

富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金  
二〇二三年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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 .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	15
§4 管理人报告 .....	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	23
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 .....	23
§5 托管人报告 .....	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	23
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.....	23
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 .....	23
§6 审计报告 .....	24
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
§7 年度财务报告 .....	26
7.1 资产负债表.....	26

7.2 利润表.....	28
7.3 净资产变动表.....	29
7.4 报表附注.....	31
§8 投资组合报告.....	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	63
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.....	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12 投资组合报告附注.....	63
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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的情况.....	65
§10 开放式基金份额变动.....	66
§11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§13 备查文件目录.....	70



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金		
基金简称	富国安泰 90 天滚动持有短债债券		
基金主代码	011999		
基金运作方式	契约型开放式。每开放日开放申购，每份基金份额设定 90 天滚动运作期。		
基金合同生效日	2021 年 04 月 23 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	951,687,187.70 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E
下属分级基金的交易代码	011999	012000	020066
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位:份)	40,337,791.44 份	911,348,464.99 份	931.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值，力求提高基金总体收益率。在资产配置方面，本基金在最大限度地降低投资组合的风险前提下，提高投资组合的收益。在债券投资方面，本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略。本基金的动态收益增强策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合财富（1 年以下）指数收益率*90%+银行一年期定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

### 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	富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	陆志俊
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		裴长江	任德奇

## 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	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 交通银行股份有限公司 中国(上海)长宁区仙霞路18号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30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

(1) 富国安泰90天滚动持有短债债券A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年4月23日 (基金合同生效日)
---------------	-------	-------	-------------------------

			至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,243,856.85	1,496,198.02	1,109,551.16
本期利润	1,562,151.95	794,291.20	1,242,472.72
加权平均基金份额本期利润	0.0354	0.0137	0.0212
本期加权平均净值利润率	3.33%	1.31%	2.11%
本期基金份额净值增长率	3.35%	2.28%	2.15%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>2021 年 12 月 31 日</b>
期末可供分配利润	3,077,132.55	2,871,822.62	368,757.46
期末可供分配基金份额利润	0.0763	0.0448	0.0191
期末基金资产净值	43,558,038.69	66,911,151.34	19,701,428.60
期末基金份额净值	1.0798	1.0448	1.0215
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>2021 年 12 月 31 日</b>
基金份额累计净值增长率	7.98%	4.48%	2.15%

(2) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 4 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	26,745,156.89	46,918,806.79	50,278,805.31
本期利润	33,817,843.37	38,778,296.41	55,161,012.40
加权平均基金份额本期利润	0.0329	0.0230	0.0196
本期加权平均净值利润率	3.11%	2.22%	1.94%
本期基金份额净值增长率	3.14%	2.09%	1.98%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>2021 年 12 月 31 日</b>
期末可供分配利润	64,070,744.43	52,351,887.70	41,195,660.62
期末可供分配基金份额利润	0.0703	0.0411	0.0175
期末基金资产净值	978,639,889.04	1,325,403,176.31	2,402,635,629.50
期末基金份额净值	1.0738	1.0411	1.0198
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>2021 年 12 月 31 日</b>
基金份额累计净值增长率	7.38%	4.11%	1.98%

(3) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E

金额单位：人民币元



3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 4 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3.16	—	—
本期利润	5.59	—	—
加权平均基金份额本期利润	0.0060	—	—
本期加权平均净值利润率	0.56%	—	—
本期基金份额净值增长率	0.56%	—	—
3.1.2 期末数据和指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	71.02	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.0763	—	—
期末基金资产净值	1,005.59	—	—
期末基金份额净值	1.0798	—	—
3.1.3 累计期末指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	0.56%	—	—

注：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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。本产品自 2023 年 11 月 14 日起增加 E 类份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### (1) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.86%	0.02%	0.71%	0.02%	0.15%	0.00%
过去六个月	1.36%	0.02%	1.13%	0.01%	0.23%	0.01%
过去一年	3.35%	0.02%	2.53%	0.01%	0.82%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.98%	0.02%	6.69%	0.01%	1.29%	0.01%

(2) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.81%	0.02%	0.71%	0.02%	0.10%	0.00%
过去六个月	1.25%	0.02%	1.13%	0.01%	0.12%	0.01%
过去一年	3.14%	0.02%	2.53%	0.01%	0.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.38%	0.02%	6.69%	0.01%	0.69%	0.01%

(3) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E

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
自基金分级生效日起至今	0.56%	0.02%	0.43%	0.01%	0.13%	0.01%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 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

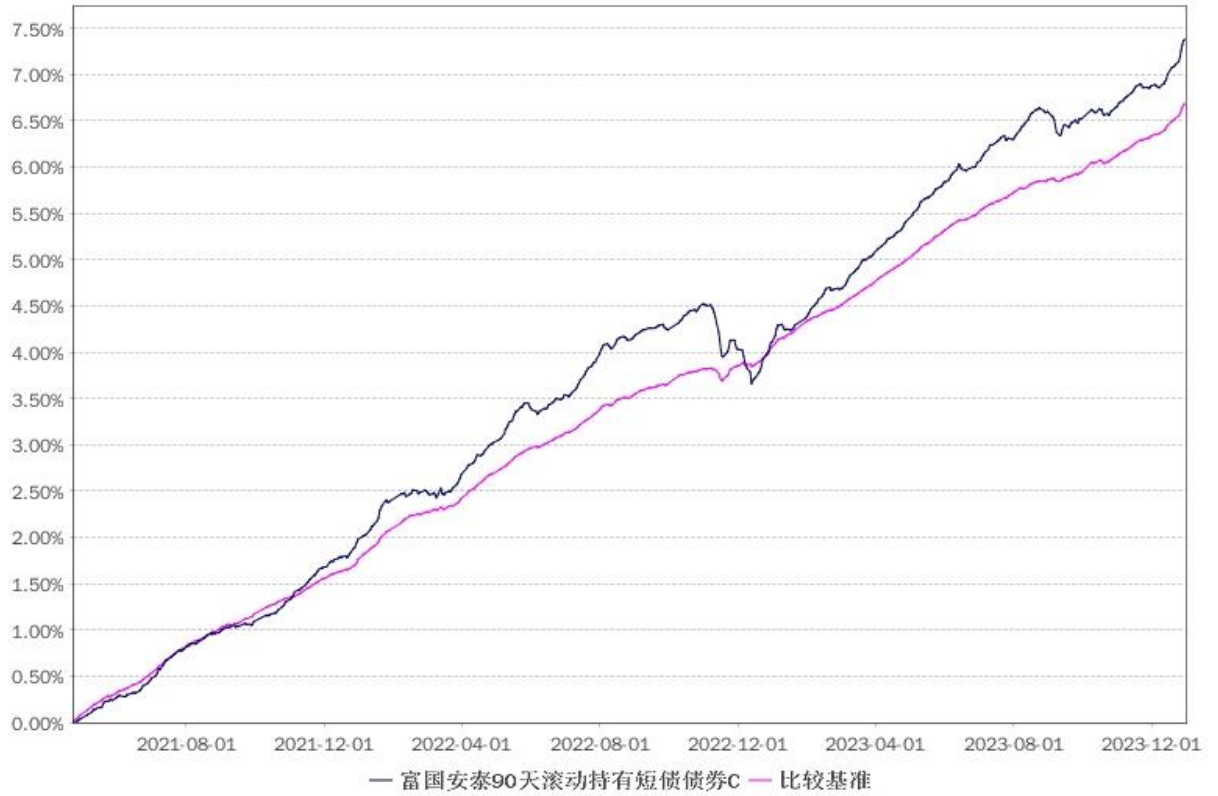
(1) 自基金合同生效以来富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金于2021年4月23日成立，建仓期6个月，从2021年4月23日起至2021年10月22日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

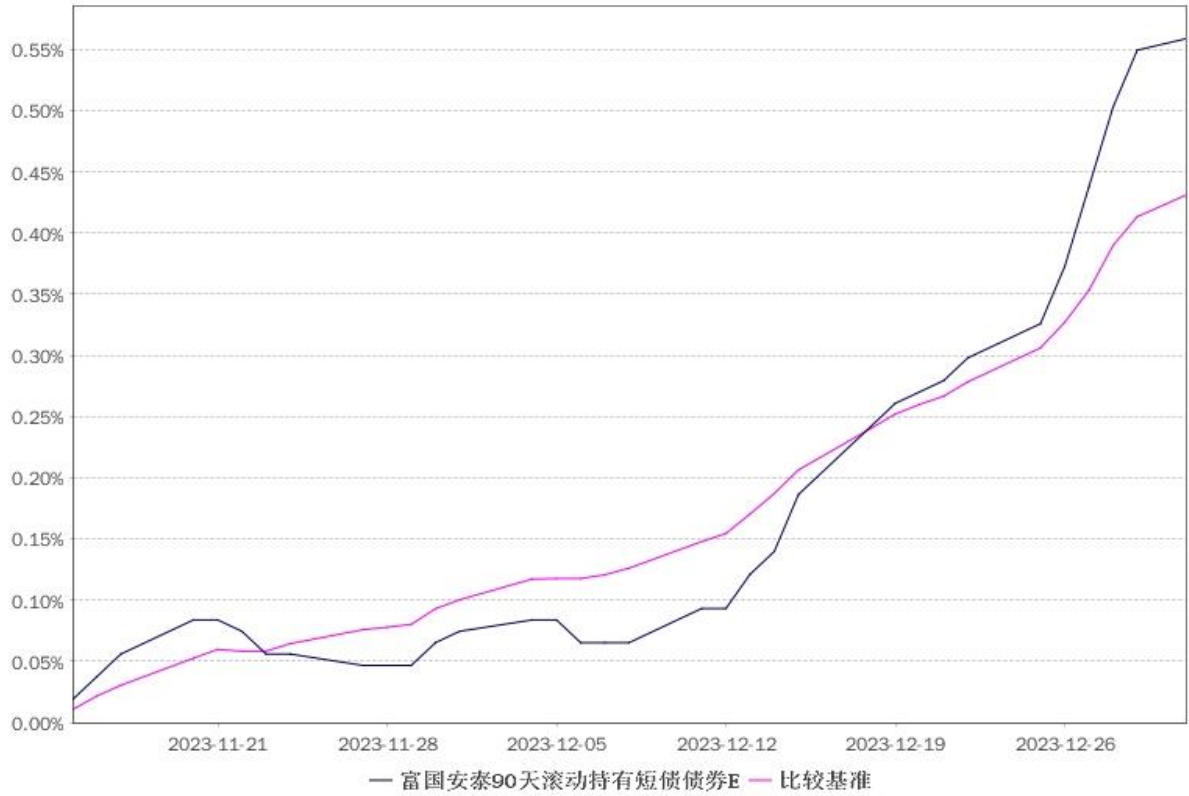
(2)自基金合同生效以来富国安泰90天滚动持有短债债券C基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金于2021年4月23日成立，建仓期6个月，从2021年4月23日起至2021年10月22日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(3)自基合同生效以来富国安泰90天滚动持有短债债券E基金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

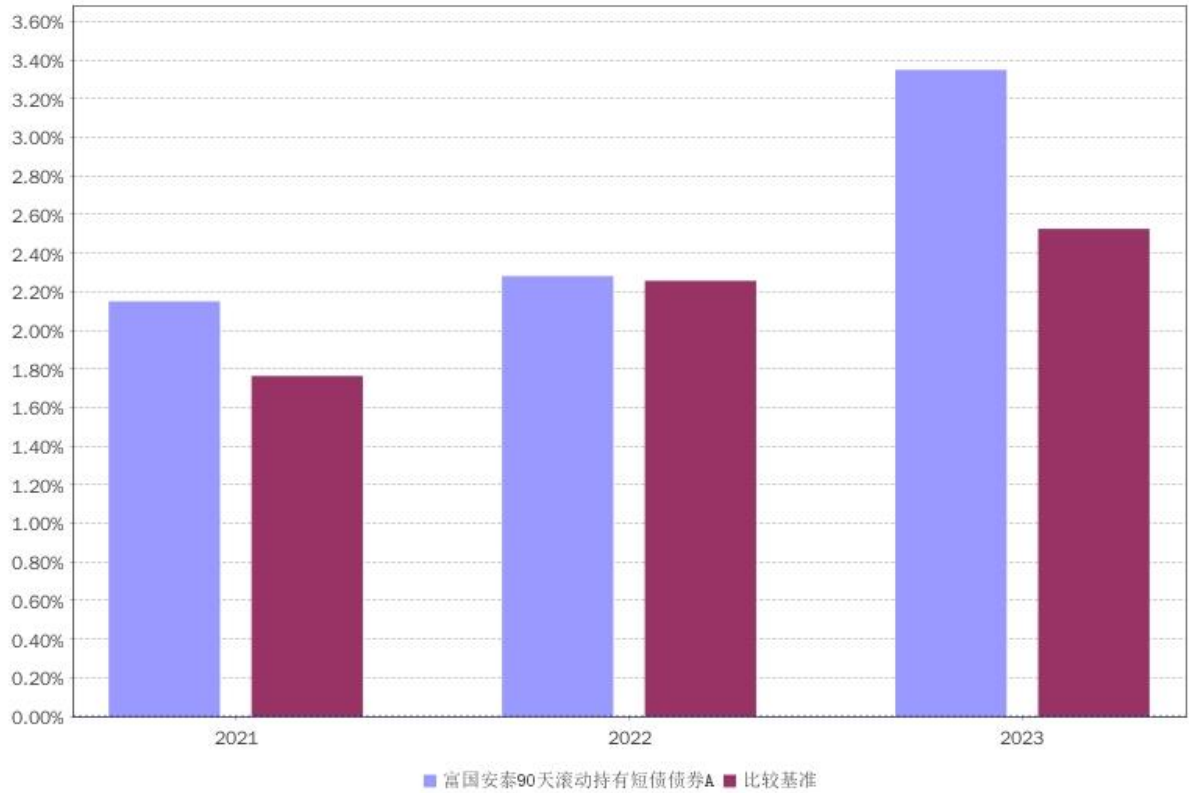


注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金自2023年11月14日起增加E类份额，相关数据按实际存续期计算。

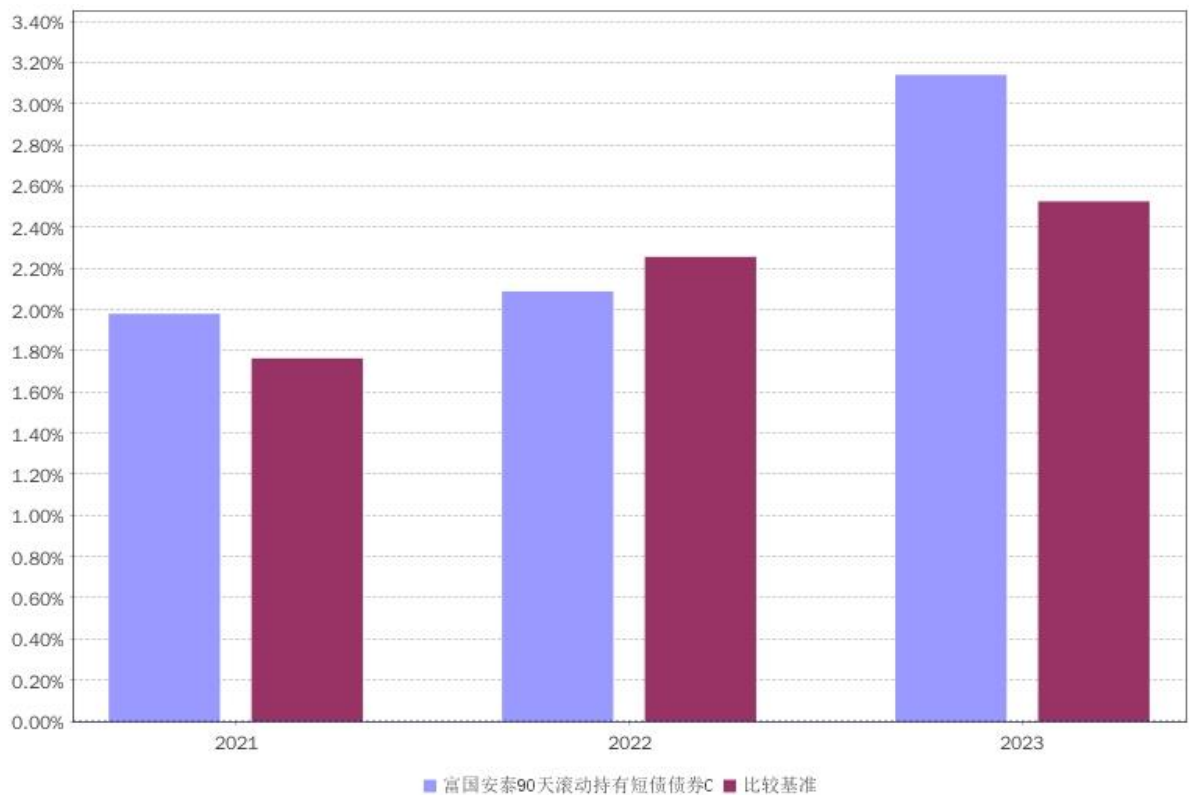
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1)自基金合同生效以来富国安泰90天滚动持有短债债券A基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



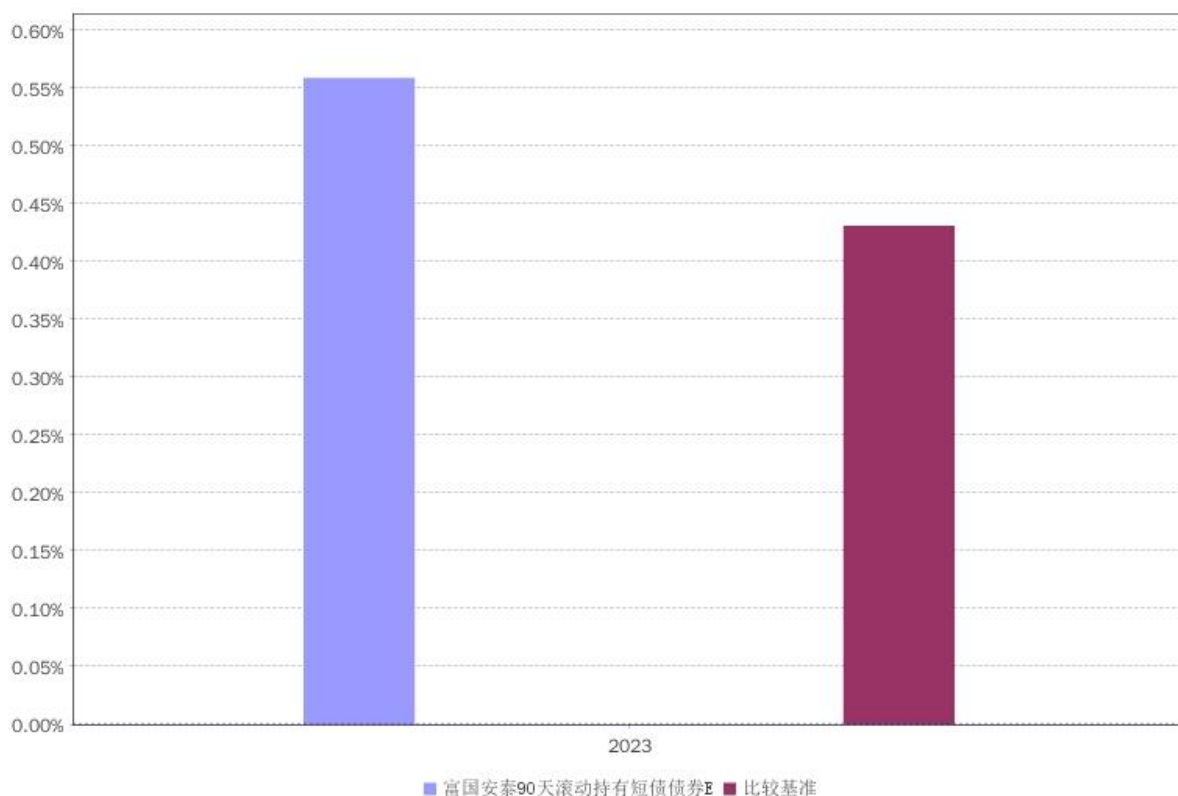
注：2021 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2021 年按实际存续期计算。

(3) 自基金合同生效以来富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：E 类份额自 2023 年 11 月 15 日起有基金份额。2023 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A

注：本基金 2021 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配

(2) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C

注：本基金 2021 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配

(3) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E

注：本基金 2021 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注

册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 330 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴旅忠	本基金现任基金经理	2021-04-23	—	16	硕士，曾任国泰君安证券投资经理，中银基金管理有限公司基金经理；自 2018 年 10 月加入富国基金管理有限公司，自 2019 年 1 月起历任固定收益基金经理、固定收益策略研究部固定收益投资总监助理、固定收益策略研究部固定收益投资副总监；现任富国基金固定收益策略研究部副总经理，兼任富国基金固定收益基金经理。自 2019 年 02 月起任富国安益货币市场基



					金(原富国收益宝货币市场基金)基金经理；自 2019 年 02 月起任富国富钱包货币市场基金基金经理；自 2019 年 02 月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；自 2019 年 02 月起任富国天时货币市场基金基金经理；自 2019 年 04 月起任富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 12 月起任富国中债 0-2 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 04 月起任富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国安慧短债债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 07 月起任富国安瑞 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国安恒 60 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
罗石	本基金现任基金经理助理	2022-01-04	—	14	硕士，曾任华宝兴业基金管理有限公司交易员，交易主管，交易部总经理助理，基金经理助理；自 2019 年 4 月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、固定收益基金经理助理岗；现任富国基金固定收益策略研究部固定收益基金经理助理。自 2022 年 01 月起任富国安福 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金经理助理；自 2022 年 01 月起任富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理助理；自 2022 年 01 月起任富国富钱包货币市场基金基金经理助理；自 2022 年 01 月起任富国天时货币市场基金基金经理助理；自 2022 年 02 月起任富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理；自 2022 年 02 月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理助理；自 2023 年 02 月起任富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金

					基金经理助理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	------------------

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2023年西方国家大多处加息周期，通胀高位回落。美国经济隐现走弱信号，制造业PMI回落至50的荣枯线之下，但就业数据向好，非农就业人数不断攀升，通胀在美联储持续加息下，有所回落。美国国债10年走势先大幅攀升，高点接近5%，4季度，降息预期在修正中逐渐升温，收益率开始下行。

2023年国内经济总体向好，全年GDP增速5.2%，但复苏基础仍较为薄弱，2季度后，增速有所放缓。在去年末疫情放开、房地产调控政策松绑等多重利好

带动下，年初各项数据冲高态势明显：2月份的PMI到52.6的年内高位，M2增速高达12.9%，为2016年以来的次高点。2季度开始经济整体有所回落：PMI从4月到8月，连续5个月处于荣枯线之下，9月略回升至50.2，而后再于10-12月份回落至50之下。出口同比增速7月降至-14.2%；房地产投资增速则从年初-5.7%降至年末-9.6%，房地产调控政策松绑的效果不如预期。全年通胀持续走弱，PPI处负值区间，其中6月份触及年内最低值-5.4%，而后回升至-2--3%之间波动，CPI则从2.1%逐月下滑至-0.3%，通缩压力渐起。

货币政策方面，全年下调存款准备金率两次，3月底、9月底各下调25bp；并于6月、8月份分别下调MLF10bp、15bp至2.5%。下半年起，经济触底企稳，央行更加重视防范资金空转，人民币贬值压力也在一定程度上掣肘利率空间，银行间隔夜资金价格始终处于政策利率之上且资金波动加大。

全年信用债券走势与经济、政策面等高度相关。高等级信用债市场则受流动性影响更大：年初银行间市场流动性波动较大，1年期限AAA等级信用债中债估值收益率从年初低点2.55%上行至3月初2.86%，上行约31bp；1季末随着央行降准释放流动性，资金面转松，收益率一路下行；8月中旬起，资金中枢逐步抬升至政策利率之上，流动性分层明显，收益率持续反弹至2.83%；下旬进入跨年行情，收益率快速回落至年末2.52%。受去年末债市调整影响，高收益信用债利差维持高位，2023年市场转暖，信用利差持续压缩。其中，高收益城投债受益于政策面呵护，压缩幅度更为明显，且在3季度走出独立于债市调整的收益率下行行情，1年期限中债评级AA-与AAA的信用等级利差从年初约292bp压缩至年末44bp。

2023年全年，基金管理人严格按照基金合同进行投资管理，优先保证基金资产的流动性和安全性，在此基础上提升组合的收益。基金管理人秉承稳健投资原则谨慎操作，根据市场行情、政策面变化等情况，执行有效的投资策略，灵活调整各类资产比例、杠杆比率和剩余期限，严控组合流动性风险、利率风险和信用风险，组合整体运行状况良好。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2023年12月31日，本基金份额净值A级为1.0798元，C级为1.0738元，E级为1.0798元；份额累计净值A级为1.0798元，C级为1.0738元，E级为1.0798元；本报告期，本基金份额净值增长率A级为3.35%，C级为3.14%，

E 级为 0.56%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.53%，C 级为 2.53%，E 级为 0.43%。

#### **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，美国大概率降息，美债收益率或将回落，有利于中美利差压缩，缓解人民币压力。国内经济仍处于弱复苏态势，房地产投资增速预期转正概率不大；受贸易摩擦、外围经济增速放缓等各因素综合影响，出口预期仍维持低位。货币政策与财政等宏观经济政策配合更加协同、紧密，结构化货币工具持续发力，总量型货币政策亦可期。在金融强监管大背景下，防范资金脱实向虚仍将是央行多重政策目标之一，银行间资金价格将继续围绕政策利率附近波动。需要密切关注短债类产品规模增长所带来的配置需求对短端信用资产利差压缩的持续影响，执行有效的投资策略。

基金管理人将保持审慎操作的态度，在保证安全性和流动性的前提下，严控信用风险，积极把握短债市场交易机会，合理调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，勤勉尽责，力争为持有人创造更多超额收益。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

##### **（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展**

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控管理与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

##### **（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地**

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

##### **（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识**

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，

多管齐下全面提升员工的合规意识。

#### （四）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

#### （五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

#### （六）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理及廉洁从业管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，加强员工行为管理，确保各项业务合规开展。

#### （七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

#### （八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、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》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **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**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，基金托管人在富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，富国基金管理有限公司在富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### **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**

本报告期内，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国

安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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	安永华明（2024）审字第 70015656_B193 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	富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金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，公允反映了富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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



	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>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。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资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,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的财务报告过程。</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。</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>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制</p>

	<p>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>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资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富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王珊珊   费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体:富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日:2023 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	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	194,662.38	129,412.63
结算备付金	12,399,512.11	12,667,254.21
存出保证金	9,473.82	4,284.53
交易性金融资产	1,399,352,128.6 2	1,737,271,610.31
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	1,387,405,805.6 2	1,725,226,477.16
资产支持证券投资	11,946,323.00	12,045,133.15
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	10,752,643.83	—
应收股利	—	—
应收申购款	1,781,493.01	1,024,264.85
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,424,489,913.7 7	1,751,096,826.53
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> <b>2023 年 12 月</b> <b>31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2022 年 12 月 31</b> <b>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	400,212,430.41	351,901,545.77
应付清算款	214,082.46	107,204.22
应付赎回款	1,215,895.99	6,059,585.94
应付管理人报酬	173,262.82	248,416.00
应付托管费	43,315.71	62,103.96
应付销售服务费	165,893.45	234,246.38
应付投资顾问费	—	—
应交税费	65,851.94	89,656.47
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	200,247.67	79,740.14

负债合计	402,290,980.45	358,782,498.88
<b>净资产：</b>		
实收基金	951,687,187.70	1,337,090,617.33
其他综合收益	—	—
未分配利润	70,511,745.62	55,223,710.32
净资产合计	1,022,198,933.32	1,392,314,327.65
负债和净资产总计	1,424,489,913.77	1,751,096,826.53

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0741 元，基金份额总额 951,687,187.70 份。其中：富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A 份额净值 1.0798 元，份额总额 40,337,791.44 份；富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C 份额净值 1.0738 元，份额总额 911,348,464.99 份；富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E 份额净值 1.0798 元，份额总额 931.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

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)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日)
<b>一、营业总收入</b>	48,613,655.93	56,668,157.94
1.利息收入	244,029.59	1,027,928.65
其中：存款利息收入	203,440.71	886,930.82
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	40,588.88	140,997.83
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	40,978,642.33	64,482,646.49
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	40,599,291.91	64,182,959.74
资产支持证券投资收益	379,350.42	299,686.75
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）	7,390,984.01	-8,842,417.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>13,233,655.02</b>	<b>17,095,570.33</b>
1. 管理人报酬	2,278,708.07	3,636,623.71
2. 托管费	569,677.00	909,155.82
3. 销售服务费	2,184,349.40	3,517,361.05
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	7,835,014.78	8,598,414.21
其中：卖出回购金融资产支出	7,835,014.78	8,598,414.21
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	101,275.66	163,190.22
8. 其他费用	264,630.11	270,825.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>35,380,000.91</b>	<b>39,572,587.61</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>35,380,000.91</b>	<b>39,572,587.61</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>35,380,000.91</b>	<b>39,572,587.61</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

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	1,337,090,617.33	55,223,710.32	1,392,314,327.65
二、本期期初净资产	1,337,090,617.33	55,223,710.32	1,392,314,327.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	385,403,429.63	15,288,035.30	370,115,394.33
（一）、综合收益总额	—	35,380,000.91	35,380,000.91
（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）	385,403,429.63	20,091,965.61	405,495,395.24
其中：1. 基金申购款	336,520,582.27	19,131,551.78	355,652,134.05
2. 基金赎回款	—	—	—

	721,924,011 .90	39,223,517. 39	761,147,529 .29
(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）	—	—	—
四、本期期末净资产	951,687,187. 70	70,511,745.6 2	1,022,198,93 3.32
<b>项目</b>	<b>上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年12月31日)</b>		
	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>净资产合计</b>
一、上期期末净资产	2,375,219,80 0.78	47,117,257.3 2	2,422,337,05 8.10
二、本期期初净资产	2,375,219,80 0.78	47,117,257.3 2	2,422,337,05 8.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	— 1,038,129,18 3.45	— 8,106,453.00	— 1,030,022,73 0.45
(一)、综合收益总额	—	39,572,587.6 1	39,572,587.6 1
(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）	— 1,038,129,18 3.45	— 31,466,134.6 1	— 1,069,595,31 8.06
其中：1.基金申购款	962,579,254. 55	31,437,649.4 8	994,016,904. 03
2.基金赎回款	— 2,000,708,43 8.00	— 62,903,784.0 9	— 2,063,612,22 2.09
(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）	—	—	—
四、本期期末净资产	1,337,090,61 7.33	55,223,710.3 2	1,392,314,32 7.65

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：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人  
基金管理人

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

富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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〔2021〕1038 号《关于准予富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 4 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 214,456,357.29 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2023 年 11 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 11 月 14 日起，本基金增加 E 类份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、国债期货等，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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指短期债券为剩余期限或回售期限不超过 397 天（含）的债券资产，主要包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等金融工具。本基金管理人将基于审慎原则，根据

法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法，并与基金托管人协商一致，计算其剩余期限。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1年以下）指数收益率\*90%+银行一年期定期存款利率（税后）\*10%。

#### **7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金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、完整地反映了本基金于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日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2023年1月1日至2023年12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。



#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显

著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，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) 不存在活跃市场的金融工具，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，才使用不可观察输入值；

(3) 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，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。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

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计

提；

(4) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其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；

(5) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### **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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。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**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满3个月，本基金可不进行收益分配；

2、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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权，由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额红利再投资所获得份额的运作期起始日和运作期到期日与原份额相同；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

#### **1 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增

增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

## 2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

#### 4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 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	194,662.38	129,412.63
等于：本金	193,177.61	129,201.68
加：应计利息	1,484.77	210.95
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	194,662.38	129,412.63

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

##### 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	305,607,402.82	3,365,584.04	309,766,784.04	793,797.18
	银行间市场	1,061,574,201.72	13,302,121.58	1,077,639,021.58	2,762,698.28



	合计	1,367,181,604.54	16,667,705.62	1,387,405,805.62	3,556,495.46
资产支持证券		11,882,400.00	56,723.00	11,946,323.00	7,200.00
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,379,064,004.54	16,724,428.62	1,399,352,128.62	3,563,695.46
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	251,606,601.66	3,532,598.38	253,373,598.38	—
	银行间市场	1,457,809,086.89	16,105,478.78	1,471,852,878.78	—
	合计	1,709,415,688.55	19,638,077.16	1,725,226,477.16	—
资产支持证券		12,000,000.00	45,133.15	12,045,133.15	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,721,415,688.55	19,683,210.31	1,737,271,610.31	—

### 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：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 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	—	—
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	27,247.67	26,740.14
其中：交易所市场	—	—
银行间市场	27,247.67	26,740.14
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	—
预提审计费	53,000.00	53,000.00
合计	200,247.67	79,740.14

#### 7.4.7.7 实收基金

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A：

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	64,039,328.72	64,039,328.72
本期申购	24,461,224.11	24,461,224.11
本期赎回（以“-”号填列）	-48,162,761.39	-48,162,761.39
本期末	40,337,791.44	40,337,791.44

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C：

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	1,273,051,288.61	1,273,051,288.61
本期申购	312,058,426.89	312,058,426.89
本期赎回（以“-”号填列）	-673,761,250.51	-673,761,250.51
本期末	911,348,464.99	911,348,464.99

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E：

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	—	—
本期申购	931.27	931.27
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	931.27	931.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A:

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	3,073,872.15	- 202,049.53	2,871,822.62
本期期初	3,073,872.15	- 202,049.53	2,871,822.62
本期利润	1,243,856.85	318,295.10	1,562,151.95
本期基金份额交易产生的变动数	- 1,240,596.45	26,869.13	-1,213,727.32
其中：基金申购款	1,492,384.91	47,711.03	1,540,095.94
基金赎回款	- 2,732,981.36	-20,841.90	-2,753,823.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,077,132.55	143,114.70	3,220,247.25

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C:

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	56,352,890.28	- 4,001,002.58	52,351,887.70
本期期初	56,352,890.28	- 4,001,002.58	52,351,887.70
本期利润	26,745,156.89	7,072,686.48	33,817,843.37
本期基金份额交易产生的变动数	- 19,027,302.74	148,995.72	-18,878,307.02
其中：基金申购款	17,005,726.24	585,660.87	17,591,387.11
基金赎回款	- 36,033,028.98	-436,665.15	-36,469,694.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,070,744.43	3,220,679.62	67,291,424.05

富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E:

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3.16	2.43	5.59
本期基金份额交易产生的变动数	67.86	0.87	68.73
其中：基金申购款	67.86	0.87	68.73
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71.02	3.30	74.32

### 7.4.7.9 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	43,915.29	329,651.57
定期存款利息收入	—	339,075.00
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	159,471.51	217,766.93
其他	53.91	437.32
合计	203,440.71	886,930.82

### 7.4.7.10 股票投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖股票差价收入。

### 7.4.7.11 债券投资收益

#### 7.4.7.11.1 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	43,621,778.31	68,511,235.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,022,486.40	-4,328,276.17
合计	40,599,291.91	64,182,959.74

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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	2,497,664,679.69	5,564,757,257.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,460,438,501.80	5,485,971,360.22
减：应计利息总额	40,219,665.54	83,058,252.62
减：交易费用	28,998.75	55,921.02
买卖债券差价收入	-3,022,486.40	-4,328,276.17

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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	379,350.42	299,686.75
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	—	—
合计	379,350.42	299,686.75

##### 7.4.7.12.2 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）
卖出资产支持证券成交总额	117,600.00	22,177,793.40
减：卖出资产支持证券成本总额	117,600.00	21,861,000.00
减：应计利息总额	—	316,793.40
减：交易费用	—	—
资产支持证券投资收益	—	—

##### 7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

##### 7.4.7.14 衍生工具收益

###### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

###### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

##### 7.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.16 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	7,390,984.01	-8,842,417.20
股票投资	—	—
债券投资	7,383,784.01	-8,805,317.20
资产支持证券投资	7,200.00	-37,100.00
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	7,390,984.01	-8,842,417.20

#### 7.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 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	53,000.00	53,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	55,180.11	62,875.32
债券账户维护费	35,250.00	33,750.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	264,630.11	270,825.32

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 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（%）
申万宏源	233,668,660.60	100.00	331,650,976.99	88.44

###### 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	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	1,015,760,000.00	4.23	1,803,025,000.00	6.79
申万宏源	2,361,047,000.00	9.83	5,934,470,000.00	22.36

#### 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均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（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管理费	2,278,708.07	3,636,623.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,138,574.77	1,817,471.76
应支付基金管理人的净管理费	1,140,133.30	1,819,151.95

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 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	569,677.00	909,155.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计



算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	363.50	—	363.50
交通银行股份有限公司	—	2,945.45	—	2,945.45
合计	—	3,308.95	—	3,308.95

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费			
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	438.07	—	438.07
交通银行股份有限公司	—	8,796.31	—	8,796.31
合计	—	9,234.38	—	9,234.38

注：自 2023 年 11 月 14 日起，本基金增加收取销售服务费的 E 类基金份额。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提，E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金份额资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（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:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

##### 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:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 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

注:本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 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:本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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(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
交通银行股份有限公司	194,662.38	43,915.29	129,412.63	329,651.57

#### 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:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

##### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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 2023 年 12 月 31 日止，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为人民币 216,584,595.24 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末估值总额
012381806	23 衢通发展 SCP003	2024-01-02	101.71	200,000	20,342,459.02
012382262	23 广州高新 SCP004	2024-01-02	101.29	100,000	10,128,568.31
012382262	23 广州高新 SCP004	2024-01-02	101.29	100,000	10,128,568.31
012382734	23 宿迁水务 SCP003	2024-01-02	101.00	200,000	20,200,548.63
012383216	23 武进经发 SCP007	2024-01-02	100.74	100,000	10,074,363.93

012383305	23 瘦西湖 SCP007	2024-01-02	100.75	200,000	20,150,426.23
012383530	23 赣州城 投 SCP003	2024-01-02	100.84	100,000	10,084,289.62
012383721	23 东方新 城 SCP005	2024-01-02	100.50	20,000	2,010,007.65
012383796	23 金华轨 交 SCP003	2024-01-02	100.42	60,000	6,025,190.16
012383874	23 海宁皮 革 SCP002	2024-01-02	100.47	100,000	10,047,419.67
012383908	23 广东农 垦 SCP002	2024-01-02	100.48	100,000	10,047,808.74
042380145	23 良渚文 化 CP003	2024-01-02	102.46	200,000	20,491,573.77
101900185	19 宜昌城 控 MTN002	2024-01-02	104.34	150,000	15,651,421.64
101901133	19 克拉玛 依 MTN001	2024-01-02	102.89	140,000	14,405,013.11
102101624	21 吴江城 投 MTN002	2024-01-02	101.57	100,000	10,156,919.13
230306	23 进出 06	2024-01-02	100.45	420,000	42,187,955.74
合计				2,290,000	232,132,533.66

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 183,627,835.17 元，于 2024 年 1 月 2 日、2024 年 1 月 9 日、2024 年 1 月 12 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有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涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险

及市场风险。本基金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。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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发行的证券，不得超过该证券的 10%。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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

##### 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	50,529,438.36	30,288,041.10
A-1 以下	—	—
未评级	377,033,444.57	774,791,694.22
合计	427,562,882.93	805,079,735.32

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
--------	-----------------------	------------------------

AAA	507,909,853.05	417,321,210.97
AAA 以下	88,102,317.25	142,549,385.19
未评级	220,890,710.64	197,216,080.56
合计	816,902,880.94	757,086,676.72

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.3 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
AAA	11,946,323.00	12,045,133.15
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	11,946,323.00	12,045,133.15

注：此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易

对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。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资产的公允价值。本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	194,662.38	—	—	—	—	—	194,662.38
结算备付金	12,399,512.11	—	—	—	—	—	12,399,512.11
存出保证金	9,473.82	—	—	—	—	—	9,473.82
交易性金融资产	30,743,574.09	140,583,228.86	768,178,345.70	459,846,979.97	—	—	1,399,352,128.62
应收清算款	—	—	—	—	—	10,752,643.83	10,752,643.83
应收申购款	—	—	—	—	—	1,781,493.01	1,781,493.01
资产总计	43,347,222.40	140,583,228.86	768,178,345.70	459,846,979.97	—	12,534,136.84	1,424,489,913.77
负债							
卖出回购金融资产款	400,212,430.41	—	—	—	—	—	400,212,430.41
应付清算款	—	—	—	—	—	214,082.46	214,082.46
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,215,895.99	1,215,895.99
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	173,262.82	173,262.82
应付托管费	—	—	—	—	—	43,315.71	43,315.71
应付销售服务费	—	—	—	—	—	165,893.45	165,893.45
应交税费	—	—	—	—	—	65,851.94	65,851.94
其他负债	—	—	—	—	—	200,247.67	200,247.67
负债总计	400,212,430.41	—	—	—	—	2,078,550.04	402,290,980.45
利率敏感度缺口	-356,865,208.01	140,583,228.86	768,178,345.70	459,846,979.97	—	10,455,586.80	1,022,198,933.32
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计



资产							
货币资金	129,412.63	—	—	—	—	—	129,412.63
结算备付金	12,667,254.21	—	—	—	—	—	12,667,254.21
存出保证金	4,284.53	—	—	—	—	—	4,284.53
交易性金融资产	121,406,002.10	305,838,366.03	806,945,824.08	503,081,418.10	—	—	1,737,271,610.31
应收申购款	—	—	—	—	—	1,024,264.85	1,024,264.85
资产总计	134,206,953.47	305,838,366.03	806,945,824.08	503,081,418.10	—	1,024,264.85	1,751,096,826.53
负债							
卖出回购金融资产款	351,901,545.77	—	—	—	—	—	351,901,545.77
应付清算款	—	—	—	—	—	107,204.22	107,204.22
应付赎回款	—	—	—	—	—	6,059,585.94	6,059,585.94
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	248,416.00	248,416.00
应付托管费	—	—	—	—	—	62,103.96	62,103.96
应付销售服务费	—	—	—	—	—	234,246.38	234,246.38
应交税费	—	—	—	—	—	89,656.47	89,656.47
其他负债	—	—	—	—	—	79,740.14	79,740.14
负债总计	351,901,545.77	—	—	—	—	6,880,953.11	358,782,498.88
利率敏感度缺口	-217,694,592.30	305,838,366.03	806,945,824.08	503,081,418.10	—	-5,856,688.26	1,392,314,327.65

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-1,751,325.12	-1,568,579.36
	2. 基准点利率减少 0.1%	1,751,325.12	1,568,579.36

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场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市场价格风险，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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、

通知存款等)、同业存单、现金等货币市场工具、国债期货等,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,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指短期债券为剩余期限或回售期限不超过397天(含)的债券资产,主要包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券(含超短期融资券)、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等金融工具。本基金管理人将基于审慎原则,根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法,并与基金托管人协商一致,计算其剩余期限。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

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—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,387,405,805.62	135.73	1,725,226,477.16	123.91
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	11,946,323.00	1.17	12,045,133.15	0.87
合计	1,399,352,128.62	136.90	1,737,271,610.31	124.78

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本期末及上期末未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券,

因此其他价格风险因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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	—	—
第二层次	1,399,352,128.62	1,737,271,610.31
第三层次	—	—
合计	1,399,352,128.62	1,737,271,610.31

###### 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日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债,这些金融工具因其剩余期限较短,所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 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	1,399,352,128.62	98.24
	其中:债券	1,387,405,805.62	97.40
	资产支持证券	11,946,323.00	0.84
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	12,594,174.49	0.88
8	其他各项资产	12,543,610.66	0.88
9	合计	1,424,489,913.77	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 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境内股票资产。

#### 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资产。

## 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进行股票投资。

### 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进行股票投资。

### 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进行股票投资。

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	618,404,919.50	60.50
	其中：政策性金融债	142,940,041.75	13.98
4	企业债券	80,425,686.39	7.87
5	企业短期融资券	377,033,444.57	36.88
6	中期票据	311,541,755.16	30.48
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,387,405,805.62	135.73

## 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	230306	23 进出 06	600,000	60,268,508.20	5.90
2	138892	23 平证 02	500,000	51,736,430.14	5.06
3	115473	23 光证 S1	500,000	50,529,438.36	4.94
4	240342	23 信达 02	440,000	44,164,702.25	4.32
5	1928014	19 华夏银行永续 债	400,000	41,393,442.62	4.05

## 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

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	112130	沪建 02 优	120,000	11,946,323.0 0	1.17
---	--------	---------	---------	-------------------	------

### 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 声明本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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，光大证券股份有限公司在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期末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 声明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	9,473.82
2	应收清算款	10,752,643.83
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,781,493.01
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,543,610.66

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## §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

份额级别	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 (%)
富国安泰 90 天 滚动持有短债	21,777	1,852.31	—	—	40,337,791.44	100.00



债券 A						
富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	59,871	15,221.87	—	—	911,348,464.99	100.00
富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	1	931.27	—	—	931.27	100.00
合计	81,649	11,655.83	—	—	951,687,187.70	100.00

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	38,512.91	0.0955
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	238,636.97	0.0262
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	931.27	100.0000
	合计	278,081.15	0.0292

### 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的情况

项目	份额级别	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	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	0~10
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	0
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	0

	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	0
	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C	富国安泰 90 天滚动持有短债债券 E
基金合同生效日(2021 年 04 月 23 日)基金份额总额	115,959,544.81	98,496,812.48	—
报告期期初基金份额总额	64,039,328.72	1,273,051,288.61	—
本报告期基金总申购份额	24,461,224.11	312,058,426.89	931.27
减：本报告期基金总赎回份额	48,162,761.39	673,761,250.51	—
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—	—
报告期期末基金份额总额	40,337,791.44	911,348,464.99	931.27

注：本基金自 2023 年 11 月 14 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布公告，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

本报告期内本基金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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 5.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 21 年。

## 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未受稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 本期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 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金财富	2	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—

中信证券	1	—	—	—	—	—
------	---	---	---	---	---	---

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：国盛证券（723820）。

### 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 (%)
长城证券	—	—	885,387,000.00	3.69	—	—
方正证券	—	—	2,687,481,000.00	11.19	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	1,163,042,000.00	4.84	—	—
海通证券	—	—	1,015,760,000.00	4.23	—	—
华泰证券	—	—	2,405,193,000.00	10.01	—	—
平安证券	—	—	1,621,816,000.00	6.75	—	—
申万宏源	233,668,660.60	100.00	2,361,047,000.00	9.83	—	—
银河证券	—	—	5,084,486,000.00	21.16	—	—
招商证券	—	—	1,177,082,000.00	4.90	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金财富	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	1,792,416,000.00	7.46	—	—
中泰证券	—	—	2,284,463,000.00	9.51	—	—
中信证券	—	—	1,548,272,000.00	6.44	—	—

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金暂停通过直销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 10 日
2	富国基金管理有限公司关于富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 10 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整发售对象并修改招募说明书等事项的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 23 日
4	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 23 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和《富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2023 年 11 月 14 日起，对本基金增加 E 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的

公告》及修订后的基金合同、托管协议。二、本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。三、本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和相关基金合同的约定，基金管理人决定自 2023 年 11 月 27 日起调整本基金的发售对象。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整发售对象并修改招募说明书等事项的公告》及修改后的招募说明书等法律文件。

### § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的文件	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同		
3、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金财务报表及报表附注		
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		