

国信安泰中短债债券型集合资产管理计划

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:国信证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

集合计划托管人中国建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

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

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

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.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国信安泰中短债债券型集合资产管理计划	
基金简称	国信安泰中短债债券	
基金主代码	933333	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年11月01日	
基金管理人	国信证券股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,086,882,869.15份	
基金合同存续期	本集合计划自集合计划合同变更生效日起，存续期不得超过3年，本集合计划自集合计划合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	国信安泰中短债债券 A	国信安泰中短债债券 C
下属分级基金的交易代码	933333	970200
报告期末下属分级基金的份额总额	1,472,748,407.75份	614,134,461.40份

注：本报告所述的“基金”指按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于债券资产，重点投资中短债主题，在保持集合计划资产流动性和严格控制集合计划资产风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，追求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、债券供求情况、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，在集合计划合同规定的投资范围内动态调整各类资产的配置比例，控制投资组合风险，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的

	长期稳定的投资收益。具体包括：资产配置策略、固定收益类资产投资策略、信用债投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债新综合财富（1-3年）指数收益率*85%+一年期定期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国信证券股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	成飞
	联系电话	0755-81982985
	电子邮箱	08329@guosen.com.cn
客户服务电话	95536	021-60637228
传真	0755-82130672	021-60637228
注册地址	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦31层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518001	100033
法定代表人	张纳沙	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.guosen.com.cn
基金年度报告备置地	管理人和托管人的办公场所

点	
---	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路128号6楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年		2022年11月01日（基金合同生效日）-2022年12月31日	
	国信安泰中短债债券A	国信安泰中短债债券C	国信安泰中短债债券A	国信安泰中短债债券C
本期已实现收益	22,884,466.15	17,224,074.52	883,858.30	4,682,943.19
本期利润	28,026,521.15	21,875,500.84	271,543.65	907,348.35
加权平均基金份额本期利润	0.0459	0.0441	0.0013	0.0008
本期加权平均净值利润率	4.28%	4.16%	0.13%	0.07%
本期基金份额净值增长率	4.44%	4.18%	0.14%	0.11%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	128,232,381.61	48,153,690.29	8,067,633.95	43,146,971.76
期末可供分配基金份额利润	0.0871	0.0784	0.0409	0.0405
期末基金资产净值	1,600,980,789.3	665,736,757.5	205,414,86	1,109,133,74

	6	8	4.46	0.51
期末基金份额净值	1.0871	1.0840	1.0409	1.0405
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	4.59%	4.29%	0.14%	0.11%

注：（1）本集合资产管理计划合同于2022年11月01日生效，截至本报告期末本集合资产管理计划运作已满一年。（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。（3）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。（4）期末可供分配利润为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。

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

国信安泰中短债债券A

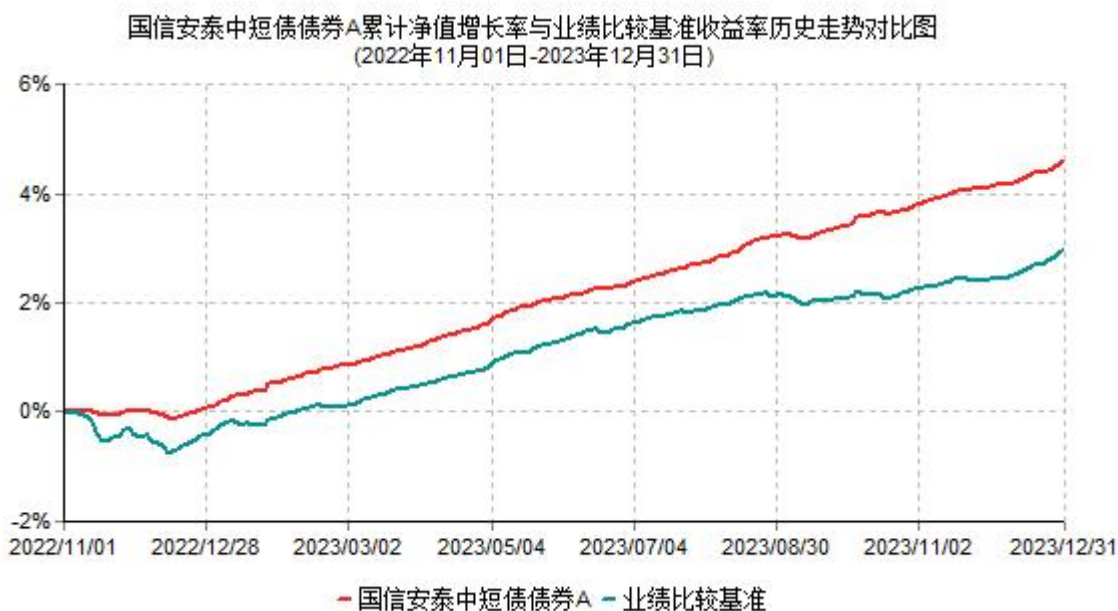
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.11%	0.02%	0.82%	0.02%	0.29%	0.00%
过去六个月	2.21%	0.02%	1.35%	0.02%	0.86%	0.00%
过去一年	4.44%	0.02%	3.29%	0.02%	1.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.59%	0.02%	2.96%	0.03%	1.63%	-0.01%

国信安泰中短债债券C

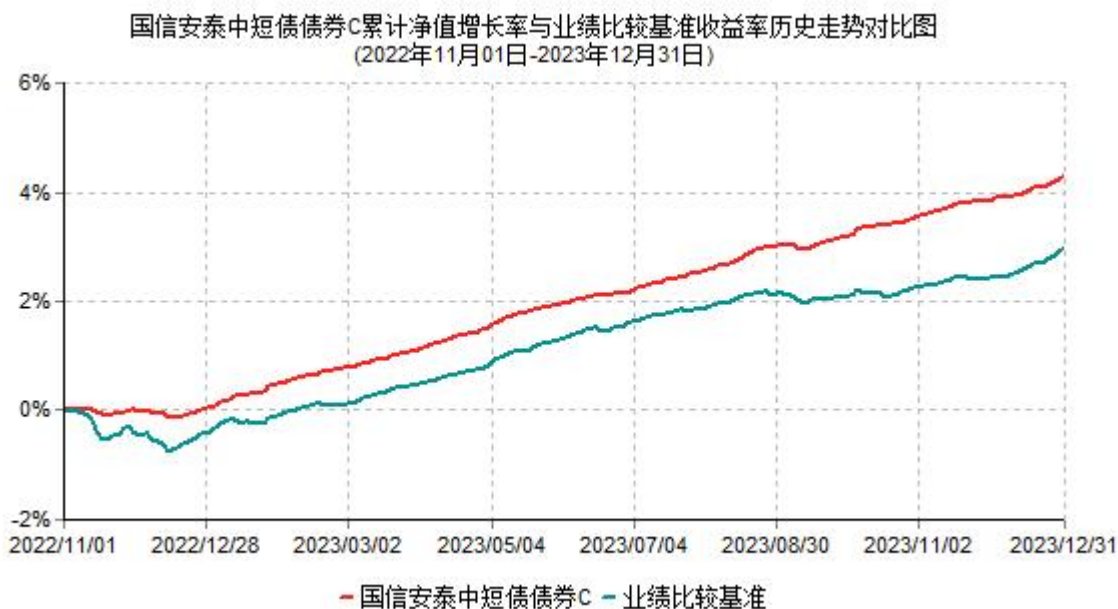
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.03%	0.02%	0.82%	0.02%	0.21%	0.00%
过去六个月	2.08%	0.02%	1.35%	0.02%	0.73%	0.00%
过去一年	4.18%	0.02%	3.29%	0.02%	0.89%	0.00%
自基金合同	4.29%	0.02%	2.96%	0.03%	1.33%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

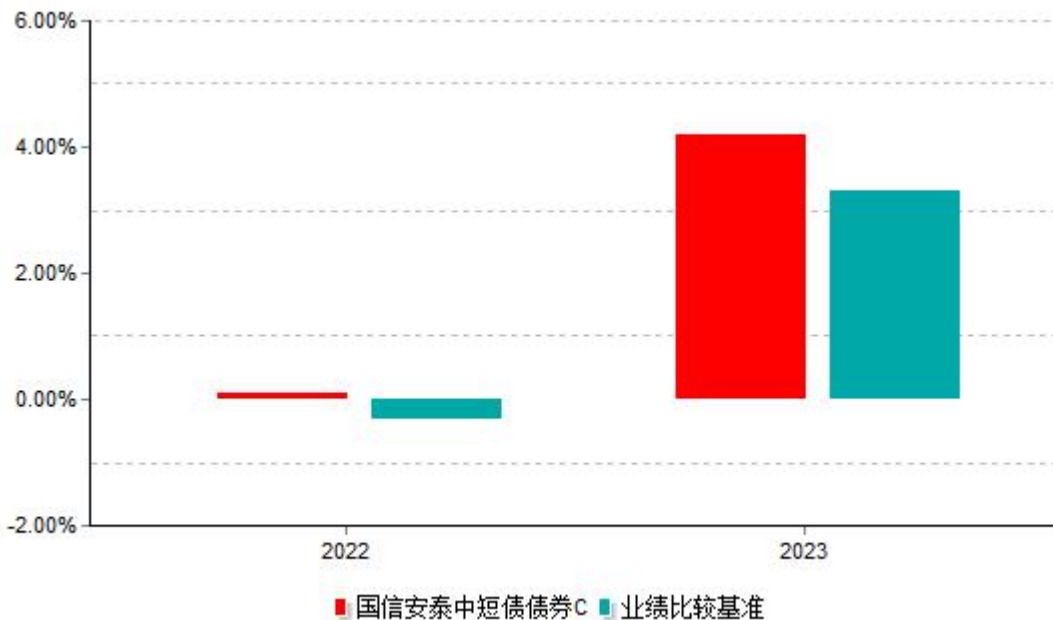
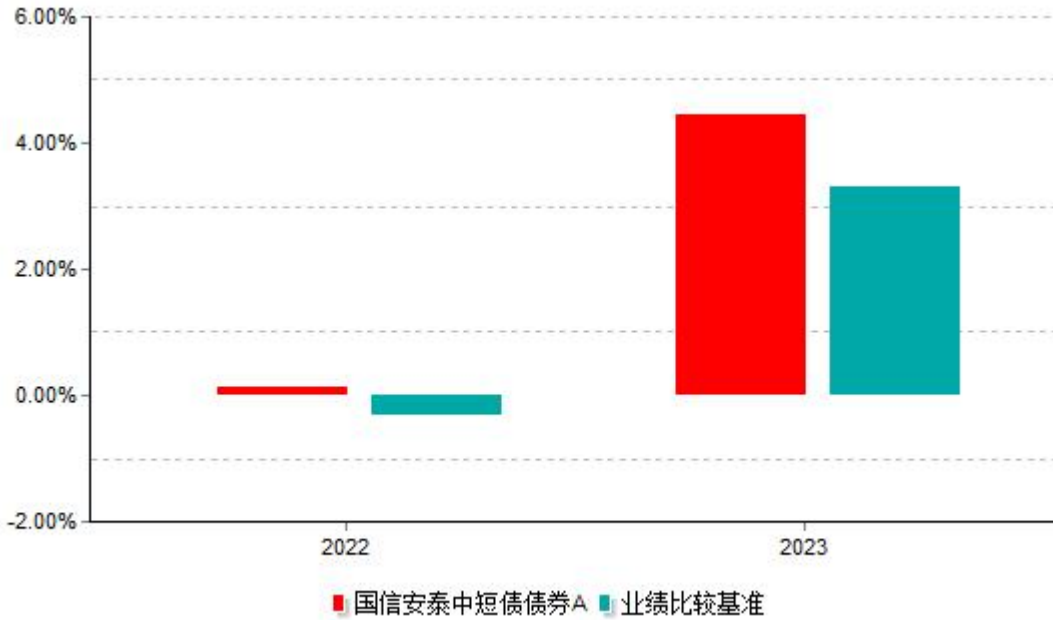


注:1.本集合计划合同于2022年11月1日生效,截至本报告期末本集合计划运作已满一年;
2.按集合计划合同和招募说明书的约定,本集合计划建仓期为合同生效后6个月,报告期末已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。



注:1.本集合计划合同于2022年11月1日生效,截至本报告期末本集合计划运作已满一年;
2.按集合计划合同和招募说明书的约定,本集合计划建仓期为合同生效后6个月,报告期末已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国信证券股份有限公司正式成立于1994年6月30日，于2014年12月29日在深交所上市。截至2023年12月31日，公司注册资本为961,242.9377万元。

截至2023年12月31日，本集合计划管理人共管理了5只参照开放式公开募集证券投资基金管理的集合计划：国信价值智选混合型集合资产管理计划、国信现金增利货币型集合资产管理计划、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划、国信睿丰债券型集合资产管理计划和国信经典组合三个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁策	投资经理	2022-11-01	-	12	梁策，中国国籍，管理学硕士，经济师，具有基金从业资格、证券从业资格，4年证券研究经验、8年证券投资经验。2011年加入国信证券资产管理总部，历任资产管理总部投资助理、投资经理，现任国信证券资产管理总部投资经理。
凌铃	投资经理	2023-12-20	-	8	凌铃，中国国籍，武汉大学应用数学学士，中央财经大学金融学硕士，8年以上证券从业经验。曾任安信证券固定收益部策略研究员、投资经理，重庆农商行总行资金运营部债券及衍生品交

					易岗。现任国信安泰中短债债券型集合资产管理计划、国信睿丰债券型集合资产管理计划投资经理。无其他兼职情况。
--	--	--	--	--	--

注：(1)集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；(2)非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；(3)证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，管理人严格遵守《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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本集合计划的合同等法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，力争为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，无损害持有人利益的行为。集合计划的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及本集合计划合同的规定。

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

管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国信证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理制度（修订）》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配

各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同反向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

管理人通过建立完善的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，保证公平交易原则的实现。在投资决策的内部控制方面，管理人建立了投资证券库，投资组合的投资标的来源于证券库。管理人建立了明确的投资决策流程与授权管理制度，投资经理在授权范围内独立、客观地履行职责，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。管理人建立投资研究沟通机制，通过日常的投资研究各种例会和讨论会，保证各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。在交易过程中，管理人以公平交易为原则，保证各投资组合的交易得到公平、及时、准确地执行。

管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本报告期内同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，要求投资经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本集合计划各项交易均严格按照相关法律法规、集合计划合同的有关要求执行。

本报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年，国内经济经历了从强复苏预期到温和复苏的转变。信用债市场在2022年底超调后高位回落及无风险利率震荡下行呈现强势格局，一揽子化债方案的提出和落地起到推波助澜作用。流动性方面，在稳增长和宽信用诉求下，流动性环境整体合理充裕，宽松中存在波折。具体而言，一季度疫后经济生活迈向正常化，市场对疫后经济复苏的预期较强，资金趋紧，长端利率弱势上行，10年国债一度突破2.9的大关。3月两会确定的5%左右的经济增长目标、政策定调不搞大干快上，进入二季度后，经济内生需求驱动放缓，价格方面CPI和PPI均处于低位。二季度资金面大幅转松，央行公开市场操作保持弹性，维护流动性合理充裕，银行存款利率集中调降，从负债端缓解银行净息差压力。6月央行重提加大“逆周期调节”，中旬政策利率降息落地，OMO、MLF和LPR利率各下调10BP。10年国债加速下行。三季度，中央政治局会议定调经济运行面临新的困难挑战，提出要加大宏观政策调控力度，加强逆周期调节和政策储备，稳健的货币政策精准发力，存款自律机制释放效能。此后，稳增长政策开始落地，8月末至9月初地产宽松政策陆续出台。货币政策方面，国股大行存款利率相继下调，央行此后于8月不对称下调OMO和MLF利率10、15bps，9月降低存款准备金率25bps。但是由于受制于政府债发行加速、缴款规模处于高位以及央行关注资金空转等因素，资金面在8月末收敛，利率曲线整体走平。进入四季度，资金面呈现先收敛再宽松的状态。国庆假期之后，资金面偏紧，国债利率上行至12月上旬的2.71%。但是12月中旬往后，政府债供给压力的缓和，央行8000亿元大额MLF的净投放，资金面显著改善，10年国债利率快速修复至年底的2.56%。全年来看，1年期AAA存单整体下行26bp。全年来看，1年期AAA存单整体下行2BP，3年期AAA、AA+中短期票据收益率分别下行46.01BP、72.04BP，3年期国债下行28BP，10年国债下行11.46BP。（数据来源: wind）

2023年本产品以中短久期信用债为主要配置资产，灵活保持适度久期和杠杆，整体与市场环境较为匹配。操作上精选高性价比个券适度进行交易置换，保持产品良好的流动性资产结构，通过资产比价、杠杆套息、波段交易等策略以期增厚产品收益，关注收益的同时兼顾回撤控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国信安泰中短债债券A基金份额净值为1.0871元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.44%，同期业绩比较基准收益率为3.29%；截至报告期末国信安

泰中短债债券C基金份额净值为1.0840元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.18%，同期业绩比较基准收益率为3.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从基本面来看，经济内生融资需求仍偏弱，1月社融数据好于预期，但是地产数据与PPI未见明显改善，且CPI大幅下降，反映了当前经济企稳，但是周期性复苏仍需等待。随着两会接近，市场将围绕政策刺激力度展开博弈，密切关注政策方面的预期差。债券市场供需格局有利于支撑债券市场总体表现。需求端，居民对固收资产偏好有利于理财规模稳步增长，保险和银行配债动力仍有支撑，供给端匹配负债成本的票息资产或不足，城投化债下供给大幅压缩，票息资产供给收缩，资产荒的逻辑有望进一步延续。流动性方面，货币政策逆周期政策的力度在强化，释放了货币政策加力的信号，流动性预期总体有望维持平衡偏松，时点扰动和分层仍在，但在“防止资金空转”定调下预期资金利率中枢平稳，难以出现大幅宽松。后续仍需密切关注政策预期差和信贷发力情况。

本产品操作上将继续保持稳收益、控回撤的投资风格，将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，把握市场时机，做好各类别资产配置以及比例的动态调整，精选高性价比个券，并将适当参与交易性机会以期增厚组合收益，力争为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本集合计划管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查。相关工作如下：

1、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为资管业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

2、合规审查、检查与培训。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，持续对基金宣传推介材料、销售服务协议等材料文件进行合规审查，定期开展投资者适当性培训及销售业务专项培训，加强销售行为管理。

3、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时和在职工工定期或不定期需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易及其他掌握敏感信息人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录

定期进行合规检查；围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和各项最新监管要求，开展合规培训，进一步提高员工合规守法意识。

反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱自评工作等。

内部监察稽核。管理人内部设立独立的监察稽核部门对集合计划的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行定期风险自查，同时有重点地开展定期不定期的内部稽核，促进业务合规运作。

报告期内，本管理人所管理的投资组合整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善，坚持维护份额持有人合法权益。坚持防范风险，紧密跟踪监管政策及市场变化，持续完善投资合规风控制度流程和工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，不定期开展排查，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下产品严格按照法律法规、合同和公司制度的要求稳健规范运作。

本管理人将本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，提高监察稽核工作的有效性，保障集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同约定，制定了相关估值管理制度，建立了估值委员会，估值委员会下设执行机构估值小组。估值小组负责估值方法决策，并审议估值方法年度评估报告、金融工具估值方法确认和调整的临时议案，以及特殊情况下个别金融工具估值结果调整的临时议案等。估值小组成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与自身担任投资经理的产品估值事项表决投票。

本集合计划托管人根据法律法规要求，审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，履行估值及净值计算的复核责任。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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	天健审〔2024〕7-46号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国信安泰中短债债券型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了国信安泰中短债债券型集合资产管理计划（以下简称国信安泰中短债）财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表，以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国信安泰中短债2023年12月31日的财

	务状况，以及2023年度的经营成果和所有者权益(基金净值)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，我们独立于国信安泰中短债及其管理人国信证券股份有限公司（以下简称基金管理人），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	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估国信安泰中短债的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督国信安泰中短债的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以

	<p>下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 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。(四) 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，就可能导致国信安泰中短债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国信安泰中短债不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就基金的审计范围、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	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	燕玉嵩、黄燕
会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区西溪路128号6楼
审计报告日期	2024-03-29

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国信安泰中短债债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	601,390.73	8,219,709.67
结算备付金		512,337.49	5,722,750.64
存出保证金		21,556.26	35,686.38
交易性金融资产	7.4.7.2	2,138,464,849.05	1,255,927,753.42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,138,464,849.05	1,255,927,753.42
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	7.4.7.3	126,394,749.34	72,041,351.10
应收清算款		-	22,000,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		13,232,487.45	353,680.84
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,279,227,370.32	1,364,300,932.05
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-

卖出回购金融资产款		7,333,232.77	21,999,956.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,829,535.09	26,522,837.71
应付管理人报酬		554,995.30	410,248.50
应付托管费		184,998.40	136,749.51
应付销售服务费		142,634.84	529,659.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		263,945.67	70,776.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.4	200,481.31	82,099.39
负债合计		12,509,823.38	49,752,327.08
净资产：			
实收基金	7.4.7.5	2,086,882,869.15	1,263,333,999.26
未分配利润	7.4.7.6	179,834,677.79	51,214,605.71
净资产合计		2,266,717,546.94	1,314,548,604.97
负债和净资产总计		2,279,227,370.32	1,364,300,932.05

注：报告截止日2023年12月301日，集合计划份额总额2,086,882,869.15份，集合计划A份额净值1.0871元，集合计划A份额1,472,748,407.75份；集合计划C份额净值1.0840元，集合计划C份额614,134,461.40份。

7.2 利润表

会计主体：国信安泰中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日(基 金合同生效日)至2 022年12月31日
一、营业总收入		60,478,016.46	2,892,831.02
1.利息收入		3,197,146.11	1,315,629.04
其中：存款利息收入	7.4.7.7	134,952.85	61,457.51

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		3,062,193.26	1,254,171.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		47,397,096.93	5,873,145.61
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.8	47,397,096.93	5,873,145.61
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		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.9	9,793,481.32	-4,387,909.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.10	90,292.10	91,965.86
减：二、营业总支出		10,575,994.47	1,713,939.02
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,512,494.53	743,775.83
2.托管费	7.4.10.2.2	1,170,831.50	247,925.28
3.销售服务费	7.4.10.2.3	1,320,069.89	529,659.29
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		4,271,216.29	146,707.03
其中：卖出回购金融资产支出		4,271,216.29	146,707.03
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		101,345.28	9,703.27
8.其他费用	7.4.7.11	200,036.98	36,168.32

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,902,021.99	1,178,892.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,902,021.99	1,178,892.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		49,902,021.99	1,178,892.00

7.3 净资产变动表

会计主体：国信安泰中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,263,333,999.26	51,214,605.71	1,314,548,604.97
二、本期期初净资产	1,263,333,999.26	51,214,605.71	1,314,548,604.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	823,548,869.89	128,620,072.08	952,168,941.97
（一）、综合收益总额	-	49,902,021.99	49,902,021.99
（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）	823,548,869.89	78,718,050.09	902,266,919.98
其中：1.基金申购款	3,466,090,890.90	241,225,177.12	3,707,316,068.02
2.基金赎回款	-2,642,542,021.01	-162,507,127.03	-2,805,049,148.04

（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	2,086,882,869.15	179,834,677.79	2,266,717,546.94
项目	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	46,987,070.61	1,850,499.25	48,837,569.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,216,346,928.65	49,364,106.46	1,265,711,035.11
（一）、综合收益总额	-	1,178,892.00	1,178,892.00
（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）	1,216,346,928.65	48,185,214.46	1,264,532,143.11
其中：1.基金申购款	1,809,054,139.83	71,201,098.74	1,880,255,238.57
2.基金赎回款	-592,707,211.18	-23,015,884.28	-615,723,095.46
（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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	1,263,333,999.26	51,214,605.71	1,314,548,604.97

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:

成飞

程芝英

朱彬

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国信安泰中短债债券型集合资产管理计划(以下简称本集合计划)由国信‘金理财’8号集合资产管理计划变更而来。根据中国证监会证券基金机构监管部《关于准予国信‘金理财’8号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函〔2022〕1352号),国信‘金理财’8号集合资产管理计划变更为国信安泰中短债债券型集合资产管理计划,变更后的《国信安泰中短债债券型集合资产管理计划》于2022年11月1日起生效,原《国信‘金理财’8号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划存续期限自集合计划合同生效日起,不得超过3年,本集合计划自集合计划合同生效日起3年后,按照中国证监会有关规定执行。本集合计划类型为债券型集合资产管理计划。国信‘金理财’8号集合资产管理计划于2011年12月6日经中国证监会证监机构字〔2011〕1921号文核准设立,于2012年5月25日募集成立,设立时募集资金到位情况业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(天健验〔2012〕7-1号)。有关集合计划设立等文件已按规定报中国证券投资基金业协会备案。本集合计划的管理人为国信证券股份有限公司(以下简称国信证券),本集合计划托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称中国建设银行),本集合计划的份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《国信安泰中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》《国信安泰中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》,本集合计划投资范围为:债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、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集合计划投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本集合计

划不投资于股票、权证等资产，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。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称企业会计准则)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称中国基金业协会)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国信安泰中短债债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和本集合计划净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

2. 金融负债的分类

金融负债在初始确认时划分为以下三类：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；(2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；(3) 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

1. 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

本集合计划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。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2. 金融资产的后续计量方法

(1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

(3) 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，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

3. 金融负债的后续计量方法

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因本集合计划自身信用风险变动引起的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第23号--金融资产转移》相关规定进行计量。

(3) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

4. 金融资产和金融负债的终止确认

(1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号--金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

(2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、集合计划投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，本集合计划以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：1. 本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；2. 本集合计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，本集合计划不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于集合计划份额拆分引起的实收基金份额变动于集合计划份额拆分日根据拆分前的集合计划份额数及确定的拆分比例计算认列。由于集合计划份额折算引起的实收基金份额变动于集合计划份额折算日根据折算前的集合计划份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。集合计划投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益以现金形式分配，但集合计划份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的集合计划份额净值自动转为集合计划份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括集合计划经营活动产生的未实现损益以及集合计划份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配集合计划收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

无

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本集合计划的集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本集合计划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。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1. 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证券监督管理委员会公告(2017)13号)，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2. 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》（中国基金业协会中基协发〔2017〕6号）之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》（以下简称指引），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

3. 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13号）及中国基金业协会中基协字〔2022〕566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划无差错更正。

7.4.6 税项

根据《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》（财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号）、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46号）、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》（财税〔2016〕70号）、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资

管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资集合计划管理人运用集合计划买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的集合计划、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的集合计划份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

（二）对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

（三）对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对集合计划从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对集合计划持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（四）集合计划卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 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	601,390.73	8,219,709.67
等于：本金	598,748.56	8,212,378.41
加：应计利息	2,642.17	7,331.26
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	601,390.73	8,219,709.67

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	688,401,340.43	12,778,117.92	703,170,337.92	1,990,879.57
	银行间市场	1,409,820,432.41	21,816,511.13	1,435,294,511.13	3,657,567.59
	合计	2,098,221,772.8	34,594,629.05	2,138,464,849.0	5,648,447.16

		4		5	
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	2,098,221,772.84	34,594,629.05	2,138,464,849.05	5,648,447.16	
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	584,717,824.00	11,808,938.35	593,861,538.35	-2,665,224.00
	银行间市场	648,085,371.00	15,595,215.07	662,066,215.07	-1,614,371.00
	合计	1,232,803,195.00	27,404,153.42	1,255,927,753.42	-4,279,595.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	1,232,803,195.00	27,404,153.42	1,255,927,753.42	-4,279,595.00	

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	126,394,749.34	-
银行间市场	-	-
合计	126,394,749.34	-
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	72,041,351.10	-
银行间市场	-	-
合计	72,041,351.10	-

7.4.7.4 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	279.04	7.50
应付交易费用	65,202.27	46,005.98
其中：交易所市场	33,789.65	8,931.67
银行间市场	31,412.62	37,074.31
应付利息	-	-
预提费用	15,000.00	16,085.91
预提费用-信息披露费	120,000.00	20,000.00
合计	200,481.31	82,099.39

7.4.7.5 实收基金

7.4.7.5.1 国信安泰中短债债券A

金额单位：人民币元

项目 (国信安泰中短债债券A)	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	197,347,230.51	197,347,230.51
本期申购	2,345,615,028.95	2,345,615,028.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,070,213,851.71	-1,070,213,851.71
本期末	1,472,748,407.75	1,472,748,407.75

7.4.7.5.2 国信安泰中短债债券C

金额单位：人民币元

项目 (国信安泰中短债债券C)	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	1,065,986,768.75	1,065,986,768.75
本期申购	1,120,475,861.95	1,120,475,861.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,572,328,169.30	-1,572,328,169.30
本期末	614,134,461.40	614,134,461.40

7.4.7.6 未分配利润

7.4.7.6.1 国信安泰中短债债券A

单位：人民币元

项目 (国信安泰中短债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,874,181.61	-1,806,547.66	8,067,633.95
本期期初	9,874,181.61	-1,806,547.66	8,067,633.95
本期利润	22,884,466.15	5,142,055.00	28,026,521.15
本期基金份额交易产生的变动数	96,953,227.26	-4,815,000.75	92,138,226.51
其中：基金申购款	175,676,868.27	-9,409,818.78	166,267,049.49
基金赎回款	-78,723,641.01	4,594,818.03	-74,128,822.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,711,875.02	-1,479,493.41	128,232,381.61

7.4.7.6.2 国信安泰中短债债券C

单位：人民币元

项目 (国信安泰中短债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,862,808.45	-2,715,836.69	43,146,971.76
本期期初	45,862,808.45	-2,715,836.69	43,146,971.76

本期利润	17,224,074.52	4,651,426.32	21,875,500.84
本期基金份额交易产生的变动数	-14,933,192.68	1,513,016.26	-13,420,176.42
其中：基金申购款	72,174,096.45	2,784,031.18	74,958,127.63
基金赎回款	-87,107,289.13	-1,271,014.92	-88,378,304.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,153,690.29	3,448,605.89	51,602,296.18

7.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	67,714.35	53,287.20
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	61,987.91	8,119.05
其他	5,250.59	51.26
合计	134,952.85	61,457.51

7.4.7.8 债券投资收益

7.4.7.8.1 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2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	49,018,464.49	6,670,051.70
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,621,367.56	-796,906.09
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	47,397,096.93	5,873,145.61

7.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日） 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	3,044,712,839.42	1,505,144,241.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,968,120,396.57	1,483,893,130.00
减：应计利息总额	78,115,959.42	21,985,226.04
减：交易费用	97,850.99	62,791.09
买卖债券差价收入	-1,621,367.56	-796,906.09

7.4.7.9 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20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
1.交易性金融资产	9,928,042.16	-4,390,225.00
——股票投资	-	-
——债券投资	9,928,042.16	-4,390,225.00
——资产支持证券投资	-	-
——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	134,560.84	-2,315.51
合计	9,793,481.32	-4,387,909.49

7.4.7.10 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	90,292.10	91,965.86
合计	90,292.10	91,965.86

7.4.7.11 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11月01日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	-	-
信息披露费	120,000.00	20,000.00
银行结算费用	37,077.01	9,198.50
审计费用	6,000.00	1,002.24
帐户维护费	35,760.00	5,967.58
其它费用	1,199.97	-
合计	200,036.98	36,168.32

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国信证券股份有限公司	管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	托管人

注1：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化

2：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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11月01日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国信证券	1,227,180,580.00	100.00%	944,681,290.00	100.00%

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11月01日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
国信证券	11,892,293,100.00	100.00%	1,312,360,000.00	100.00%

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	74,760.75	100.00%	33,789.65	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	49,435.79	100.00%	8,931.67	100.00%

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11月01日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,512,494.53	743,775.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	612,002.95	328,216.86
应支付基金管理人的净管理费	2,900,491.58	415,558.97

注：1.本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

本集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。

2.根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，集合计划管理人依据销售机构销售集合计划的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向集合计划销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从集合计划管理费中列支。

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11月01日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,170,831.50	247,925.28

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 。

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

本集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。

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		
	国信安泰中短债债券A	国信安泰中短债债券C	合计
国信证券	0.00	482,525.13	482,525.13
建设银行	0.00	771,041.30	771,041.30
合计	0.00	1,253,566.43	1,253,566.43

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年11月01日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国信安泰中短债债券A	国信安泰中短债债券C	合计
国信证券	0.00	6,884.83	6,884.83
建设银行	0.00	522,774.30	522,774.30
合计	0.00	529,659.13	529,659.13

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额销售服务费年费率为0.25%。

本集合计划销售服务费按前一日C类集合计划资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为 C类份额每日应计提的销售服务费

E为 C类份额前一日的集合计划资产净值

C类份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国信安泰中短债债券A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年11月01日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年11月01日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	9,322,207.72	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	9,322,207.72	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.63%	-

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本集合计划本报告期末及上年年末数除集合计划管理人之外的其他关联方没有投资及持有本集合计划份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年11月01日（基金合同生效日） 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
中国建设银行股份有限公司	601,390.73	67,714.35	8,219,709.67	53,287.20

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期末进行利润分配。

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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末持有股票。

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

金额单位：人民币元

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,333,232.77元，是以如下债券作为质押：

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
230421	23农发21	2024-01-02	100.57	78,000	7,844,749.83
合计				78,000	7,844,749.83

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

目前，管理人建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

（1）董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

（2）经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策，首席风险官牵头开展全面风险管理工作。

（3）独立的风险管理机构（多部门协同）

风险管理总部及相关职能部门牵头各类风险的管理工作。风险管理总部是市场风险、信用风险、操作风险的牵头部门，协同相关专业部门开展流动性风险、信息技术风险、声誉风险管理工作。各部门充分发挥了各自的专业优势，在事前、事中、事后的环节中，对各类型风险予以评估、监测、检查、考核等，形成了全面风险管理合力。

（4）业务部门（含风控中台）

业务部门是风险管理第一责任部门，业务部门负责人是本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的各类风险承担责任。业务部门建立风控中台（二级部门或风险管理专岗）负责本部门风险管理细则制定、日常业务审核、业务风险排查、风险资料报送等工作，风控中台还承担了业务前台和风险管理部门之间的沟通职责，起到承上启下的重要作用。

公司已形成多部门通力协作、相互制衡的风险管理体系，公司风险控制委员会、首席风险官在风险资源配置、风险限额管理等工作中也发挥统筹管理的作用。

对于集合计划运作，业务部门建立了明确的投资决策流程与授权管理制度，投资决策委员会、投资部门或团队负责人和投资人员对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据不同权限独立、客观地履行职责，实施风险控制。投资、交易、风险、合规管理以及清算人员在不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理，形成了一套贯穿事前监控、事中管理和事后评估的风险监控体系。

本集合计划管理人按照自上而下与自下而上相结合的方式，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。

日常经营活动中本集合计划面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本集合计划在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产损失和收益变化的风险。本集合计划管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本集合计划在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。截止本报告期末，本集合计划持有债券占资产净值的比例为94.34%。

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	102,279,114.75	-
A-1以下	-	-
未评级	393,932,666.65	323,076,610.96
合计	496,211,781.40	323,076,610.96

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	49,519,763.74	-
合计	49,519,763.74	-

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	940,165,933.67	494,068,449.31
AAA以下	292,925,485.83	394,191,021.92
未评级	359,641,884.41	44,591,671.23
合计	1,592,733,303.91	932,851,142.46

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，由风险管理部门独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

截止本报告期末，本集合计划主要持有高流动性债券资产和短期买入返售资产，仅持有较小比例的短期卖出回购金融资产。

本集合计划的管理人建立了应急处理管理办法及资产管理业务流动性风险管理办法，在集合计划运作过程中按照监管机构法规、以及公司制度要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理人员对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

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

利率风险是指集合计划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。管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	601,390.73	-	-	-	601,390.73
结算备付金	512,337.49	-	-	-	512,337.49
存出保证金	21,556.26	-	-	-	21,556.26
交易性金融资产	1,185,913,169.99	889,710,083.44	62,841,595.62	-	2,138,464,849.05
买入返售金融资产	126,394,749.34	-	-	-	126,394,749.34
应收申购款	-	-	-	13,232,487.45	13,232,487.45
资产总计	1,313,443,203.81	889,710,083.44	62,841,595.62	13,232,487.45	2,279,227,370.32
负债					
卖出回购金融资产款	7,333,232.77	-	-	-	7,333,232.77
应付赎回款	-	-	-	3,829,535.09	3,829,535.09
应付管理人报酬	-	-	-	554,995.30	554,995.30

应付托管费	-	-	-	184,998.40	184,998.40
应付销售服务费	-	-	-	142,634.84	142,634.84
应交税费	-	-	-	263,945.67	263,945.67
其他负债	-	-	-	200,481.31	200,481.31
负债总计	7,333,232.77	-	-	5,176,590.61	12,509,823.38
利率敏感度缺口	1,306,109,971.04	889,710,083.44	62,841,595.62	8,055,896.84	2,266,717,546.94
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,219,709.67	-	-	-	8,219,709.67
结算备付金	5,722,750.64	-	-	-	5,722,750.64
存出保证金	35,686.38	-	-	-	35,686.38
交易性金融资产	1,000,424,705.49	255,503,047.93	-	-	1,255,927,753.42
买入返售金融资产	72,041,351.10	-	-	-	72,041,351.10
应收清算款	-	-	-	22,000,000.00	22,000,000.00
应收申购款	-	-	-	353,680.84	353,680.84
资产总计	1,086,444,203.28	255,503,047.93	-	22,353,680.84	1,364,300,932.05
负债					
卖出回购金融	21,999,956.00	-	-	-	21,999,956.00

资产款					
应付赎回款	-	-	-	26,522,837.71	26,522,837.71
应付管理人报酬	-	-	-	410,248.50	410,248.50
应付托管费	-	-	-	136,749.51	136,749.51
应付销售服务费	-	-	-	529,659.29	529,659.29
应交税费	-	-	-	70,776.68	70,776.68
其他负债	-	-	-	82,099.39	82,099.39
负债总计	21,999,956.00	-	-	27,752,371.08	49,752,327.08
利率敏感度缺口	1,064,444,247.28	255,503,047.93	-	-5,398,690.24	1,314,548,604.97

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动25个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	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
	基准利率增加25个基点	-3,821,316.17	-1,468,731.13
基准利率减少25个基点	3,838,000.88	1,473,858.64	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险指投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。本集合计划年度内未进行海外市场资产投资。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券类资产，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划的基金管理人采用风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,138,464,849.05	94.34	1,255,927,753.42	95.54
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	2,138,464,849.05	94.34	1,255,927,753.42	95.54
----	------------------	-------	------------------	-------

7.4.13.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,138,464,849.05	1,255,927,753.42
第三层次	-	-
合计	2,138,464,849.05	1,255,927,753.42

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期内不存在非持续的以公允价值计量的金融工具的情况。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,138,464,849.05	93.82
	其中：债券	2,138,464,849.05	93.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	126,394,749.34	5.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,113,728.22	0.05
8	其他各项资产	13,254,043.71	0.58
9	合计	2,279,227,370.32	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本集合计划本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	477,767,919.56	21.08
	其中：政策性金融债	132,215,601.09	5.83
4	企业债券	719,949,011.96	31.76
5	企业短期融资券	415,248,655.72	18.32
6	中期票据	475,979,498.07	21.00
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	49,519,763.74	2.18
9	其他	-	-
10	合计	2,138,464,849.05	94.34

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	1928013	19民生银行永续债	1,300,000	134,531,849.73	5.94
2	230206	23国开06	700,000	70,905,754.10	3.13
3	185285	22海通01	600,000	61,771,298.63	2.73
4	072310054	23东北证券CP004	600,000	61,548,098.36	2.72
5	072310282	23东财证券CP019	600,000	60,157,590.16	2.65

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、西部证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营未产生重大负面影响。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 报告期末，本集合计划未持有股票资产。

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	21,556.26
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,232,487.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,254,043.71

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有期权。

§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
国信 安泰 中短 债债 券A	8,487	173,529.92	513,741,682.94	34.8 8%	959,006,724.81	65.12%
国信 安泰 中短 债债 券C	5,556	110,535.36	90,727,341.64	14.7 7%	523,407,119.76	85.23%
合计	14,043	148,606.63	604,469,024.58	28.9 7%	1,482,413,844.57	71.03%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国信安泰中短债债券A	18,875,044.59	1.28%
	国信安泰中短债债券C	4,087,720.51	0.67%
	合计	22,962,765.10	1.10%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	国信安泰中短债债券A	0
	国信安泰中短债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国信安泰中短债债券A	0
	国信安泰中短债债券C	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人指本公司高级管理人员以及本公司资产管理总部总经理、从事大集合业务的副总经理及总经理助理、大集合投资团队负责人和研究团队负责人。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	国信安泰中短债债券A	国信安泰中短债债券C
基金合同生效日(2022年11月01日)基金份额总额	-	-
本报告期期初基金份额总额	197,347,230.51	1,065,986,768.75
本报告期基金总申购份额	2,345,615,028.95	1,120,475,861.95

减：本报告期基金总赎回份额	1,070,213,851.71	1,572,328,169.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,472,748,407.75	614,134,461.40

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本集合计划管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违法违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分

的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	-	-	74,760.75	100.00%	-

注：1.我对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；
2.本报告期内本计划租用券商交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	1,227,180,580.00	100.00%	11,892,293,100.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划实施申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-01-03
2	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划增加蚂蚁（杭	规定媒介	2023-03-09

	州)基金销售有限公司为代销机构的公告		
3	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划实施申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-03-17
4	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划增加上海万得基金销售有限公司为代销机构的公告	规定媒介	2023-03-23
5	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告	规定媒介	2023-04-27
6	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划实施申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-06-21
7	关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划暂停大额申购业务的公告	规定媒介	2023-07-07
8	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划增加京东肯特瑞基金销售有限公司为代销机构的公告	规定媒介	2023-08-10
9	国信证券股份有限公司关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划实施申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-08-10
10	关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划调整各销	规定媒介	2023-08-21

	售渠道大额申购业务的公告		
11	国信证券股份有限公司关于运用自有资金投资旗下集合资产管理计划的公告	规定媒介	2023-08-24
12	关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划调整部分销售渠道大额申购业务的公告	规定媒介	2023-09-22
13	关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划调整部分销售渠道大额申购业务的公告	规定媒介	2023-11-13
14	国信安泰中短债债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	规定媒介	2023-12-19
15	国信安泰中短债债券型集合资产管理计划招募说明书（2023年12月）	规定媒介	2023-12-19
16	国信安泰中短债债券型集合资产管理计划（A类份额和C类份额）基金产品资料概要（2023年12月）	规定媒介	2023-12-19
17	国信证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划开展申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-12-26
18	关于国信安泰中短债债券型集合资产管理计划调整机构及产品投资者大额申购限额的公告	规定媒介	2023-12-27

注：规定媒介指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介。

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国信”金理财“8号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划托管协议；
- 5、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要；
- 6、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要；
- 7、法律意见书；
- 8、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 9、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 10、国信安泰中短债债券型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告；
- 11、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站www.guosen.com.cn。

13.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人、托管人的办公时间预约查阅,或登录集合计划管理人网站www.guosen.com.cn查阅，还可拨打本公司客服电话（95536）查询相关信息。

国信证券股份有限公司
二〇二四年三月二十九日