.29

计					
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	416,649.23	416,649.23
应付托管费	-	-	-	124,994.79	124,994.79
应交税费	-	-	-	123,212.30	123,212.30
其他负债	-	-	-	323,013.48	323,013.48
负债总计	-	-	-	987,869.80	987,869.80
利率敏感度缺口	558,746,915.38	412,144,736.49	10,472,366.12	311,404.50	981,675,422.49
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,149,329.26	-	-	-	2,149,329.26
结算备付金	2,124,595.84	-	-	-	2,124,595.84

存出保证金	23,640.23	-	-	-	23,640.23
交易性金融资产	455,093,781.72	475,995,196.11	45,873,843.87	-	976,962,821.70
应收清算款	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
其他资产	-	-	-	312,500.00	312,500.00
资产总计	459,391,347.05	475,995,196.11	45,873,843.87	1,312,500.00	982,572,887.03
负债					
卖出回购金融资产款	209,090,448.34	-	-	-	209,090,448.34
应付管理人报酬	-	-	-	330,619.05	330,619.05
应付托管费	-	-	-	99,185.72	99,185.72
应交税费	-	-	-	103,588.20	103,588.20
其他负债	-	-	-	188,445.70	188,445.70
负债总计	209,090,448.34	-	-	721,838.67	209,812,287.01

计					
利率敏感度缺口	250,300,898.71	475,995,196.11	45,873,843.87	590,661.33	772,760,600.02

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	-	-	-	-

产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	774,446,441.79	78.89	956,076,684.71	123.72
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	20,886,136.99	2.70
合计	774,446,441.79	78.89	976,962,821.70	126.43

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	18,887,526.74	38,849,427.54
第二层次	755,558,915.05	938,113,394.16
第三层次	-	-
合计	774,446,441.79	976,962,821.70

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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集合计划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	774,446,441.79	78.81
	其中：债券	774,446,441.79	78.81
	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	160,132,190.94	16.30
	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	46,776,190.97	4.76
8	其他各项资产	1,308,468.59	0.13
9	合计	982,663,292.29	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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**

无。

**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**

无。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

无。

**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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,472,366.12	1.07
	其中：政策性金融债	10,472,366.12	1.07
4	企业债券	500,979,504.40	51.03
5	企业短期融资券	20,999,693.99	2.14
6	中期票据	165,816,921.19	16.89
7	可转债(可交换债)	26,924,126.44	2.74
8	同业存单	49,253,829.65	5.02
9	其他	-	-

10	合计	774,446,441.79	78.89
----	----	----------------	-------

**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	152629	20吉凤01	530,000	43,057,926.03	4.39
2	102100914	21临汾投资MTN002	400,000	42,174,644.81	4.30
3	184097	21六安债	400,000	41,766,553.42	4.25
4	102100365	21扬州化工MTN002	400,000	41,641,683.06	4.24
5	184191	22淮北01	300,000	31,317,098.63	3.19

**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**  
无。

**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**  
无。

**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**  
无。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本集合计划不参与国债期货投资。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 根据管理人现有舆情系统监控，未发现本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

**8.12.2** 本集合计划本报告期末未持有股票资产。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,194.29
2	应收清算款	1,049,274.30
3	应收股利	-
4	应收利息	250,000.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,308,468.59
---	----	--------------

8.12.4 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

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G三峡EB2	8,036,599.70	0.82
2	113052	XD兴业转	5,293,397.51	0.54
3	113044	大秦转债	5,199,895.89	0.53
4	127006	敖东转债	1,427,648.63	0.15
5	110059	浦发转债	1,292,038.36	0.13
6	110075	南航转债	1,200,109.59	0.12
7	113059	福莱转债	1,026,660.83	0.10
8	113050	XD南银转	768,598.32	0.08
9	127025	冀东转债	738,370.61	0.08
10	113037	N紫银转	581,178.97	0.06
11	113042	上银转债	495,501.16	0.05
12	128035	大族转债	418,490.96	0.04
13	127017	万青转债	222,022.47	0.02
14	123101	拓斯转债	113,073.70	0.01
15	113033	利群转债	110,539.74	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,318	210,186.46	228,237,508.73	25.1478%	679,347,613.31	74.8522%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	14,458,343.11	1.5930%

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

## §10 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	736,680,170.93
本报告期基金总申购份额	398,459,812.32
减：本报告期基金总赎回份额	227,554,861.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	907,585,122.04

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开集合计划份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，管理人自2023年2月18日起，胡甲先生不再担任国元证券股份有限公司执行委员会委员、董事会秘书；自2023年3月7日起，唐亚湖先生担任国元证券股份有限公司合规总监；自2023年12月15日起，沈和付先生不再担任国元证券股份有限公司总裁；自2023年12月16日起，胡伟先生担任国元证券股份有限公司总裁。

本报告期，集合计划托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本期内，无涉及集合计划管理人、集合计划资产、集合计划托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期集合计划投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本集合计划的审计事务所为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期应支付给容诚会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币60,000.00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

本报告期管理人及其高级管理人员没有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

报告期内，未发生集合计划托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	

国元 证券	2	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国元证券	428,660,506.29	100.00%	6,774,836,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年第4季度报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-01-19
2	国元证券股份有限公司旗下基金2022年4季度报告提示性公告	上海证券报	2023-01-19
3	国元证券股份有限公司高级管理人员变更公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-02-21
4	国元证券股份有限公司高级管理人员变更公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-03-09



5	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网、上海证券报	2023-03-21
6	国元证券股份有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	上海证券报	2023-03-30
7	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2022年年度报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-03-30
8	关于国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划延长开放期的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-04-12
9	国元证券股份有限公司旗下基金2023年1季度报告提示性公告	上海证券报	2023-04-20
10	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2023年第一季度报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-04-20
11	关于国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-06-08
12	国元证券股份有限公司旗下	上海证券报	2023-07-19

	基金2023年2季度报告提示性公告		
13	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2023年第二季度报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-07-19
14	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网、上海证券报	2023-08-03
15	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划分红公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网、上海证券报	2023-08-07
16	关于国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划延长开放期的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-08-25
17	国元证券股份有限公司旗下基金2023年中期报告提示性公告	上海证券报	2023-08-30
18	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2023年中期报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-08-30
19	国元证券股份有限公司旗下基金2023年3季度报告提示性公告	上海证券报	2023-10-24

20	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划2023年第3季度报告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-10-24
21	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划产品资料概要更新	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-10-27
22	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更新	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-10-27
23	关于国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划增加平安银行股份有限公司为代销机构的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-11-21
24	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划分红公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网、上海证券报	2023-12-06
25	国元元赢四个月定期开放债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务的公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网、上海证券报	2023-12-18
26	国元证券股份有限公司高级管理人员变更公告	资本市场电子化信息披露平台、管理人官网	2023-12-19

## §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	20230101-20231231	190,185,749.05	0.00	0.00	190,185,749.05	20.96%
产品特有风险							
-							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、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。

### 13.2 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

### 13.3 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](http://www.gyzq.com.cn)

国元证券股份有限公司  
二〇二四年三月二十九日