

# 富国收益宝交易型货币市场基金

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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.....	7
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.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	16
§4 管理人报告 .....	17
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	17
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	20
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	25
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	25
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 .....	25
§5 托管人报告 .....	26
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	26
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.....	26
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 .....	26
§6 审计报告 .....	26
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
§7 年度财务报告 .....	29
7.1 资产负债表.....	29

7.2 利润表.....	30
7.3 净资产变动表.....	32
7.4 报表附注.....	33
§8 投资组合报告.....	63
8.1 期末基金资产组合情况.....	63
8.2 债券回购融资情况.....	63
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	63
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	65
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	65
8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	65
8.9 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	68
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.5 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.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	69
§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.....	70
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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	72
11.9 其他重大事件.....	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73

§13 备查文件目录 ..... 74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国收益宝交易型货币市场基金			
基金简称	富国收益宝交易型货币			
基金主代码	511900			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2015年11月24日			
基金管理人	富国基金管理有限公司			
基金托管人	中国银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	28,669,392,207.29份			
基金合同存续期	不定期			
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所			
上市日期	2015年12月9日			
下属分级基金的基金简称	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币C	富国收益宝交易型货币H
下属分级基金场内简称	—	—	—	富国货币ETF
下属分级基金的交易代码	001981	001982	018320	511900
报告期末下属分级基金的份额总额	9,449,602,930.19份	18,611,905,677.46份	8,676,197.73份	599,207,401.91份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。本基金具体总体资产、类别资产配置策略、明细资产选择和交易策略详见法律文件。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1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	A类、B类、C类份额登记机构:富国基金管理有限公司;H类份额登记机构:中国证券登记结算有限责任公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 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

##### (1) 富国收益宝交易型货币 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
本期已实现收益	174,639,807.53	104,530,490.20	3,894,671.93
本期利润	174,639,807.53	104,530,490.20	3,894,671.93
本期净值收益率	1.8712%	1.6800%	2.1082%
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
期末基金资产净值	9,449,602,930.19	9,564,842,169.08	530,018,263.78
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
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
累计净值收益率	21.7293%	19.4933%	17.5191%

##### (2) 富国收益宝交易型货币 B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	434,502,630.79	394,068,494.82	517,362,510.13
本期利润	434,502,630.79	394,068,494.82	517,362,510.13
本期净值收益率	2.1160%	1.9356%	2.3672%
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
期末基金资产净值	18,611,905,677.46	12,709,520,049.25	18,172,368,487.82
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
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
累计净值收益率	23.4314%	20.8737%	18.5785%

##### (3) 富国收益宝交易型货币 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
本期已实现收益	40,821.04	—	—
本期利润	40,821.04	—	—
本期净值收益率	1.3193%	—	—
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
期末基金资产净值	8,676,197.73	—	—
期末基金份额净值	1.0000	—	—



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
累计净值收益率	1.3193%	—	—

(4) 富国收益宝交易型货币 H

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	16,307,684.81	14,840,223.08	4,364,811.76
本期利润	16,307,684.81	14,840,223.08	4,364,811.76
本期净值收益率	1.8706%	1.6926%	2.1216%
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
期末基金资产净值	599,207,401.91	1,347,945,904.68	154,683,484.55
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
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
累计净值收益率	21.7769%	19.5408%	17.5512%

注：上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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。由于货币市场基金按实际利率计算账面价值，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。本产品自2023年4月13日起增加C类份额。

本基金利润分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国收益宝交易型货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.4665%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.3771%	0.0005%
过去六个月	0.9217%	0.0005%	0.1789%	0.0000%	0.7428%	0.0005%
过去一年	1.8712%	0.0006%	0.3549%	0.0000%	1.5163%	0.0006%
过去三年	5.7664%	0.0010%	1.0646%	0.0000%	4.7018%	0.0010%
过去五年	10.4711%	0.0012%	1.7753%	0.0000%	8.6958%	0.0012%
自基金合同生效起至今	21.7293%	0.0023%	2.8778%	0.0000%	18.8515%	0.0023%

(2) 富国收益宝交易型货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.5273%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.4379%	0.0005%
过去六个月	1.0439%	0.0005%	0.1789%	0.0000%	0.8650%	0.0005%
过去一年	2.1160%	0.0006%	0.3549%	0.0000%	1.7611%	0.0006%
过去三年	6.5567%	0.0010%	1.0646%	0.0000%	5.4921%	0.0010%
过去五年	11.8335%	0.0012%	1.7753%	0.0000%	10.0582%	0.0012%
自基金合同生效起至今	23.4314%	0.0025%	2.8778%	0.0000%	20.5536%	0.0025%

(3) 富国收益宝交易型货币 C

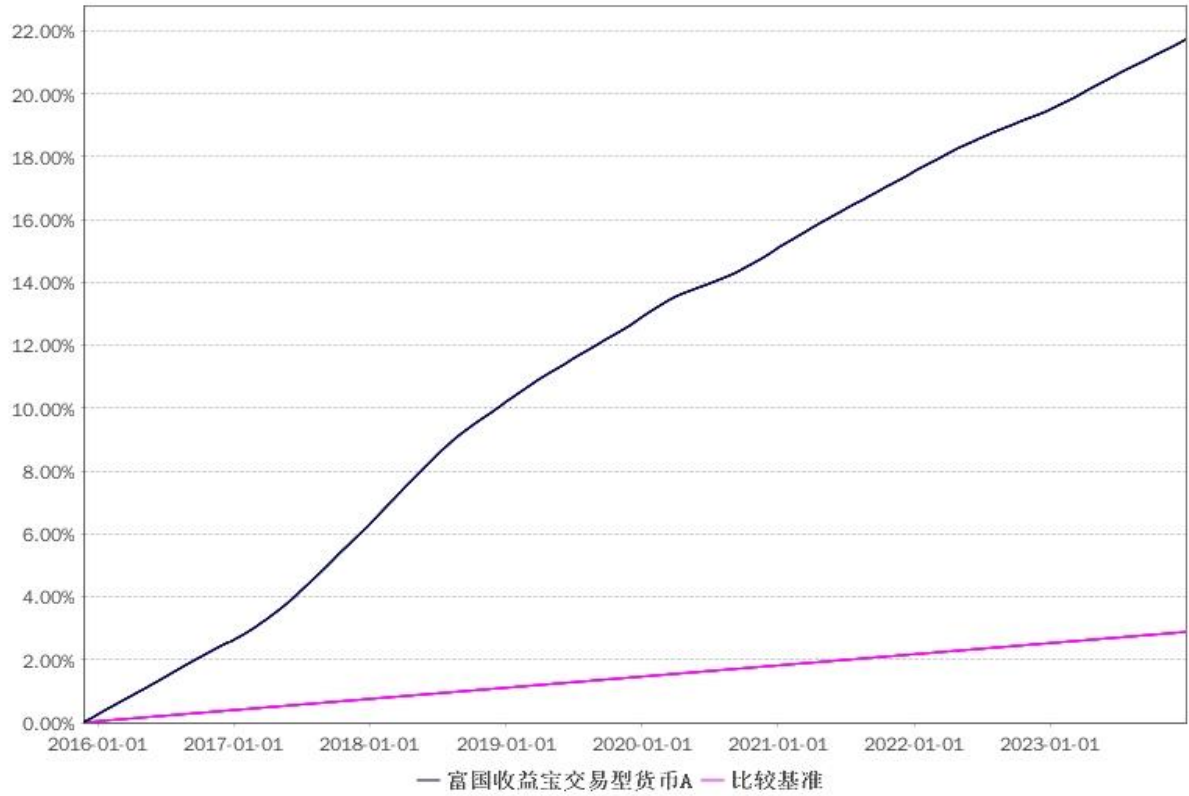
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4668%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.3774%	0.0005%
过去六个月	0.9211%	0.0005%	0.1789%	0.0000%	0.7422%	0.0005%
自基金分级生效日起至今	1.3193%	0.0005%	0.2547%	0.0000%	1.0646%	0.0005%

(4) 富国收益宝交易型货币 H

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.4664%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.3770%	0.0005%
过去六个月	0.9216%	0.0005%	0.1789%	0.0000%	0.7427%	0.0005%
过去一年	1.8706%	0.0006%	0.3549%	0.0000%	1.5157%	0.0006%
过去三年	5.7927%	0.0010%	1.0646%	0.0000%	4.7281%	0.0010%
过去五年	10.4903%	0.0012%	1.7753%	0.0000%	8.7150%	0.0012%
自基金合同生效起至今	21.7769%	0.0023%	2.8778%	0.0000%	18.8991%	0.0023%

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

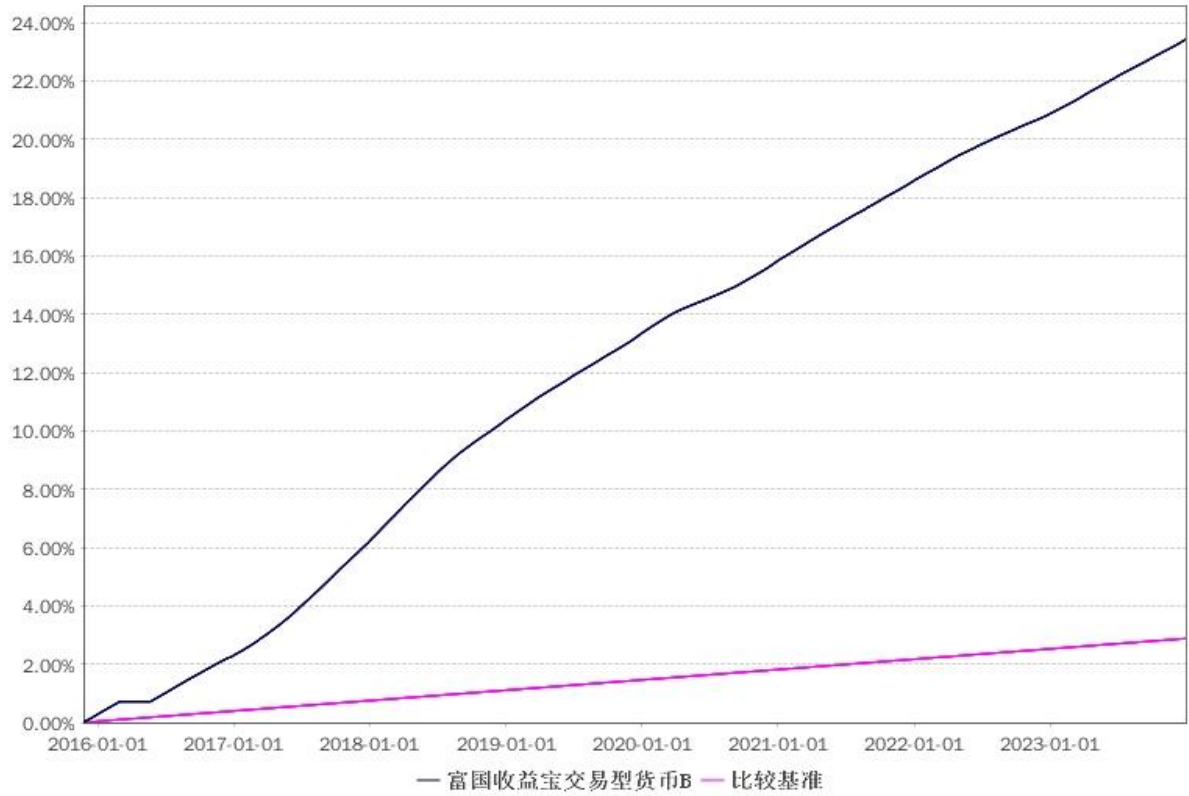
(1) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 A 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 11 月 24 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 11 月 24 日起至 2016 年 5 月 23 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

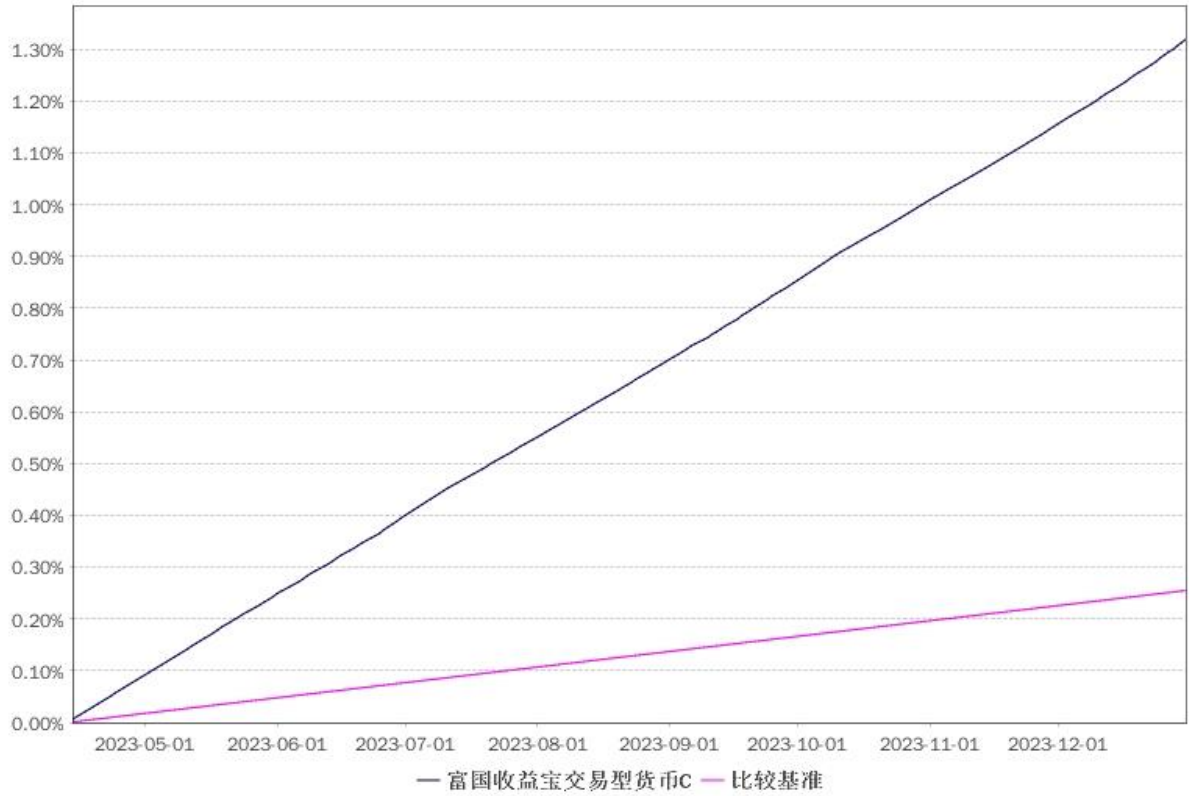
(2) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 B 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 11 月 24 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 11 月 24 日起至 2016 年 5 月 23 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

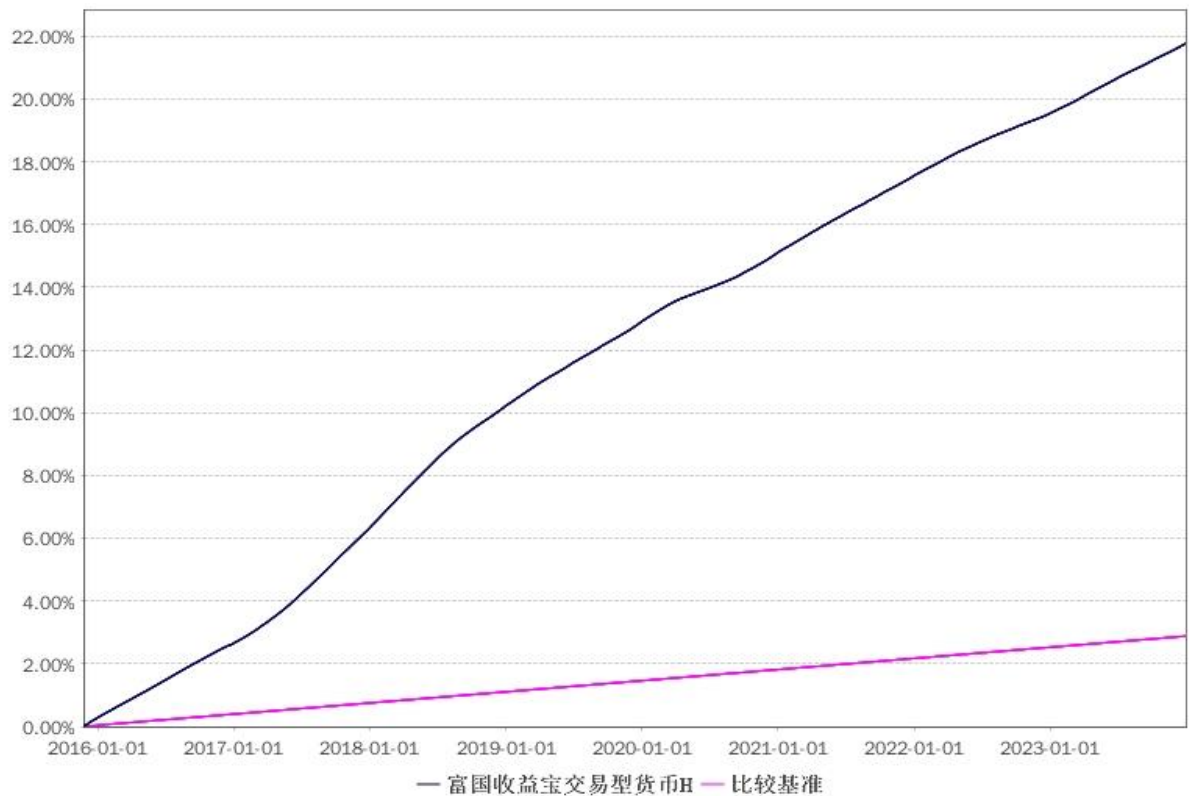
(3) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 C 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金自2023年4月13日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

(4) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币H基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

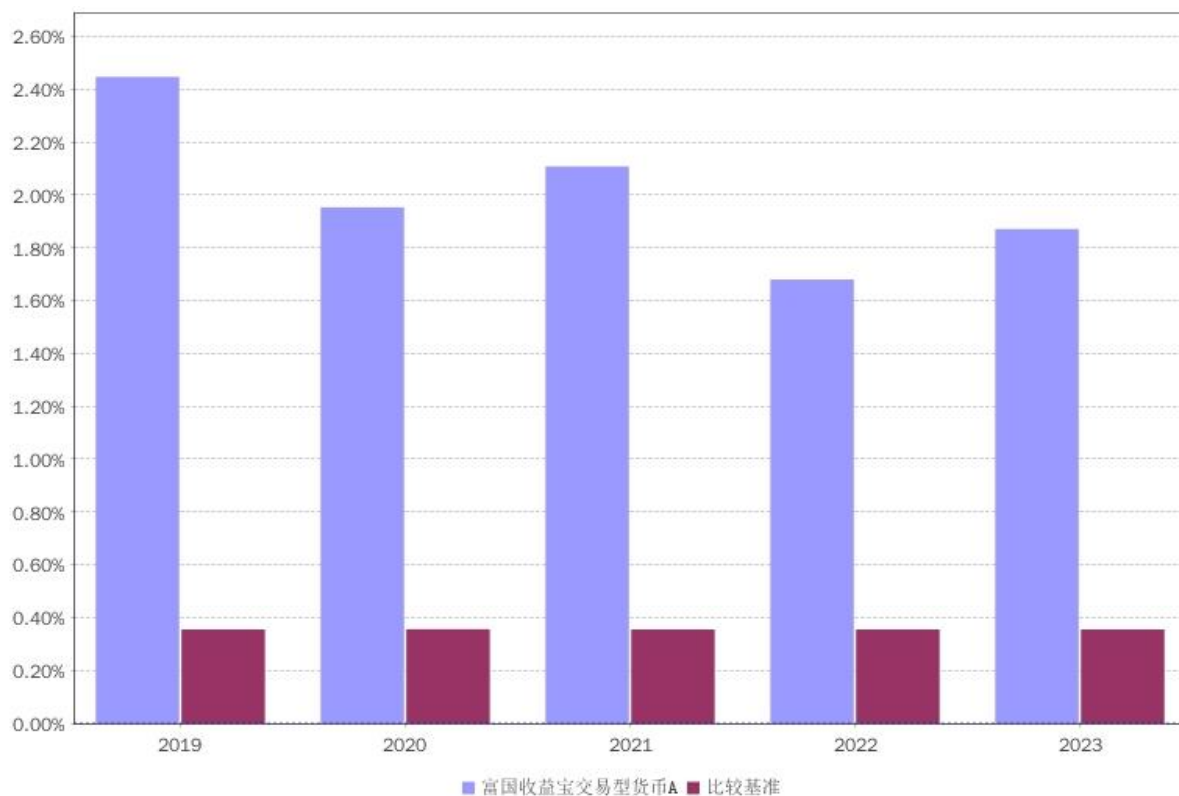


注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

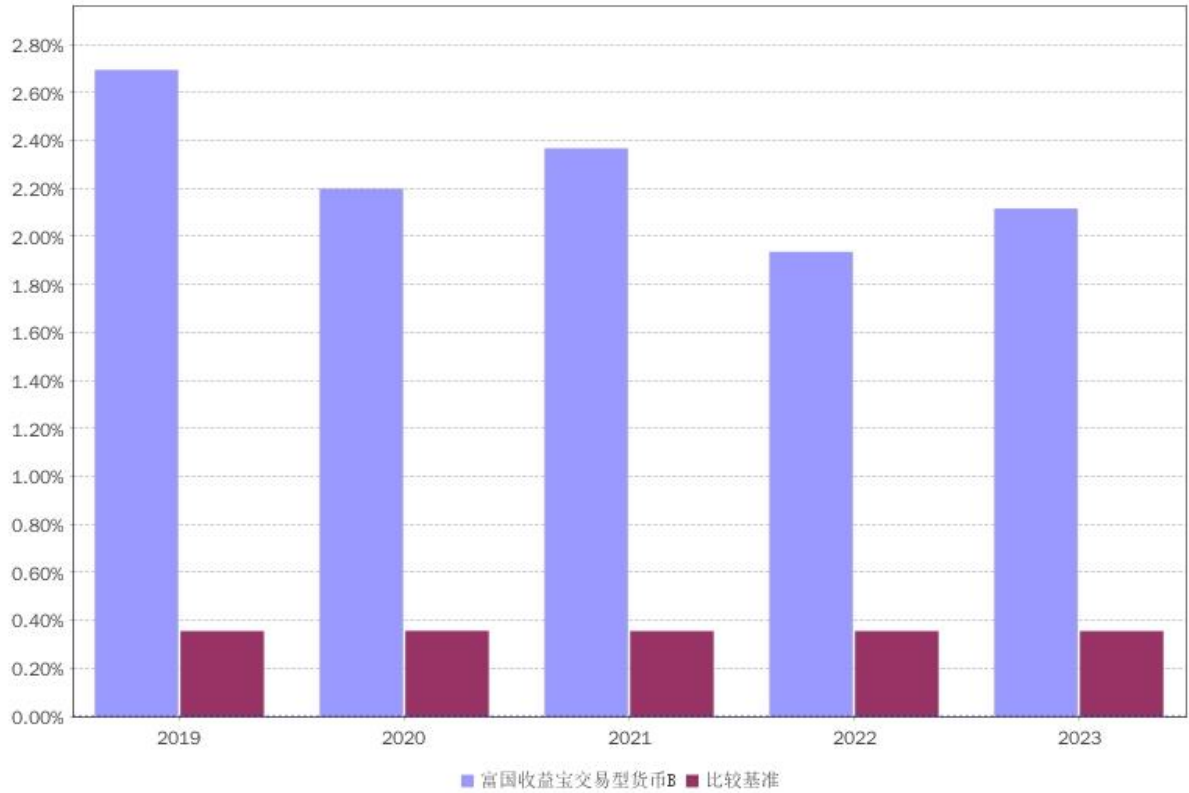
2、本基金于 2015 年 11 月 24 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 11 月 24 日起至 2016 年 5 月 23 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

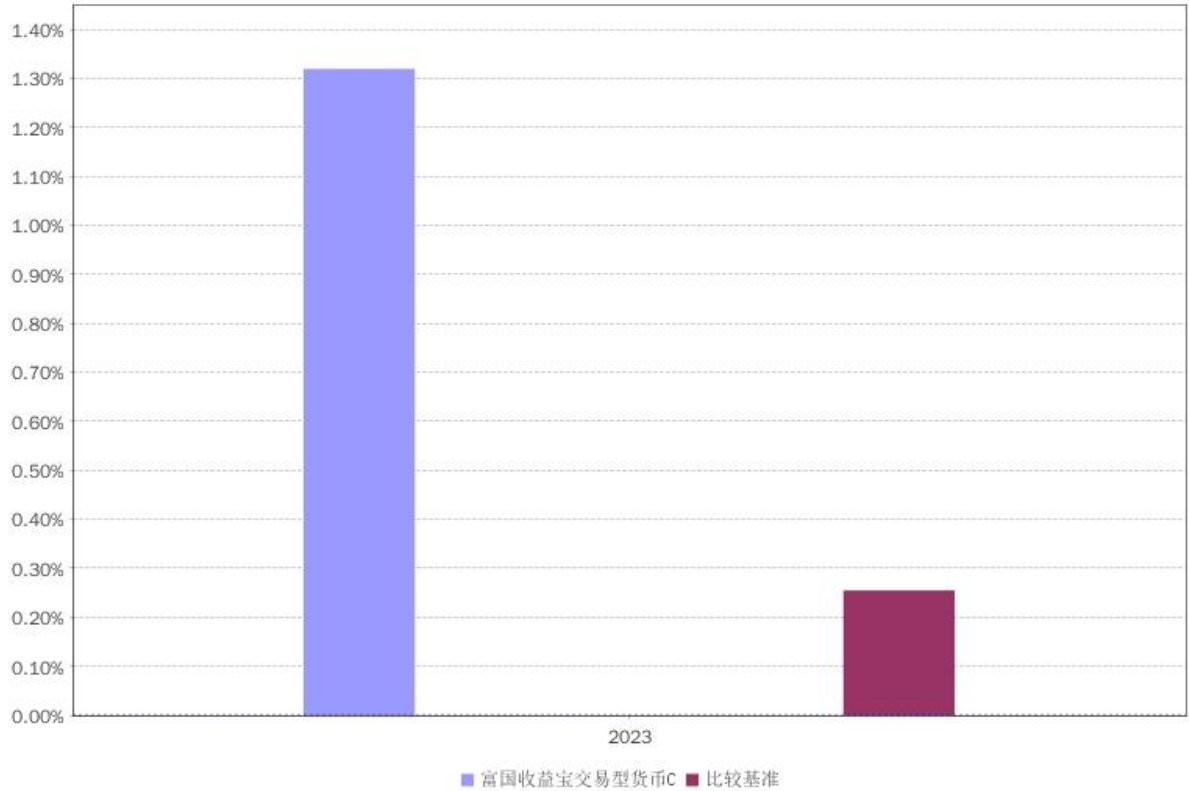
(1) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 B 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



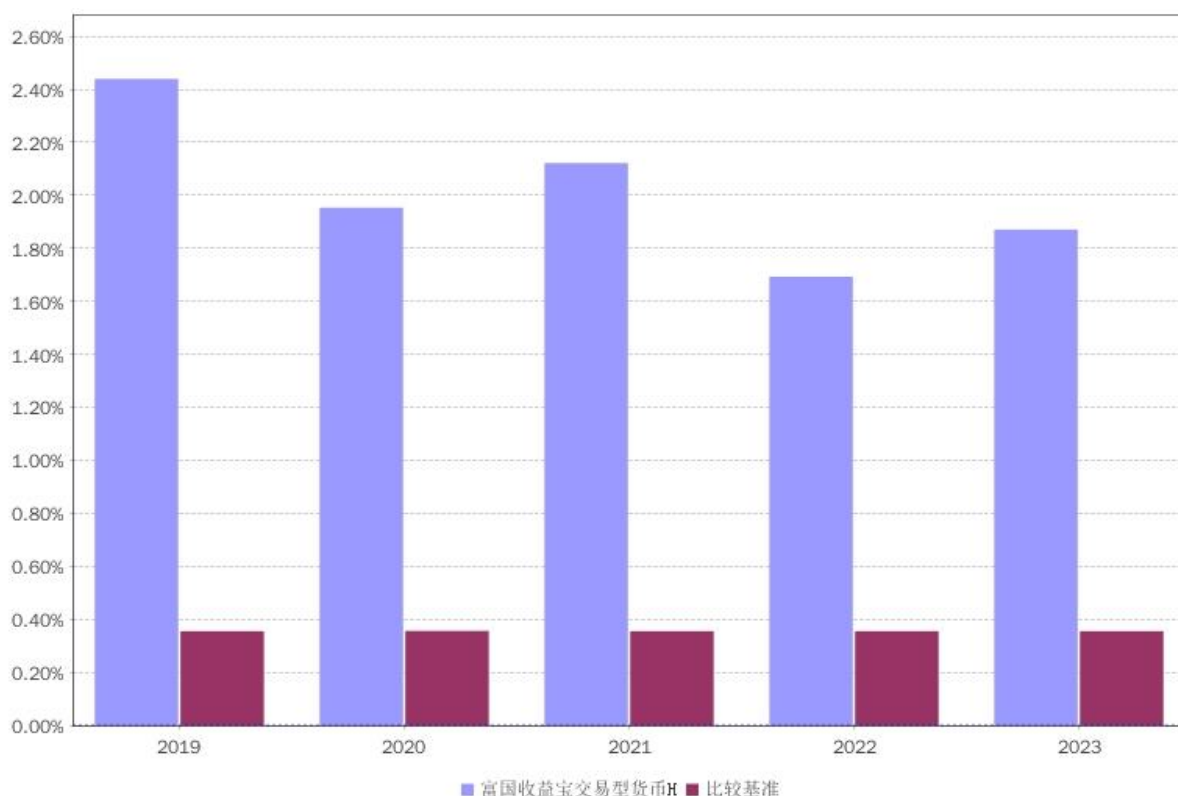
(3) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：C类份额自2023年4月14日起有基金份额。2023年按实际存续期计算。

(4) 自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币 H 基金净值收益率与同期业绩

比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### (1) 富国收益宝交易型货币 A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2023年	174,639,807.53	—	—	174,639,807.53	货币基金
2022年	104,530,490.20	—	—	104,530,490.20	货币基金
2021年	3,894,671.93	—	—	3,894,671.93	货币基金
合计	283,064,969.66	—	—	283,064,969.66	—

#### (2) 富国收益宝交易型货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2023年	434,502,630.79	—	—	434,502,630.79	货币基金
2022年	394,068,494.82	—	—	394,068,494.82	货币基金
2021年	517,362,510.13	—	—	517,362,510.13	货币基金



合计	1,345,933,635.74	—	—	1,345,933,635.74	—
----	------------------	---	---	------------------	---

(3) 富国收益宝交易型货币 C

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2023年	40,821.04	—	—	40,821.04	货币 基金
2022年	—	—	—	—	—
2021年	—	—	—	—	—
合计	40,821.04	—	—	40,821.04	—

(4) 富国收益宝交易型货币 H

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2023年	16,307,684.81	—	—	16,307,684.81	货币 基金
2022年	14,840,223.08	—	—	14,840,223.08	货币 基金
2021年	4,364,811.76	—	—	4,364,811.76	货币 基金
合计	35,512,719.65	—	—	35,512,719.65	—

## § 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		
张波	本基金现任基金经理	2018-01-29	—	12	硕士，曾任上海耀之资产管理中心（有限合伙）交易员，鑫元基金管理有限公司交易员，鑫元基金管理有限公司交易副总监（主持工作）；自 2017 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理；现任富国基金固定收益策略研究部固定收益投资总监助理兼固定收益基金经理。自 2018 年 01 月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；自 2018 年 01 月起任富国天时货币市场基金基金经理；自 2018 年 06 月起任富国富钱包货币市场基金基金经理；自 2018 年 08 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 01 月起任富国短债债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 05 月起任富国国有企业债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 月起任富国安利 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 12 月起任富国中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理；自 2022 年 06 月起任富国安慧短债

					债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
吴旅忠	本基金现任基金经理	2019-02-20	—	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。
梁清	本基金现任基金经理助理	2022-01-04	—	6	硕士，曾任上海汽车集团财务有限责任公司交易及研究员，国泰君安证券股份有限公司投资经理；自2021年10月加入富国基金管理有限公司，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月起任富国安利90天滚动持有债券型证券投资基金基金经理助理；自2022年01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)基金经理助理;自2022年01月起任富国短债债券型证券投资基金基金经理助理;自2022年01月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理助理;自2022年01月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理助理;自2022年01月起任富国中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理助理;自2023年04月起任富国中债7-10年政策性金融债交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理;自2023年04月起任富国中债7-10年政策性金融债交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理;自2024年01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;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收益宝交易型货币市场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》、《富国收益宝交易型货币市场基金基金合同》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。

债券市场上，全年债券走势与经济、货币政策等高度相关。年初债券延续去年“强预期”调整态势，收益率整体高位盘整，10Y 国债上行至 2.9%以上；而后预期转弱，收益率掉头回落，与美债 10 年的利差有所扩大。短端市场则受流动性影响更大：1 季度流动性整体偏紧，1 年期国股 CD 从年初 2.41%上行至 3 月初 2.76%，上行约 35bp，；季末随着央行降准释放流动性，资金面边际转松，收益率一路下行，并于 8 月中央行降息时点到达低点 2.2%附近。8 月中旬起，资金边际收紧，短端收益率持续反弹，第一波反弹至 9 月初的 2.48%反弹 28bp，4 季度受年末赎回、CD 一级发行及资本新规落地等综合影响，收益率继续上行 2.67%，

高于 MLF17bp；年末进入跨年行情，1Y 国股 CD 收益率快速回落至 2.41%。

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，在此基础上提升货币基金的收益。基金管理人灵活高效的开展了资产配置，基于对货币市场走势的合理研判，执行有效的投资策略。安排回购、存款、存单等各类资产占比及资产到期分布，增强组合的流动性风险防御能力。在季末时点，充分利用杠杆率、剩余期限等指标空间，提升组合业绩表现。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金每万份基金净收益 A 级为 1.2564 元，B 级为 1.3879 元，C 级为 1.2564 元；每百份基金净收益 H 级为 1.2564 元；7 日年化收益率 A 级为 2.253%，B 级为 2.498%，C 级为 2.251%，H 级为 2.254%；本报告期，本基金份额净值收益率 A 级为 1.8712%，B 级为 2.1160%，C 级为 1.3193%，H 级为 1.8706%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.3549%，B 级为 0.3549%，C 级为 0.2547%，H 级为 0.3549%。

#### **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。货币市场投资在追求稳健收益的同时，需高度关注资本新规落地等政策因素影响。

基金管理人将继续保持谨慎操作的态度，在保证安全性和流动性的前提下，积极把握市场利率波动，合理调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，尽量创造更多的超额收益。

#### **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

本基金本报告期已按《基金合同》的约定：“本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，且每日进行支付。当日所得收益结转为对应类别的基金份额参与下一日收益分配”的条款进行收益分配。

### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国收益宝交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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_B66 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	富国收益宝交易型货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国收益宝交易型货币市场基金的财务报表，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，后附的富国收益宝交易型货币市场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,公允反映了富国收益宝交易型货币市场基金 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,我们独立于富国收益宝交易型货币市场基金,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	<p>富国收益宝交易型货币市场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。</p> <p>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。</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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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收益宝交易型货币市场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>

	治理层负责监督富国收益宝交易型货币市场基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</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，就可能导致对富国收益宝交易型货币市场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收益宝交易型货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披</p>

	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。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。	
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:富国收益宝交易型货币市场基金

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	3,513,464,933.20	6,863,003,023.52
结算备付金	81,609,141.10	86,973,500.07
存出保证金	670,744.85	3,162,894.31
交易性金融资产	22,673,657,864.93	15,124,034,330.96
其中:股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	22,673,657,864.93	15,124,034,330.96
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	4,894,757,463.44	3,836,567,865.71
应收清算款	359,417,570.86	—
应收股利	—	—
应收申购款	30,264,275.21	31,733,914.43
递延所得税资产	—	—

其他资产	—	—
资产总计	31,553,841,993.59	25,945,475,529.00
<b>负债和净资产</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	2,610,652,788.98	2,312,011,372.21
应付清算款	260,963,000.00	93,944.01
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	7,940,930.54	6,585,847.59
应付托管费	1,418,023.31	1,176,044.19
应付销售服务费	2,319,441.48	2,492,892.23
应付投资顾问费	—	—
应交税费	146,268.34	89,635.54
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,009,333.65	717,670.22
负债合计	2,884,449,786.30	2,323,167,405.99
<b>净资产：</b>		
实收基金	28,669,392,207.29	23,622,308,123.01
其他综合收益	—	—
未分配利润	—	—
净资产合计	28,669,392,207.29	23,622,308,123.01
负债和净资产总计	31,553,841,993.59	25,945,475,529.00

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 28,669,392,207.29 份，其中 A 级基金份额总额 9,449,602,930.19 份，其中 B 级基金份额总额 18,611,905,677.46 份，其中 C 级基金份额总额 8,676,197.73 份，其中 H 级基金份额总额 599,207,401.91 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国收益宝交易型货币市场基金

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>	802,141,506.50	671,130,137.07
1.利息收入	323,132,567.16	341,166,443.89
其中：存款利息收入	143,608,280.63	194,668,327.26
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	179,524,286.53	146,498,116.63
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	479,008,939.34	329,963,693.18
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	479,008,939.34	329,963,693.18
资产支持证券投资收益	—	—
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）	—	—
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>	176,650,562.33	157,690,928.97
1. 管理人报酬	87,187,052.40	79,603,953.62
2. 托管费	15,569,116.50	14,214,991.72
3. 销售服务费	27,851,985.67	21,855,737.49
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	45,530,991.43	41,484,232.02
其中：卖出回购金融资产支出	45,530,991.43	41,484,232.02
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	84,927.70	136,130.02
8. 其他费用	426,488.63	395,884.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	625,490,944.17	513,439,208.10
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	625,490,944.17	513,439,208.10
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	—	—
<b>六、综合收益总额</b>	625,490,944.17	513,439,208.10

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国收益宝交易型货币市场基金

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	23,622,308,123.01	—	23,622,308,123.01
二、本期期初净资产	23,622,308,123.01	—	23,622,308,123.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,047,084,084.28	—	5,047,084,084.28
（一）、综合收益总额	—	625,490,944.17	625,490,944.17
（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）	5,047,084,084.28	—	5,047,084,084.28
其中：1. 基金申购款	499,641,543,609.61	—	499,641,543,609.61
2. 基金赎回款	— 494,594,459,525.33	—	— 494,594,459,525.33
（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）	—	625,490,944.17	— 625,490,944.17
四、本期期末净资产	28,669,392,207.29	—	28,669,392,207.29
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	18,857,070,236.15	—	18,857,070,236.15
二、本期期初净资产	18,857,070,236.15	—	18,857,070,236.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,765,237,886.86	—	4,765,237,886.86
（一）、综合收益总额	—	513,439,208.10	513,439,208.10
（二）、本期基金份额交易产生的净资产	4,765,237,886.86	—	4,765,237,886.86



产变动数(净资产减少以“-”号填列)	6.86		6.86
其中: 1.基金申购款	449,076,278, 401.42	—	449,076,278, 401.42
2.基金赎回款	— 444,311,040, 514.56	—	— 444,311,040, 514.56
(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)	—	513,439,208.10	— 513,439,208.10
四、本期期末净资产	23,622,308,1 23.01	—	23,622,308,1 23.01

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

—————

—————

—————

基金管理公司负责人

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

富国收益宝交易型货币市场基金(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[2015]2445号文《关于准予富国收益宝交易型货币市场基金注册的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集。基金合同于2015年11月24日生效。首次设立募集规模为7,105,509,813.60份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,基金的注册登记机构为富国基金管理有限公司和中国证券登记结算有限责任公司,基金的托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人于2015年11月25日发布的《富国收益宝交易型货币市场基金基金份额折算的公告》,H类基金份额在本基金基金合同生效当日进行份额折算,折算后H类每份基金份额对应的面值为人民币100.00元。

根据基金管理人于2023年4月11日发布的《关于富国收益宝交易型货币市场基金增加场外C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》自2023年4月13日起,本基金增加C类基金份额。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存

款、短期融资券（含超短期融资券），期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和大量存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据和资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

#### **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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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，在初始确认时以公允价值计量；

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，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。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。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

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，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；

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 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实际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。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(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) 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。

#### **7.4.4.9 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。

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、每日分配收益：本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零，若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；

4、本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在当日收益支付时，若当日净收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；若当日基金净收益小于零时，缩减基金份额持有人基金份额；

5、本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资者收益账户，投资者收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。收益账户高于100元以上的整百元收益于每个工作日转为基金份额支付到投资者的证券账户。

投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；投资者赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资者；若累计收益为负值，则从投资者赎回基金款中按比例扣除。投资者卖出部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资者份额全部卖出时，以现金方式将全部累计收益与投资者结清；

6、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7、当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

8、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.11 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。

#### **7.4.4.12 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事业费附加的单位外）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	2,186,488.47	2,403,331.10
等于：本金	1,239,362.56	2,402,872.33
加：应计利息	947,125.91	458.77
减：坏账准备	—	—
定期存款	3,511,278,444.73	6,860,599,692.42
等于：本金	3,500,000,000.00	6,832,000,000.00
加：应计利息	11,278,444.73	28,599,692.42
减：坏账准备	—	—
其中：存款期限1个月以内	—	—
存款期限1-3个月	—	600,889,166.61
存款期限3个月以上	3,511,278,444.73	6,259,710,525.81

其他存款	—	—
等于：本金	—	—
加：应计利息	—	—
减：坏账准备	—	—
合计	3,513,464,933.20	6,863,003,023.52

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目		本期末（2023年12月31日）			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	110,070,809.86	110,169,809.86	99,000.00	0.0003%
	银行间市场	22,563,587,055.07	22,585,393,775.22	21,806,720.15	0.0761%
	合计	22,673,657,864.93	22,695,563,585.08	21,905,720.15	0.0764%
资产支持证券		—	—	—	—
合计		22,673,657,864.93	22,695,563,585.08	21,905,720.15	0.0764%
项目		上年度末（2022年12月31日）			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	20,540,492.03	20,529,381.92	-11,110.11	0.0000%
	银行间市场	15,103,493,838.93	15,106,356,755.08	2,862,916.15	0.0121%
	合计	15,124,034,330.96	15,126,886,137.00	2,851,806.04	0.0121%
资产支持证券		—	—	—	—
合计		15,124,034,330.96	15,126,886,137.00	2,851,806.04	0.0121%

注：1. 偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值

2. 偏离度=偏离金额/基金资产净值

#### 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

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	1,853,617,343.51	—
银行间市场	3,041,140,119.93	—

合计	4,894,757,463.44	—
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	1,943,567,946.53	—
银行间市场	1,892,999,919.18	—
合计	3,836,567,865.71	—

#### 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	312,173.73	305,603.45
其中：交易所市场	—	—
银行间市场	312,173.73	305,603.45
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	88,000.00	88,000.00
申购款利息	480,159.92	195,066.77
预提银行间账户维护费	9,000.00	9,000.00
预提上市年费	—	—
合计	1,009,333.65	717,670.22

#### 7.4.7.7 实收基金

富国收益宝交易型货币 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	9,564,842,169.08	9,564,842,169.08
本期申购	252,721,856,365.80	252,721,856,365.80
本期赎回（以“-”号填列）	-252,837,095,604.69	-252,837,095,604.69
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期末	9,449,602,930.19	9,449,602,930.19

富国收益宝交易型货币 B:

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	12,709,520,049.25	12,709,520,049.25
本期申购	244,406,438,639.25	244,406,438,639.25
本期赎回（以“-”号填列）	-238,504,053,011.04	-238,504,053,011.04
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期末	18,611,905,677.46	18,611,905,677.46

富国收益宝交易型货币 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	—	—
本期申购	38,146,119.75	38,146,119.75
本期赎回（以“-”号填列）	-29,469,922.02	-29,469,922.02
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期末	8,676,197.73	8,676,197.73

富国收益宝交易型货币 H:

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	1,347,945,904.68	1,347,945,904.68
本期申购	2,475,102,484.81	2,475,102,484.81
本期赎回（以“-”号填列）	-3,223,840,987.58	-3,223,840,987.58
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期末	599,207,401.91	599,207,401.91

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

富国收益宝交易型货币 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	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	174,639,807.53	—	174,639,807.53
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	-174,639,807.53
	174,639,807.53	—	

本期末	—	—	—
-----	---	---	---

富国收益宝交易型货币 B:

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	434,502,630.79	—	434,502,630.79
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	434,502,630.79	—	-434,502,630.79
本期末	—	—	—

富国收益宝交易型货币 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	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	40,821.04	—	40,821.04
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-40,821.04	—	-40,821.04
本期末	—	—	—

富国收益宝交易型货币 H:

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	16,307,684.81	—	16,307,684.81
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	16,307,684.81	—	-16,307,684.81
本期末	—	—	—

#### 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	12,566,417.30	40,586,813.17
定期存款利息收入	128,738,563.40	151,203,456.15
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	1,528,951.08	1,827,569.06
其他	774,348.85	1,050,488.88
合计	143,608,280.63	194,668,327.26

#### 7.4.7.10 债券投资收益

##### 7.4.7.10.1 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	470,576,185.65	319,372,991.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,432,753.69	10,590,701.75
合计	479,008,939.34	329,963,693.18

##### 7.4.7.10.2 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	55,201,552,158.88	50,958,460,057.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	54,945,334,725.12	50,752,442,569.23
减：应计利息总额	247,784,680.07	195,426,534.50
减：交易费用	—	252.50
买卖债券差价收入	8,432,753.69	10,590,701.75

#### 7.4.7.11 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.12 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。

#### 7.4.7.13 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。

#### 7.4.7.14 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	88,000.00	88,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	181,888.63	153,684.10
债券账户维护费	35,400.00	33,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	426,488.63	395,884.10

#### 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、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、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
海通开元投资有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
富国资产管理(上海)有限公司	基金管理人的子公司

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 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（%）
海通证券	—	—	13,797,485.60	3.76

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.2 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	30,794,533,000.00	14.04	33,918,299,000.00	15.58
申万宏源	4,156,135,000.00	1.90	3,862,454,000.00	1.77

###### 7.4.10.1.3 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	87,187,052.40	79,603,953.62
其中：应支付销售机构的客户	26,283,712.06	18,952,885.07



维护费		
应支付基金管理人的净管理费	60,903,340.34	60,651,068.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.28%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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	15,569,116.50	14,214,991.72

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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				
	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币C	富国收益宝交易型货币H	合计
富国基金管理有限公司	161,650.57	639,927.80	3.48	1,240,381.02	2,041,962.87
海通证券股份有限公司	6,157.10	640,201.46	—	313,234.24	959,592.80

申万宏源西部证券有限公司	—	—	—	701.29	701.29
申万宏源证券有限公司	141.29	306.82	—	138,741.34	139,189.45
中国银行股份有限公司	312,001.97	1,080.42	—	—	313,082.39
合计	479,950.93	1,281,516.50	3.48	1,693,057.89	3,454,528.80

金额单位：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				
	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币C	富国收益宝交易型货币H	合计
富国基金管理有限公司	72,672.87	973,952.88	—	1,016,282.50	2,062,908.25
海通证券股份有限公司	31,910.80	609,530.22	—	592,710.56	1,234,151.58
申万宏源西部证券有限公司	—	—	—	463.26	463.26
申万宏源证券有限公司	131.69	22.35	—	92,763.25	92,917.29
中国银行股份有限公司	6,076.44	939.46	—	—	7,015.90
合计	110,791.80	1,584,444.91	—	1,702,219.57	3,397,456.28

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活 动。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%；本基金 H 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。各类基金份额的销售服务费计提的计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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

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)			
	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币C	富国收益宝交易型货币H	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币C	富国收益宝交易型货币H
基金合同生效日 (2015年11月24日)持	—	—	—	—	—	—	—	—

有的基金份额								
期初持有的基金份额	—	277,901,137.13	—	403,491,100.00	—	1,508,762,332.59	—	—
期间申购/买入总份额	—	796,002,211.47	1,013.19	2,225,700.00	—	19,138,804.54	—	435,541,100.00
期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	405,716,800.00	—	1,250,000,000.00	—	32,050,000.00
期末持有的基金份额	—	1,073,903,348.60	1,013.19	—	—	277,901,137.13	—	403,491,100.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	5.77%	0.01%	—	—	2.19%	—	29.94%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

#### 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

富国收益宝交易型货币 A：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023年12月31日）		上期末（2022年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
海通开元投资有限公司	—	—	10,941,484.15	0.11

富国收益宝交易型货币 B：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023年12月31日）		上期末（2022年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）

富国资产管理（上海）有限公司	237,306,660.48	1.28	254,229,411.23	2.00
海通开元投资有限公司	—	—	114,551,408.00	0.90

富国收益宝交易型货币 H:

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023年12月31日）		上期末（2022年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
申万宏源证券有限公司	55,728,700.00	9.30	22,020,500.00	1.63

注：—

#### 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
中国银行股份有限公司	2,186,488.47	12,566,417.30	2,403,331.10	40,586,813.17

#### 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—固定净值型货币市场基金

富国收益宝交易型货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
174,639,807.53	—	—	174,639,807.53	—

富国收益宝交易型货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注

434,502,630.79	—	—	434,502,630.79	—
----------------	---	---	----------------	---

富国收益宝交易型货币 C

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
40,821.04	—	—	40,821.04	—

富国收益宝交易型货币 H

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
16,307,684.81	—	—	16,307,684.81	—

#### 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 2,610,652,788.98 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
112302016	23 工商银行 CD016	2024-01-02	99.72	180,000	17,948,855.53
112305044	23 建设银行 CD044	2024-01-02	99.47	1,500,000	149,208,877.39
112306273	23 交通银行 CD273	2024-01-02	99.11	3,600,000	356,798,968.68
112310060	23 兴业银	2024-01-02	99.67	2,000,000	199,346,959.85

	行 CD060				
112310092	23 兴业银行 CD092	2024-01-02	99.50	2,000,000	199,005,670.18
112311150	23 平安银行 CD150	2024-01-02	97.80	1,500,000	146,706,733.73
112312040	23 北京银行 CD040	2024-01-02	99.46	2,000,000	198,924,064.07
112316065	23 上海银行 CD065	2024-01-02	98.81	2,180,000	215,398,994.55
112316092	23 上海银行 CD092	2024-01-02	98.59	2,900,000	285,921,268.96
210207	21 国开 07	2024-01-02	101.88	3,070,000	312,767,742.19
210207	21 国开 07	2024-01-02	101.88	500,000	50,939,371.69
210207	21 国开 07	2024-01-02	101.88	100,000	10,187,874.34
210402	21 农发 02	2024-01-02	102.74	3,000,000	308,220,806.21
230206	23 国开 06	2024-01-02	101.17	2,600,000	263,048,650.51
239977	23 贴现国债 77	2024-01-02	99.57	1,040,000	103,555,968.34
合计				28,170,000	2,817,980,806.22

#### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本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同责任，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	81,265,593.52	354,769,767.62
A-1 以下	—	—
未评级	1,541,767,003.70	652,893,549.63
合计	1,623,032,597.22	1,007,663,317.25

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	123,049,964.27	594,311,744.51
AAA 以下	—	—
未评级	181,582,805.00	132,987,280.63
合计	304,632,769.27	727,299,025.14

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

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	18,224,887,161.85	12,030,442,373.15
AAA以下	812,018,127.29	148,321,730.33
未评级	—	—
合计	19,036,905,289.14	12,178,764,103.48

注：本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

### 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》、《货币市场基金监督管理办法》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为剩余期限较短、信誉良好的、可在银行间同业市场交易的金融资产工具。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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，按实际利率计算账面价值，并通过“影子定价”机制使按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

###### **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，并按照合约规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	2,186,488.47	1,608,463,055.70	1,902,815,389.03	—	—	—	3,513,464,933.20
结算备付金	81,609,141.10	—	—	—	—	—	81,609,141.10
存出保证金	670,744.85	—	—	—	—	—	670,744.85
交易性金融资产	—	7,298,970,231.25	15,374,687,633.68	—	—	—	22,673,657,864.93
买入返售金融资产	4,894,757,463.44	—	—	—	—	—	4,894,757,463.44
应收清算款	—	—	—	—	—	359,417,570.86	359,417,570.86
应收申购款	—	—	—	—	—	30,264,275.21	30,264,275.21
资产总计	4,979,223,837.86	8,907,433,286.95	17,277,503,022.71	—	—	389,681,846.07	31,553,841,993.59
负债							
卖出回购金融资产款	2,610,652,788.98	—	—	—	—	—	2,610,652,788.98
应付清算款	—	—	—	—	—	260,963,000.00	260,963,000.00
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	7,940,930.54	7,940,930.54
应付托管费	—	—	—	—	—	1,418,023.31	1,418,023.31
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,319,441.48	2,319,441.48
应交税费	—	—	—	—	—	146,268.34	146,268.34
其他负债	—	—	—	—	—	1,009,333.65	1,009,333.65
负债总计	2,610,652,788.98	—	—	—	—	273,796,997.32	2,884,449,786.30
利率敏感度缺口	2,368,571,048.88	8,907,433,286.95	17,277,503,022.71	—	—	115,884,848.75	28,669,392,207.29
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	1,609,372,497.71	3,251,212,636.95	2,002,417,888.86	—	—	—	6,863,003,023.52
结算备付金	86,973,500.07	—	—	—	—	—	86,973,500.07
存出保证金	3,162,894.31	—	—	—	—	—	3,162,894.31
交易性金融资产	100,800,901.38	5,690,901,600.38	9,332,331,829.20	—	—	—	15,124,034,330.96
买入返售金融资产	3,836,567,865.71	—	—	—	—	—	3,836,567,865.71
应收申购款	—	—	—	—	—	31,733,914.43	31,733,914.43
资产总计	5,636,877,659.18	8,942,114,237.33	11,334,749,718.06	—	—	31,733,914.43	25,945,475,529.00
负债							
卖出回购金融资产款	2,312,011,372.21	—	—	—	—	—	2,312,011,372.21
应付清算款	—	—	—	—	—	93,944.01	93,944.01
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,585,847.59	6,585,847.59
应付托管费	—	—	—	—	—	1,176,044.19	1,176,044.19
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,492,892.23	2,492,892.23
应交税费	—	—	—	—	—	89,635.54	89,635.54
其他负债	—	—	—	—	—	717,670.22	717,670.22
负债总计	2,312,011,372.21	—	—	—	—	11,156,033.78	2,323,167,405.99
利率敏感度缺口	3,324,866,286.97	8,942,114,237.33	11,334,749,718.06	—	—	20,577,880.65	23,622,308,123.01

#### 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%	-8,523,776.28	-5,749,325.07
	2. 基准点利率减少 0.1%	8,523,776.28	5,749,325.07

#### 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且按实际利率计算账面价值，因此无重大市场价格风险。

#### 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	22,673,657,864.93	15,124,034,330.96
第三层次	—	—
合计	22,673,657,864.93	15,124,034,330.96

##### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	22,673,657,864.93	71.86
	其中：债券	22,673,657,864.93	71.86
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	4,894,757,463.44	15.51
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	3,595,074,074.30	11.39
4	其他各项资产	390,352,590.92	1.24
5	合计	31,553,841,993.59	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.67	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,610,652,788.98	9.11
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	18.61	10.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	2.23	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	28.72	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—120 天	9.81	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天(含)—397 天(含)	50.38	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
	合计	109.75	10.01

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	149,359,569.72	0.52
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,669,798,449.44	5.82
	其中：政策性金融债	1,559,727,639.58	5.44
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,623,032,597.22	5.66
6	中期票据	194,561,959.41	0.68
7	同业存单	19,036,905,289.14	66.40
8	其他	—	—
9	合计	22,673,657,864.93	79.09
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—



## 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例(%)
1	112317311	23 光大银行 CD311	5,000,000	497,012,177.79	1.73
2	112306273	23 交通银行 CD273	5,000,000	495,554,123.16	1.73
3	210207	21 国开 07	3,900,000	397,327,099.20	1.39
4	210402	21 农发 02	3,000,000	308,220,806.21	1.08
5	112316153	23 上海银行 CD153	3,000,000	298,521,015.47	1.04
6	112314046	23 江苏银行 CD046	3,000,000	298,487,276.08	1.04
7	112316160	23 上海银行 CD160	3,000,000	298,334,940.38	1.04
8	112314053	23 江苏银行 CD053	3,000,000	297,871,388.66	1.04
9	112305259	23 建设银行 CD259	3,000,000	297,826,027.53	1.04
10	112371221	23 宁波银行 CD214	3,000,000	297,124,108.07	1.04

## 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1037%
报告期内偏离度的最低值	-0.0427%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0404%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。本基金按实际利率法计算金融资产的账面价值，并采用影子定价和偏离度控制，以确保基金资产净值能够公允地反映基金投资组合价值。

### 8.9.2 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，上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局、中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，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，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局宁波监管局、国家外汇管理局宁波市分局的处罚。

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未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	670,744.85
2	应收清算款	359,417,570.86
3	应收利息	—
4	应收申购款	30,264,275.21
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—

7	其他	—
8	合计	390,352,590.92

#### 8.9.4 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(%)
富国收益宝交易型货币 A	1,232,535	7,666.80	69,295,286.66	0.73	9,380,307,643.53	99.27
富国收益宝交易型货币 B	470,315	39,573.28	8,558,536,975.58	45.98	10,053,368,701.88	54.02
富国收益宝交易型货币 C	1,068	8,123.78	1,013.39	0.01	8,675,184.34	99.99
富国收益宝交易型货币 H	1,014	590,934.32	449,338,558.53	74.99	149,868,843.38	25.01
合计	1,704,932	16,815.56	9,077,171,834.16	31.66	19,592,220,373.13	68.34

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

富国收益宝交易型货币 H

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	富国基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—富国基金国寿股份均衡股票型组合单一	95,864,100.00	16.00

2	富国基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—富国基金国寿股份均衡股票传统可供出	63,648,900.00	10.63
3	申万宏源证券有限公司	55,728,700.00	9.30
4	富国基金—中国移动通信有限公司—富国基金智享16号FOF单一资产管理计划	50,170,800.00	8.38
5	富国富源目标收益混合型养老金产品—中国民生银行股份有限公司	22,056,400.00	3.68
6	富国富民固定收益型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	18,801,800.00	3.14
7	曠远（珠海）私募基金管理合伙企业（有限合伙）—曠远尊享量化对冲5号私募证券投资	18,297,900.00	3.05
8	富国基金—上海财经大学教育发展基金会—富国基金—上海财大3号混合型单一资产管理	16,656,900.00	2.78
9	广发证券资管—兴业银行—广发资管齐添利1号7天定期开放集合资产管理计划	16,320,000.00	2.72
10	富国富鑫2号混合型养老金产品—招商银行股份有限公司	11,703,200.00	1.95

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为“富国货币”，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元。

### 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	基金类机构	1,073,904,361.79	3.75%
2	银行类机构	906,632,261.05	3.16%
3	银行类机构	611,244,128.25	2.13%
4	银行类机构	500,687,120.93	1.75%
5	银行类机构	500,484,355.23	1.75%
6	银行类机构	500,130,295.24	1.74%
7	银行类机构	322,700,238.74	1.13%
8	券商类机构	313,064,818.93	1.09%
9	银行类机构	306,734,674.87	1.07%
10	银行类机构	300,164,516.12	1.05%

#### 9.4 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	富国收益宝交易型货币 A	50,108.10	0.0005
	富国收益宝交易型货币 B	1,067,220.96	0.0057
	富国收益宝交易型货币 C	2.00	0.0000
	富国收益宝交易型货币 H	—	—
	合计	1,117,331.06	0.0039

#### 9.5 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	富国收益宝交易型货币 A	0
	富国收益宝交易型货币 B	0~10
	富国收益宝交易型货币 C	0
	富国收益宝交易型货币 H	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国收益宝交易型货币 A	0~10
	富国收益宝交易型货币 B	0
	富国收益宝交易型货币 C	0
	富国收益宝交易型货币 H	0
	合计	0~10

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国收益宝交易型货币	富国收益宝交易型货币 B	富国收益宝交易型货币 C	富国收益宝交易型货币 H
----	------------	--------------	--------------	--------------

	A			H
基金合同生效日(2015年11月24日)基金份额总额	122,371,834.45	117,123,979.15	6,866,014,000.00	6,866,014,000.00
报告期期初基金份额总额	9,564,842,169.08	12,709,520,049.25	—	1,347,945,904.68
本报告期基金总申购份额	252,721,856,365.80	244,406,438,639.25	38,146,119.75	2,475,102,484.81
减:本报告期基金总赎回份额	252,837,095,604.69	238,504,053,011.04	29,469,922.02	3,223,840,987.58
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	9,449,602,930.19	18,611,905,677.46	8,676,197.73	599,207,401.91

注: 1、红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源, 统一计入本期总申购份额, 基金转换转出作为本期赎回资金的来源, 统一计入本期总赎回份额。  
2、本基金场内基金份额(H类基金份额)简称为“富国货币”, 基金份额净值为100.00元, 本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元; 场外基金份额(A类基金份额)简称为“富国收益宝交易型货币A级”, 基金份额净值为1.00元; 场外基金份额(B类基金份额)简称为“富国收益宝交易型货币B级”, 基金份额净值为1.00元。

## § 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 8.8 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	—	—	18,673,875,000.00	8.52	—	—	—
诚通证券	2	—	—	411,582,000.00	0.19	—	—	—
东方证券	2	—	—	7,031,738,000.00	3.21	—	—	—
东吴证券	2	—	—	23,756,370,000.00	10.83	—	—	—
方正证券	1	—	—	260,963,000.00	0.12	—	—	—
广发证券	2	—	—	25,655,471,000.00	11.70	—	—	—
国盛证券	2	—	—	5,569,995,000.00	2.54	—	—	—
海通证券	2	—	—	30,794,533,000.00	14.04	—	—	—
华泰证券	2	—	—	12,297,590,000.00	5.61	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	3	—	—	49,851,434,000.00	22.74	—	—	—
申港证券	2	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	4,156,135,000.00	1.90	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	8,639,440,000.00	3.94	—	—	—
银河证券	2	—	—	2,634,087,000.00	1.20	—	—	—
浙商证券	2	—	—	15,391,008,000.00	7.02	—	—	—
中金公司	2	—	—	6,500,579,000.00	2.96	—	—	—
中信建投	2	—	—	5,292,512,000.00	2.41	—	—	—
中信证券	2	—	—	2,344,532,000.00	1.07	—	—	—

注：我公司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。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国收益宝交易型货币市场基金 暂停大额申购的公告	规定披露媒介	2023年01月17日



2	关于富国收益宝交易型货币市场基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2023 年 04 月 11 日
3	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2023 年 04 月 17 日
4	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购业务的公告	规定披露媒介	2023 年 04 月 25 日
5	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购业务的公告	规定披露媒介	2023 年 06 月 19 日
6	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2023 年 06 月 21 日
7	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购业务的公告	规定披露媒介	2023 年 09 月 25 日
8	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
9	关于富国收益宝交易型货币市场基金暂停大额申购业务的公告	规定披露媒介	2023 年 12 月 26 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 4 月 13 日起，对本基金增加场外 C 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 4 月 11 日发布的《关于富国收益宝交易型货币市场基金增加场外 C 类基金份额并修改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》。

### § 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收益宝交易型货币市场基金的文件	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、富国收益宝交易型货币市场基金基金合同		
3、富国收益宝交易型货币市场基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国收益宝交易型货币市场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		