

安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 1         |
| 1.2 目录                                  | 2         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>4</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 4         |
| 2.2 基金产品说明                              | 4         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 5         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>5</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 5         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>14</b> |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 16        |
| 7.2 利润表                                 | 18        |
| 7.3 净资产变动表                              | 19        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 42        |
| 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       | 43        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 43        |
| 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 .....    | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 44        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 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 .....      | 45        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>45</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 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 .....         | 46        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 48        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>49</b> |
| 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 .....    | 49        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 49        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 50        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 50        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 安信丰泽 39 个月定开债券          |
| 基金主代码      | 008523                  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 3 月 5 日          |
| 基金管理人      | 安信基金管理有限责任公司            |
| 基金托管人      | 上海浦东发展银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 7,995,843,183.27 份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金严格采用持有到期策略,将基金资产配置于到期日(或回售期限)在封闭期结束之前的固定收益资产,力求实现基金资产的持续稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>封闭期配置策略方面,本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略构建投资组合,所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期,所投资产到期日(或回售日)不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时,应在投资该债券前,确定行使回售权或持有至到期的时间;债券到期日晚于封闭运作期到期日的,基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。信用策略方面,在基金投资过程中,个券的信用风险管理的主要依据该券的内外评级结果。信用评级包括主体信用评级、债项信用评级和评级展望,评级对象包括除国债、央行票据和政策性金融债之外的其他各类债券。放大策略方面,本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。资产支持证券投资策略方面,本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券产品的投资。封闭期现金管理策略方面,在每个封闭期内完成组合的构建之前,本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理,选择到期日(或回售日)在建仓期之内的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资,并采用买入持有到期投资策略。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。</p> |

|        |  |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 金融机构三年期定期存款利率(税后)+1%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。<br>根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。 |

### 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          |      | 安信基金管理有限责任公司                        | 上海浦东发展银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 孙晓奇                                 | 朱萍                    |
|             | 联系电话 | 0755-82509999                       | 021-31888888          |
|             | 电子邮箱 | service@essencefund.com             | zhup02@spdb.com.cn    |
| 客户服务电话      |      | 4008-088-088                        | 95528                 |
| 传真          |      | 0755-82799292                       | 021-63602540          |
| 注册地址        |      | 广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层 | 上海市中山东一路 12 号         |
| 办公地址        |      | 广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码        |      | 518026                              | 200126                |
| 法定代表人       |      | 刘入领                                 | 张为忠                   |

### 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.essencefund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所       |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                                    |
|--------|--------------------------|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼               |
| 注册登记机构 | 安信基金管理有限责任公司             | 广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号<br>新世界商务中心 36 层 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|         |        |        |        |
|---------|--------|--------|--------|
| 3.1.1 期 | 2023 年 | 2022 年 | 2021 年 |
|---------|--------|--------|--------|

|               |                  |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 间数据和指标        |                  |                  |                  |
| 本期已实现收益       | 116,390,225.28   | 27,924,503.30    | 25,103,433.36    |
| 本期利润          | 116,390,225.28   | 27,924,503.30    | 25,103,433.36    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0230           | 0.0279           | 0.0251           |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.28%            | 2.72%            | 2.45%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.54%            | 2.75%            | 2.48%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末          | 2022 年末          | 2021 年末          |
| 期末可供分配利润      | 108,791,938.59   | 9,406,207.51     | 36,645,821.05    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0136           | 0.0094           | 0.0366           |
| 期末基金资产净值      | 8,104,635,121.86 | 1,009,497,735.78 | 1,036,737,349.32 |
| 期末基金份额净值      | 1.0136           | 1.0094           | 1.0366           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末          | 2022 年末          | 2021 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 9.76%            | 7.03%            | 4.17%            |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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。

2、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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，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。

### 3.2 基金净值表现

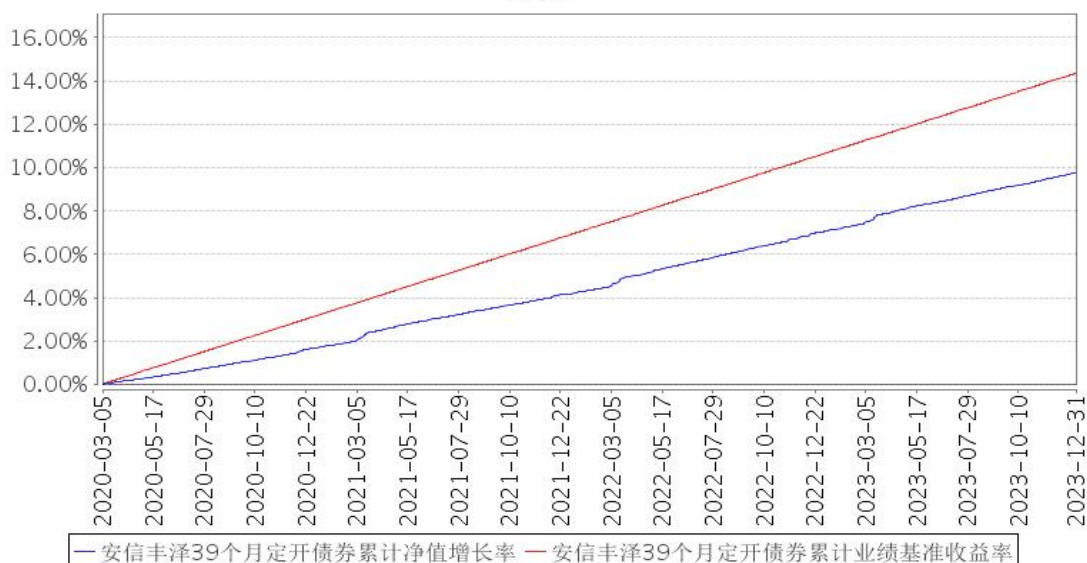
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.57%    | 0.01%       | 0.95%      | 0.01%         | -0.38% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.17%    | 0.01%       | 1.89%      | 0.01%         | -0.72% | 0.00% |
| 过去一年       | 2.54%    | 0.01%       | 3.75%      | 0.01%         | -1.21% | 0.00% |
| 过去三年       | 7.97%    | 0.01%       | 11.25%     | 0.01%         | -3.28% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.76%    | 0.01%       | 14.35%     | 0.01%         | -4.59% | 0.00% |

注：根据《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率（税后）+1%。本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，每个封闭期为 39 个月，期间投资人无法进行基金份额申购与赎回。以与封闭期同期基本对应的三年期定期存款利率（税后）加上利差作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征和流动性特征，合理衡量本基金的业绩表现。三年期定期存款利率采用每个封闭期起始日中国人民银行公布的金融机构人民币三年期存款基准利率。

#### 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

安信丰泽39个月定开债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



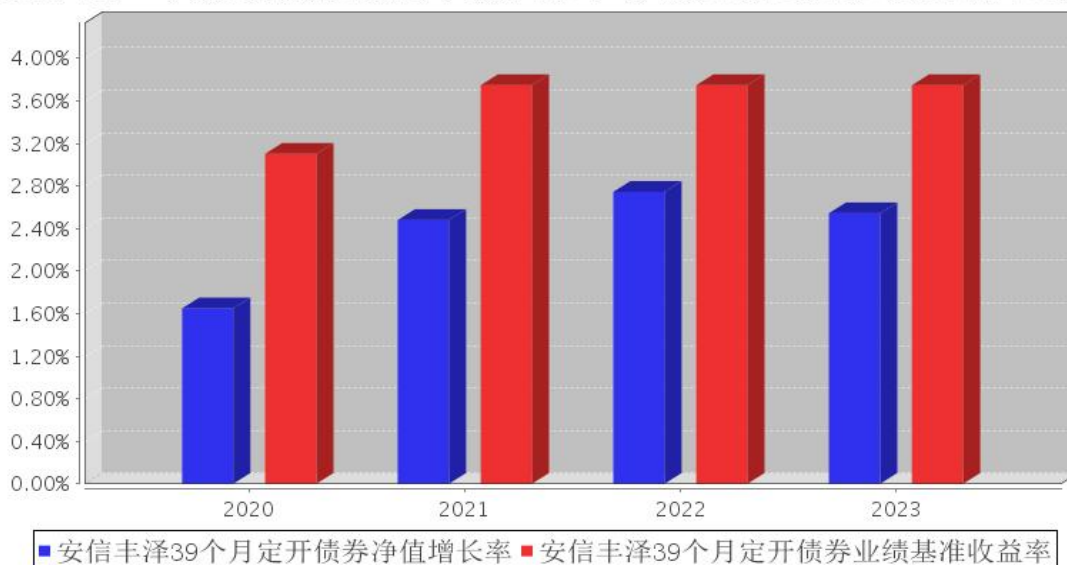
注：1、本基金合同生效日为 2020 年 3 月 5 日。



2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 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

安信丰泽39个月定开债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2023 年 | 0.2120        | 21,201,940.09 | -         | 21,201,940.09 | -  |
| 2022 年 | 0.5500        | 55,005,034.25 | -         | 55,005,034.25 | -  |
| 合计     | 0.7620        | 76,206,974.34 | -         | 76,206,974.34 | -  |

## § 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

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 87 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵

活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有

期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金。

#### 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（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-----------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 王涛  | 本基金的基金经理 | 2020 年 3 月 5 日  | -    | 20 年   | 王涛先生，经济学硕士，CFA、FRM。历任中国工商银行股份有限公司深圳分行资金运营部交易员、招商银行股份有限公司金融市场部交易员、东莞证券有限责任公司深圳分公司投资经理、融通基金管理有限公司基金经理、安信基金管理有限公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 魏晓菲 | 本基金的基金经理 | 2023 年 1 月 20 日 | -    | 10 年   | 魏晓菲女士，法学硕士。历任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理助理   |

|     |          |                 |                 |     |  |
|-----|----------|-----------------|-----------------|-----|--|
|     |          |                 |                 |     | 理、固定收益部投资经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司机构投资部投资经理，华润元大基金管理有限公司专户投资部投资经理、投资管理部基金经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。   |
| 祝璐琛 | 本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 23 日 | 2023 年 8 月 17 日 | 7 年 | 祝璐琛先生，经济学硕士，曾任华西证券股份有限公司固定收益部交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部分析师，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信现金增利货币市场基金的基金经理助理；安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。 |

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写。“离职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同

向交易进行投资组合间利益输送的行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

宏观方面，2023 年经统计局初步核算的全年 GDP 比上年同期增长 5.2%，节奏上全年四个季度的环比增速分别为 2.1%、0.6%、1.5%和 1.0%，呈现一三季度加速、二四季度回落的态势。总体来看，在比较复杂的国际形势和美国持续加息带来的压力下，我国经济回升向好的趋势没有变，在结构方面更扎实地向高质量发展推进，工业生产、服务业、消费较快修复，保持汇率基本稳定，进出口总体平稳，贸易结构持续优化。在宏观政策方面，财政和货币政策双管齐下，财政加力提效，央行全年两次降息、两次降准，同时在化解地产相关风险、地方政府债务风险等重点领域出台支持和化解政策。固定收益市场方面，受益于私人部门偏低的风险偏好持续形成的配置资金、宽松货币政策推动全社会融资成本下行等，全年各品种各期限债券收益率平均来看有不同程度的下行，其中利率债方面长期和超长期国债表现更好，中债 10 年国债收益率曲线下行约 27bp，中债 30 年国债收益率曲线下行约 37bp，期限收益率曲线呈扁平态势；信用债方面则一定程度上演绎了资产荒行情，资质较好的银行资本补充类债券和受益于化债方案的城投债券利差收窄明显。

本基金于 2023 年 6 月上旬结束上一个封闭期并开放，在下半年新一轮封闭期的建仓过程中，历经两次合计 25bp 的公开市场降息操作，并经受了因财政发力和汇率压力共振带来的较长时间融资成本偏高的压力。管理人秉承稳健的建仓策略，截至 2023 年末，本基金基本完成了基础底仓和杠杆部分的资产配置，开始进入运作较为稳定的杠杆维持期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0136 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.54%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%。

#### 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，我们认为从去年我国经济在应对较大的外部压力和化解内部风险点、堵点上取得的成绩单看，反映了我国经济有较强的韧性，高质量发展的顶层设计和防范化解重大风险的系列举措都将助力经济结构的长远健康发展，整体上延续稳中有进的复苏态势。我们认为 2024 年政策层面会有进一步的财政、货币政策组合出台，较为宽松的货币环境仍然可期，期限利差预计将从当前较低的水平上有所扩大。不确定因素方面仍需关注美国通胀演化的进程、海外需求变化及地缘政治对我国出口的影响。

本基金将继续维持稳定的杠杆运作，并力求通过合理安排杠杆融资跨市场、跨期限的搭配来尽量降低总体融资成本，增厚组合收益。

#### 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，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观

性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 21,201,940.09 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 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

无。

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由安信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

|         |  |
|---------|--|
| 审计报告标题  | 审计报告                                       |
| 审计报告收件人 | 安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人           |
| 审计意见    | (一)我们审计的内容<br>我们审计了安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金 |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>(以下简称“安信丰泽 39 个月定开债券基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了安信丰泽 39 个月定开债券基金 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。</p>                      |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于安信丰泽 39 个月定开债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 强调事项            | 无   |
| 其他事项            | 无   |
| 其他信息            | <p>安信丰泽 39 个月定开债券基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括安信丰泽 39 个月定开债券基金 2023 年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。基于我们已经执行的工作,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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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,基金管理人管理层负责评估安信丰泽 39 个月定开债券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,除非基金管理人管理层计划清算安信丰泽 39 个月定开债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督安信丰泽 39 个月定开债券基金的财务报告过程。</p>                              |
| 注册会计师对财务报表审计的责  | 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  |



|           |  |
|-----------|--|
| 任         | <p>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>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对安信丰泽 39 个月定开债券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安信丰泽 39 个月定开债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名  | 沈兆杰   崔泽宇  |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |
| 审计报告日期    | 2024 年 03 月 28 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 1,131,752.79                    | 2,583,020.52                     |
| 结算备付金         |            | 92,832,884.34                   | 3,843,254.39                     |
| 存出保证金         |            | 821.52                          | -                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | -                               | -                                |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | 14,070,107,591.23               | 1,470,246,156.27                 |
| 其中：债券投资       |            | 14,070,107,591.23               | 1,470,246,156.27                 |
| 应收清算款         |            | 421,380.57                      | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 14,164,494,430.45               | 1,476,672,431.18                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 6,058,055,942.54                | 466,626,390.64                   |
| 应付清算款         |            | -                               | 146,640.95                       |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,031,498.32                    | 128,555.07                       |
| 应付托管费         |            | 343,832.77                      | 42,851.70                        |
| 应付销售服务费       |            | -                               | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | -                               | -                                |
| 应付利润          |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                               | -                                |
| 其他负债          | 7.4.7.7    | 428,034.96                      | 230,257.04                       |
| 负债合计          |            | 6,059,859,308.59                | 467,174,695.40                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金          | 7.4.7.8    | 7,995,843,183.27                | 1,000,091,528.27                 |
| 未分配利润         | 7.4.7.9    | 108,791,938.59                  | 9,406,207.51                     |

|          |  |                   |                  |
|----------|--|-------------------|------------------|
| 净资产合计    |  | 8,104,635,121.86  | 1,009,497,735.78 |
| 负债和净资产总计 |  | 14,164,494,430.45 | 1,476,672,431.18 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0136 元，基金份额总额 7,995,843,183.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 183,733,494.74                            | 42,526,005.50                                  |
| 1. 利息收入                |          | 183,733,494.74                            | 41,546,440.39                                  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.10 | 2,304,921.89                              | 79,294.24                                      |
| 债券利息收入                 |          | 175,628,672.82                            | 41,464,480.32                                  |
| 资产支持证券利息收入             |          | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |          | 5,799,900.03                              | 2,665.83                                       |
| 其他利息收入                 |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | -   | 979,565.11                                     |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.11 | -   | -  |
| 基金投资收益                 |          | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.12 | -   | -  |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.13 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14 | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15 | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.16 | -   | -  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |          | -   | 979,565.11                                     |
| 其他投资收益                 |          | -   | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18 | -   | -  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 67,343,269.46                             | 14,601,502.20                                  |

|                            |            |                |               |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 7,527,643.04   | 1,538,231.10  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 2,509,214.34   | 512,743.72    |
| 3. 销售服务费                   |            | -              | -             |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 56,855,894.50  | 12,406,136.49 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 56,855,894.50  | 12,406,136.49 |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.19   | 167,617.26     | -97,301.56    |
| 7. 税金及附加                   |            | -              | -             |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 282,900.32     | 241,692.45    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 116,390,225.28 | 27,924,503.30 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 116,390,225.28 | 27,924,503.30 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 116,390,225.28 | 27,924,503.30 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |        |                |                  |
|-------------------------------------|--|--------|----------------|------------------|
|                                     | 实收基金                                   | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                           | 1,000,091,528.27                       | -      | 9,406,207.51   | 1,009,497,735.78 |
| 二、本期期初净资产                           | 1,000,091,528.27                       | -      | 9,406,207.51   | 1,009,497,735.78 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 6,995,751,655.00                       | -      | 99,385,731.08  | 7,095,137,386.08 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                      | -      | 116,390,225.28 | 116,390,225.28   |
| （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） | 6,995,751,655.00                       | -      | 4,197,445.89   | 6,999,949,100.89 |
| 其中：1. 基金申                           | 6,995,815,844.                         | -      | 4,197,494.74   | 7,000,013,339.1  |

|  |   |        |                |                  |
|--|---|--------|----------------|------------------|
| 购款                                       | 39  |        |                | 3                |
| 2. 基金赎回款                                 | -64,189.39                                  | -      | -48.85         | -64,238.24       |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -   | -      | -21,201,940.09 | -21,201,940.09   |
| 四、本期期末净资产                                | 7,995,843,183.27                            | -      | 108,791,938.59 | 8,104,635,121.86 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |        |                |                  |
|  | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 1,000,091,528.27                            | -      | 36,645,821.05  | 1,036,737,349.32 |
| 加：会计政策变更                                 | -   | -      | -159,082.59    | -159,082.59      |
| 二、本期期初净资产                                | 1,000,091,528.27                            | -      | 36,486,738.46  | 1,036,578,266.73 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -   | -      | -27,080,530.95 | -27,080,530.95   |
| (一)、综合收益总额                               | -   | -      | 27,924,503.30  | 27,924,503.30    |
| (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)      | -   | -      | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                              | -   | -      | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                                 | -   | -      | -              | -                |
| (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) | -   | -      | -55,005,034.25 | -55,005,034.25   |

|           |                  |   |              |                  |
|-----------|------------------|---|--------------|------------------|
| 四、本期期末净资产 | 1,000,091,528.27 | - | 9,406,207.51 | 1,009,497,735.78 |
|-----------|------------------|---|--------------|------------------|

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 刘入领      | 廖维坤       | 苗杨      |
| 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

安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]2482 号《关于准予安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,000,091,334.79 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0115 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,091,528.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 193.48 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金以 39 个月为一个封闭期,自基金合同生效后,每 39 个月开放一次申购和赎回。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、政策性金融债、同业存单、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、债券正/逆回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票、可转换债券和可交换债券,但可以投资分离交

易可转债上市后分离出来的债券。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金开放期开始前 3 个月、开放期以及开放期结束后的 3 个月内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 5% 的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：在每个封闭期起始日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币三年期定期存款利率(税后)+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

本基金 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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金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。本基金现无金融资产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及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、债权投资、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债权投资的账面价值中。

对于应收款项、债权投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并



未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金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认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法

都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以摊余成本计量的金融资产于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、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) 本基金的基金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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 预期信用损失的计量

对于以摊余成本计量的金融资产，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设，这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和对手方的信用行为。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金管理人通过违约风险敞口和预期信用损失率计算预期信用损失，并基于违约概率和违约损失率确定预期信用损失率。在划分减值阶段及确定预期信用损失率时，本基金管理人使用可获取的外部评级、外部报告和外部统计数据等。

在考虑前瞻性信息时，本基金考虑了不同的宏观经济情景。本基金定期监控并复核与预期信用损失计算相关的重要宏观经济假设和参数，包括经济下滑的风险、外部市场环境、技术环境、客户情况的变化、国内生产总值和消费者物价指数等。2023 年度，本基金已考虑了不同的宏观经济情景下的不确定性，并相应更新了相关假设和参数。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 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]70 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]140 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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,131,752.79            | 2,583,020.52             |
| 等于：本金          | 1,131,565.67            | 2,582,770.63             |
| 加：应计利息         | 187.12                  | 249.89                   |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 合计             | 1,131,752.79            | 2,583,020.52             |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末及上年度末无交易性金融资产。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/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

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

###### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日  |               |               |            |                   |
|--------|-------|--------------------------|---------------|---------------|------------|-------------------|
|        |       | 初始成本                     | 利息调整          | 应计利息          | 减：减值准备     | 账面价值              |
| 债券     | 交易所市场 | 3,640,000,000.00         | -1,484,657.03 | 29,727,843.86 | 220,390.33 | 3,668,022,796.50  |
|        | 银行间市场 | 10,250,000,000.00        | 82,596,591.43 | 69,488,203.30 | -          | 10,402,084,794.73 |
|        | 小计    | 13,890,000,000.00        | 81,111,934.40 | 99,216,047.16 | 220,390.33 | 14,070,107,591.23 |
| 资产支持证券 |       | -                        | -             | -             | -          | -                 |
| 其他     |       | -                        | -             | -             | -          | -                 |
| 合计     |       | 13,890,000,000.00        | 81,111,934.40 | 99,216,047.16 | 220,390.33 | 14,070,107,591.23 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |               |               |            |                   |
|        |       | 初始成本                     | 利息调整          | 应计利息          | 减：减值准备     | 账面价值              |
| 债券     | 交易所市场 | 370,000,000.00           | 203,892.98    | 7,599,230.14  | 18,510.88  | 377,784,612.24    |
|        | 银行间市场 | 1,070,000,000.00         | 2,005,905.93  | 20,489,900.29 | 34,262.19  | 1,092,461,544.03  |
|        | 小计    | 1,440,000,000.00         | 2,209,798.91  | 28,089,130.43 | 52,773.07  | 1,470,246,156.27  |
| 资产支持证券 |       | -                        | -             | -             | -          | -                 |
| 其他     |       | -                        | -             | -             | -          | -                 |
| 合计     |       | 1,440,000,000.00         | 2,209,798.91  | 28,089,130.43 | 52,773.07  | 1,470,246,156.27  |

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段           | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计        |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|-----------|
|           | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |           |
| 期初余额      | 52,773.07      | -                    | -                    | 52,773.07 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -         |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -         |

|      |            |   |   |            |
|------|------------|---|---|------------|
| 本期新增 | 246,049.19 | - | - | 246,049.19 |
| 本期转回 | 78,431.93  | - | - | 78,431.93  |
| 其他变动 | -          | - | - | -          |
| 期末余额 | 220,390.33 | - | - | 220,390.33 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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      | 198,734.96              | 20,957.04                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 198,734.96              | 20,957.04                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 应付信息披露费     | 120,000.00              | 120,000.00               |
| 应付审计费       | 100,000.00              | 80,000.00                |
| 应付银行间账户维护费  | 9,300.00                | 9,300.00                 |
| 合计          | 428,034.96              | 230,257.04               |

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|--|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,000,091,528.27                       | 1,000,091,528.27 |
| 本期申购          | 6,995,815,844.39                       | 6,995,815,844.39 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -64,189.39                             | -64,189.39       |
| 本期末           | 7,995,843,183.27                       | 7,995,843,183.27 |

注：申购份额含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目       | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末     | 9,406,207.51   | -     | 9,406,207.51   |
| 本期期初     | 9,406,207.51   | -     | 9,406,207.51   |
| 本期利润     | 116,390,225.28 | -     | 116,390,225.28 |
| 本期基金份额交易 | 4,197,445.89   | -     | 4,197,445.89   |

|          |                |   |                |
|----------|----------------|---|----------------|
| 产生的变动数   |                |   |                |
| 其中：基金申购款 | 4,197,494.74   | - | 4,197,494.74   |
| 基金赎回款    | -48.85         | - | -48.85         |
| 本期已分配利润  | -21,201,940.09 | - | -21,201,940.09 |
| 本期末      | 108,791,938.59 | - | 108,791,938.59 |

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
|           | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入  | 131,012.07                       | 11,802.35                        |
| 定期存款利息收入  | -                                | -                                |
| 其他存款利息收入  | 1,857,833.33                     | -                                |
| 结算备付金利息收入 | 316,071.79                       | 67,491.89                        |
| 其他        | 4.70                             | -                                |
| 合计        | 2,304,921.89                     | 79,294.24                        |

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入

#### 7.4.7.11 股票投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金于本期及上年度可比期间均无股利收益。



#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金于本期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 |
|----------|---|--|
| 银行存款     | -   | -  |
| 买入返售金融资产 | -   | -  |
| 债权投资     | 167,617.26                                | -97,301.56                                     |
| 其他债权投资   | -   | -  |
| 其他       | -   | -  |
| 合计       | 167,617.26                                | -97,301.56                                     |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|----------|---|--|
| 审计费用     | 100,000.00                                | 80,000.00                                      |
| 信息披露费    | 120,000.00                                | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金  | -   | -  |
| 银行汇划费用   | 19,700.32                                 | 4,492.45                                       |
| 银行间账户维护费 | 37,200.00                                 | 37,200.00                                      |
| 其他       | 6,000.00                                  | -  |
| 合计       | 282,900.32                                | 241,692.45                                     |

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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             |
|----------------------|---------------------|
| 安信基金管理有限责任公司（“安信基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”) | 基金托管人           |
| 国投证券股份有限公司(“国投证券”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 五矿资本控股有限公司             | 基金管理人的股东        |
| 中广核财务有限责任公司            | 基金管理人的股东        |
| 佛山市顺德区新碧贸易有限公司         | 基金管理人的股东        |
| 安信乾盛财富管理(深圳)有限公司       | 基金管理人的子公司       |

注：(1) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 2023 年 12 月 8 日，安信证券股份有限公司名称变更为“国投证券股份有限公司”。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 7,527,643.04                           | 1,538,231.10                                |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 183,204.43                             | 40.15                                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 7,344,438.61                           | 1,538,190.95                                |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,509,214.34                     | 512,743.72                       |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

本基金于本期及上年度可比期间无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。

##### 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

本基金于本期及上年度可比期间无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。

#### 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

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末              |                              | 上年度末             |                              |
|-------|------------------|------------------------------|------------------|------------------------------|
|       | 2023 年 12 月 31 日 |                              | 2022 年 12 月 31 日 |                              |
|       | 持有的<br>基金份额      | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 (%) | 持有的<br>基金份额      | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) |

|      |                |       |                |       |
|------|----------------|-------|----------------|-------|
| 浦发银行 | 799,818,108.53 | 10.00 | 499,999,000.00 | 50.00 |
|------|----------------|-------|----------------|-------|

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 |            | 上年度可比期间<br>2022年1月1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    |
| 浦发银行  | 1,131,752.79                    | 131,012.07 | 2,583,020.52                     | 11,802.35 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日     | 除息日           | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投<br>资形<br>式<br>发<br>放<br>总<br>额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|---------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------|---------------|----|
|    |               | 场外            |                       |               |                                   |               |    |
| 1  | 2023年6<br>月1日 | 2023年6<br>月1日 | 0.2120                | 21,201,940.09 | -                                 | 21,201,940.09 | -  |
| 合计 | -             | -             | 0.2120                | 21,201,940.09 | -                                 | 21,201,940.09 | -  |

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

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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 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，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 3,150,793,709.45 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（张）      | 期末估值总额           |
|---------|-----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 160213  | 16 国开 13  | 2024 年 1 月 2 日 | 102.48 | 10,213,000 | 1,046,628,654.29 |
| 160310  | 16 进出 10  | 2024 年 1 月 2 日 | 102.75 | 6,370,000  | 654,529,193.85   |
| 210208  | 21 国开 08  | 2024 年 1 月 2 日 | 101.77 | 11,581,000 | 1,178,574,053.62 |
| 2303039 | 23 进出 039 | 2024 年 1 月 2 日 | 100.04 | 1,859,000  | 185,965,759.00   |
| 160213  | 16 国开 13  | 2024 年 1 月 3 日 | 102.48 | 3,158,000  | 323,631,968.11   |
| 合计      |           |                |        | 33,181,000 | 3,389,329,628.87 |

#### 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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,907,262,233.09 元，于 2024 年 1 月 2 日、2024 年 1 月 4 日、2024 年 1 月 5 日、2024 年 1 月 9 日、2024 年 1 月 12 日、2024 年 1 月 19 日、2024 年 1 月 26 日、2024 年 2 月 19 日、2024 年 3 月 28 日、2024 年 3 月 29 日、2024 年 4 月 22 日、2024 年 4 月 23 日、2024 年 4 月 24 日、2024 年 5 月 1 日、2024 年 5 月 3 日、2024 年 5 月 8 日、2024 年 5 月 9 日、2024 年 5 月 15 日、2024 年 5 月 23 日、2024 年 5 月 24 日、2024 年 6 月 3 日、2024 年 6 月 4 日、2024 年 6 月 6 日、2024 年 6 月 10 日、2024 年 6 月 24 日、2024 年 6 月 25 日、2024 年 6 月 26 日、2024 年 6 月 27 日、2024 年 6 月 28 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无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

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和

协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制再限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浦发银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金对于债券减值阶段划分的依据是债券信用风险水平是否发生显著变化。根据债券市场历史违约情况、境内外信用债市场等级划分和分布情况及债券市场定价信息，将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级不低于初始确认日的隐含评级或高于 AA-等级，则处于第一阶段；若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级低于初始确认日的隐含评级且不高于 AA-等级，则处于第二阶段；若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级处于 C 等级或发生违约，则处于第三阶段。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 45.26%(2022 年 12 月 31 日：92.81%)。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 3,668,022,796.50        | 936,909,065.87           |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 10,402,084,794.73       | 533,337,090.40           |
| 合计     | 14,070,107,591.23       | 1,470,246,156.27         |

注：1. 于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的按长期信用评级列示的债券投资均处于减值第一阶段。

2. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

3. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在六个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 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                    | 1,131,752.79  | -                 | -     | -          | 1,131,752.79      |
| 结算备付金                   | 92,832,884.34 | -                 | -     | -          | 92,832,884.34     |
| 存出保证金                   | 821.52        | -                 | -     | -          | 821.52            |
| 债权投资                    | -             | 14,070,107,591.23 | -     | -          | 14,070,107,591.23 |
| 应收清算款                   | -             | -                 | -     | 421,380.57 | 421,380.57        |



|                          |                   |                   |       |               |                   |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------|---------------|-------------------|
| 资产总计                     | 93,965,458.65     | 14,070,107,591.23 | -     | 421,380.57    | 14,164,494,430.45 |
| 负债                       |                   |                   |       |               |                   |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                 | -     | 1,031,498.32  | 1,031,498.32      |
| 应付托管费                    | -                 | -                 | -     | 343,832.77    | 343,832.77        |
| 卖出回购金融资产款                | 6,058,055,942.54  | -                 | -     | -             | 6,058,055,942.54  |
| 其他负债                     | -                 | -                 | -     | 428,034.96    | 428,034.96        |
| 负债总计                     | 6,058,055,942.54  | -                 | -     | 1,803,366.05  | 6,059,859,308.59  |
| 利率敏感度缺口                  | -5,964,090,483.89 | 14,070,107,591.23 | -     | -1,381,985.48 | 8,104,635,121.86  |
| 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内             | 1-5 年             | 5 年以上 | 不计息           | 合计                |
| 资产                       |                   |                   |       |               |                   |
| 货币资金                     | 2,583,020.52      | -                 | -     | -             | 2,583,020.52      |
| 结算备付金                    | 3,843,254.39      | -                 | -     | -             | 3,843,254.39      |
| 债权投资                     | 1,470,246,156.27  | -                 | -     | -             | 1,470,246,156.27  |
| 资产总计                     | 1,476,672,431.18  | -                 | -     | -             | 1,476,672,431.18  |
| 负债                       |                   |                   |       |               |                   |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                 | -     | 128,555.07    | 128,555.07        |
| 应付托管费                    | -                 | -                 | -     | 42,851.70     | 42,851.70         |
| 应付清算款                    | -                 | -                 | -     | 146,640.95    | 146,640.95        |
| 卖出回购金融资产款                | 466,626,390.64    | -                 | -     | -             | 466,626,390.64    |
| 其他负债                     | -                 | -                 | -     | 230,257.04    | 230,257.04        |
| 负债总计                     | 466,626,390.64    | -                 | -     | 548,304.76    | 467,174,695.40    |
| 利率敏感度缺口                  | 1,010,046,040.54  | -                 | -     | -548,304.76   | 1,009,497,735.78  |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金持有至到期的债券投资均为固定利率类的债券品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

本报告期末，本基金持有债权投资账面价值 14,070,107,591.23(2022 年 12 月 31 日：1,470,246,156.27 元)，其公允价值人民币 14,097,611,047.16 元(2022 年 12 月 31 日：1,474,343,130.43 元)。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》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》的有关规定，本基金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；本基金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。于2023年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2022年12月31日：同)。

#### 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基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                 | -             |
|    | 其中：股票             | -                 | -             |
| 2  | 基金投资              | -                 | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 14,070,107,591.23 | 99.33         |
|    | 其中：债券             | 14,070,107,591.23 | 99.33         |
|    | 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          | -                 | -             |
|    | 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      | 93,964,637.13     | 0.66          |
| 8  | 其他各项资产            | 422,202.09        | 0.00          |
| 9  | 合计                | 14,164,494,430.45 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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

本基金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

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

### 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      | 10,402,084,794.73 | 128.35        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,402,084,794.73 | 128.35        |
| 4  | 企业债券      | -                 | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -             |
| 6  | 中期票据      | -                 | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -             |
| 8  | 同业存单      | -                 | -             |
| 9  | 地方政府债     | 3,668,022,796.50  | 45.26         |
| 10 | 其他        | -                 | -             |
| 11 | 合计        | 14,070,107,591.23 | 173.61        |

### 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  | 2303039 | 23 进出 039 | 35,400,000 | 3,541,252,215.49 | 43.69         |
| 2  | 210208  | 21 国开 08  | 27,600,000 | 2,808,794,048.86 | 34.66         |
| 3  | 160213  | 16 国开 13  | 24,500,000 | 2,510,760,993.85 | 30.98         |
| 4  | 160310  | 16 进出 10  | 15,000,000 | 1,541,277,536.53 | 19.02         |
| 5  | 231004  | 23 河南 42  | 4,600,000  | 462,063,501.76   | 5.70          |

### 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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券除 23 进出 039（代码：2303039 CY）、16 进出 10（代码：160310 CY）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1. 中国进出口银行

2023 年 5 月 9 日，中国进出口银行因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 8.11.3 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 | 821.52     |
| 2  | 应收清算款 | 421,380.57 |
| 3  | 应收股利  | -          |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息  | -          |
| 5 | 应收申购款 | -          |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 422,202.09 |

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 (%) | 持有份额      | 占总份额比<br>例 (%) |
| 328          | 24,377,570.68 | 7,995,780,529.89 | 100.00         | 62,653.38 | 0.00           |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | -          | -            |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     |                  |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2020 年 3 月 5 日) 基<br>金份额总额 | 1,000,091,528.27 |
|-------------------------------------|------------------|

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 1,000,091,528.27 |
| 本报告期基金总申购份额   | 6,995,815,844.39 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 64,189.39        |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 7,995,843,183.27 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 5 月 20 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第十六次会议审议通过，张翼飞先生自 2023 年 5 月 18 日起担任公司副总经理。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期，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

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人公募基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 100,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 东方财富证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 光大证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | 退租 |
| 华创证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 太平洋证券  | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 中信建投   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商提供服务（包括但不限于：股票推荐、提供各类研究报告、上门路演、联合调研、委托课题等其他日常服务）的数量和质量作为交易单元的选择标准，由权益投研分管领导、投资部门及研究部门相关人员、交易部对券商服务进行综合考评后提出租用及变更方案，最终由公司权益基金投资决策委员讨论及决定。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |                  | 债券回购交易           |                    | 权证交易 |                  |
|--------|------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 东方财富证券 | -    | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 光大证券   | -    | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 广发证券   | -    | -                | 9,722,073,000.00 | 12.14              | -    | -                |



|           |               |        |                   |       |   |   |
|-----------|---------------|--------|-------------------|-------|---|---|
| 华创证券      | 10,173,200.00 | 100.00 | 70,381,371,000.00 | 87.86 | - | - |
| 太平洋证<br>券 | -             | -      | -                 | -     | - | - |
| 中信建投      | -             | -      | -                 | -     | - | - |

### 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  | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告                          | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-01-19 |
| 2  | 2023 年度安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告                         | 证券时报                      | 2023-01-30 |
| 3  | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告                              | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-03-30 |
| 4  | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告                          | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-04-21 |
| 5  | 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告  | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-05-20 |
| 6  | 安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告                          | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-05-22 |
| 7  | 关于安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第一次分红的公告                        | 证券时报                      | 2023-05-31 |
| 8  | 安信基金管理有限责任公司关于安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告 | 证券时报                      | 2023-05-31 |
| 9  | 关于暂停安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入业务的公告                     | 证券时报                      | 2023-06-07 |
| 10 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 81 只基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告                     | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-07-20 |
| 11 | 安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告                                | 证券时报                      | 2023-08-18 |
| 12 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 82 只基金 2023 年中期报告提示性公告                         | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-08-29 |
| 13 | 安信基金管理有限责任公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告                 | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-09-13 |
| 14 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 84 只基金 2023 年第 3 季度报告提示                        | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-10-24 |

|    |   |                       |            |
|----|---|-----------------------|------------|
|    | 性公告   |                       |            |
| 15 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2023-12-07 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |                | 报告期末持有基金情况 |                  |          |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|----------------|------------|------------------|----------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额       | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 机构    | 1              | 20230101-20230605       | 499,999,000.00 | 299,819,108.53 | -          | 799,818,108.53   | 10.00    |
|       | 2              | 20230101-20230606       | 299,999,000.00 | 999,399,360.38 | -          | 1,299,398,360.38 | 16.25    |
|       | 3              | 20230101-20230605       | 199,999,000.00 | 99,939,036.58  | -          | 299,938,036.58   | 3.75     |

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，确认利息收入并评估减值准备。本报告中投资组合报告公允价值部分均以摊余成本列示。

2、根据财政部发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，对以摊余成本计量的金融资

产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2024 年 3 月 28 日