

安信永盛定期开放债券型发起式证券投资  
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。安永华明会计师事务所（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                         | 4         |
| 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                              | 6         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 7         |
| <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              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>13</b> |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>15</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 15        |
| 7.2 利润表                                 | 16        |
| 7.3 净资产变动表                              | 17        |
| 7.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 41        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 41        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 41        |
| 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 .....    | 41        |
| 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 ..... | 42        |
| 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 ..... | 42        |
| 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 .....    | 42        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 42        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 44        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 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>45</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 45        |
| 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 .....      | 45        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 45        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 45        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 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 .....                | 46        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 46        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>47</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 .....    | 47        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 48        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 48        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 48        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 安信永盛定开债券             |
| 基金主代码      | 005677               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2018 年 3 月 30 日      |
| 基金管理人      | 安信基金管理有限责任公司         |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 1,600,000,992.33 份   |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在控制组合净值波动率的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 封闭期内，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金会根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险，并采取信用选择策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、杠杆投资策略和资产支持证券投资策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的品种，减小基金净值波动。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数（全价）收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，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                        | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 孙晓奇                                 | 陆志俊                     |
|             | 联系电话 | 0755-82509999                       | 95559                   |
|             | 电子邮箱 | service@essencefund.com             | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话      |      | 4008-088-088                        | 95559                   |
| 传真          |      | 0755-82799292                       | 021-62701216            |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址        |      | 广东省深圳市福田区莲花街道益田                     | 中国（上海）长宁区仙霞路 18         |

|       |                      |        |
|-------|----------------------|--------|
|       | 路 6009 号新世界商务中心 36 层 | 号      |
| 邮政编码  | 518026               | 200336 |
| 法定代表人 | 刘入领                  | 任德奇    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报               |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层      |
| 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 期间数据和指标 | 2023 年           | 2022 年           | 2021 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 37,197,729.17    | 50,519,089.78    | 43,123,791.93    |
| 本期利润          | 38,283,009.14    | 40,616,020.37    | 51,695,550.53    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0239           | 0.0254           | 0.0322           |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.25%            | 2.43%            | 3.12%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.27%            | 2.47%            | 3.18%            |
| 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      | 122,706,295.34   | 84,423,287.46    | 39,057,471.29    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0767           | 0.0528           | 0.0244           |
| 期末基金资产净值      | 1,722,707,287.67 | 1,684,424,298.67 | 1,643,808,278.30 |
| 期末基金份额净值      | 1.0767           | 1.0528           | 1.0274           |
| 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   | 18.32%           | 15.69%           | 12.90%           |

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。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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      | 0.59%    | 0.02%       | 0.82%      | 0.06%         | -0.23% | -0.04% |
| 过去六个月      | 1.03%    | 0.02%       | 0.79%      | 0.06%         | 0.24%  | -0.04% |
| 过去一年       | 2.27%    | 0.02%       | 1.66%      | 0.06%         | 0.61%  | -0.04% |
| 过去三年       | 8.13%    | 0.02%       | 4.18%      | 0.08%         | 3.95%  | -0.06% |
| 过去五年       | 14.94%   | 0.03%       | 5.16%      | 0.10%         | 9.78%  | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.32%   | 0.03%       | 10.39%     | 0.10%         | 7.93%  | -0.07% |

注：根据《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

### 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

安信永盛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

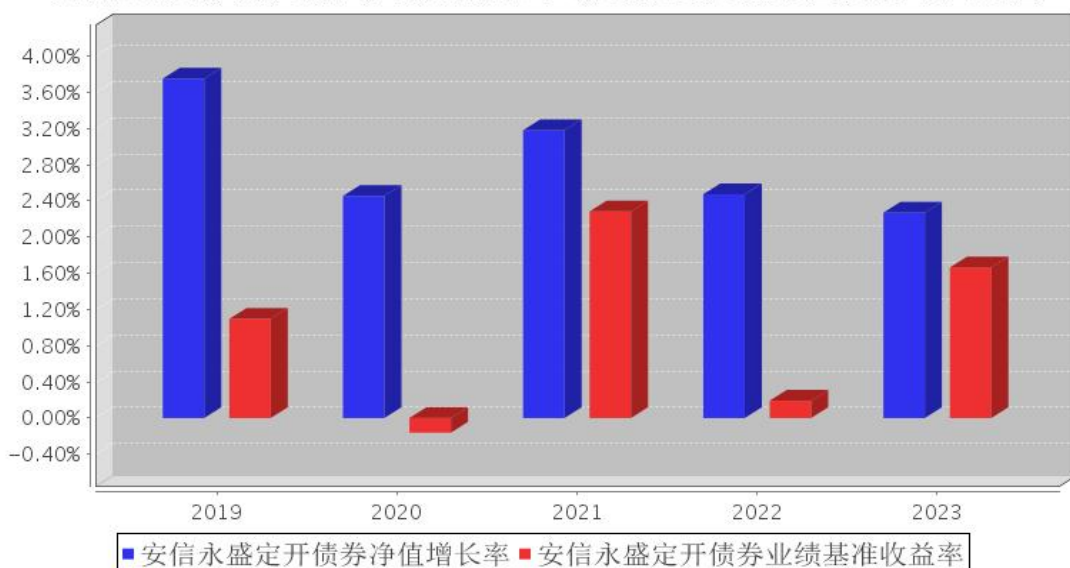


注：1、本基金合同生效日为 2018 年 3 月 30 日。

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 过去五年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

安信永盛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<br>红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总<br>额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|-------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2021 年 | 0.5000            | 79,999,968.60 | -             | 79,999,968.60 | -  |
| 合计     | 0.5000            | 79,999,968.60 | -             | 79,999,968.60 | -  |

## § 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 |        |   |
| 梁冰哲 | 本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 23 日   | -    | 7 年    | 梁冰哲先生, 理学硕士。曾任德勤华永会计师事务所审计部审计员, 安信基金管理有限责任公司固定收益研究部研究员, 现 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信新价值灵活配置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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、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遵规守信情况的说明

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

从市场表现来看，2023 年市场整体呈现出“股弱债强”的特征。全年上证指数收跌 3.7%，收于 2974 点；四季度上证指数收跌 4.36%，延续弱势行情。债券市场表现相对较好，10 年国债全年下行近 30bp，收益率由年初的 2.84% 下行至 2.55% 附近；其中四季度下行 12bp，由 2.67% 下行至 2.55% 附近。30 年国债的表现更佳，全年也下行近 30bp，最活跃的 30 年债券已经下行接近 2.84%。

2023 年组合整体以信用债持仓为主，通过持有中高评级的信用债获取收益，久期维持中性偏高。此外，组合通过三个方法获得增强：第一，组合采用信用轮动策略，捕捉不同信用主体弹性不同获取增厚；第二，组合根据不同券种的比价关系，动态选择更符合当下市场的信用债；第三，组合通过精选优质信用主体挖掘定价错误的机会，挖掘信用  $\alpha$ 。整体来看，2023 年组合的投资策略取得较好成效。

##### 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 1.0767 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观环境来看，中国仍处于“疫后复苏”的过程当中，但是由于国内疫情持续时间较长、对于实体经济的信心产生了一定的“疤痕效应”，“疤痕效应”的修复需要时间。从更具体的方面来说，首先是房地产市场，虽然目前阶段市场对于房地产的信心仍然不足，但从数据来看新房和二手房的成交数据已经有所企稳。此前投资者对于房地产的担忧主要在于地产是否存在过剩，我们认为从长期来看地产需求是持续增长的函数，即当居民收入出现提升之后，居民会将其中一部分用于改善居住环境，这一点在很多国家均适用，原因是居住环境是人最基本的需求。短期来看，虽然有部分三线、四线城市可能供给比较充裕，但我们已经看到了成交数据有企稳的迹象。其次，从工业生产视角来看，我国制造业相对于其他国家的竞争优势仍然明显，我们认为我国高质量产品仍将为出口提供充足的动力。再次，今年财政整体定调偏积极，基建、“三大工程”相关的投资也将为国内经济起到足够的托底作用。最后，从数据上看消费仍然阶段性偏弱，但消费是一个慢变量，有一定的滞后属性。简单来说就是居民“赚钱了才会消费”，而非“消费了才有钱”。所以，在整体经济预期改善的情况下，不必过度解读消费数据一时的高低。

从海外宏观环境来看，联储目前决策的关键点已非通胀，而是就业。随着各国移民的进入、

超额储蓄的下降，我们认为联储就业市场紧张的情况已经有所改善。今年联储降息是基准假设，美元指数有走弱的可能性，而美元指数的走弱也将为我国货币政策的主动性提供空间。

总体来看，我们认为我国经济正处于疫后复苏可能加速的阶段，在此阶段货币政策仍将对实体经济提供足够的支持，而权益市场目前的估值水平已经给与长期投资者比较足够的风险补偿。整体来看，我们对于中国资产的态度是积极的。

2023 年组合仍整体以中高评级信用债持仓为主，在此阶段通过多策略对收益进行增强。

#### 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

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

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，基金托管人在安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，安信基金管理有限责任公司在安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由安信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、收益表现、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   | 安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见      | 我们审计了安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我   |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。  |
| 强调事项            | 无   |
| 其他事项            | 无   |
| 其他信息            | <p>安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>而，未来的事项或情况可能导致安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 注册会计师的姓名  | 吴翠蓉   邓 雯   |
| 会计师事务所的地址 | 中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层  |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 28 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金

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    | 5,217,390.08                    | 10,574,173.35                    |
| 结算备付金         |            | -                               | -                                |
| 存出保证金         |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 1,498,066,560.27                | 1,856,756,991.75                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 1,498,066,560.27                | 1,856,756,991.75                 |
| 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    | 220,264,153.04                  | -                                |
| 应收清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 1,723,548,103.39                | 1,867,331,165.10                 |
| <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   |         | -                | 182,046,148.04   |
| 应付清算款       |         | -                | -                |
| 应付赎回款       |         | -                | -                |
| 应付管理人报酬     |         | 437,990.01       | 428,074.54       |
| 应付托管费       |         | 145,996.66       | 142,691.50       |
| 应付销售服务费     |         | -                | -                |
| 应付投资顾问费     |         | -                | -                |
| 应交税费        |         | 38,763.85        | 66,543.71        |
| 应付利润        |         | -                | -                |
| 递延所得税负债     |         | -                | -                |
| 其他负债        | 7.4.7.6 | 218,065.20       | 223,408.64       |
| 负债合计        |         | 840,815.72       | 182,906,866.43   |
| <b>净资产：</b> |         |                  |                  |
| 实收基金        | 7.4.7.7 | 1,600,000,992.33 | 1,600,001,011.21 |
| 未分配利润       | 7.4.7.8 | 122,706,295.34   | 84,423,287.46    |
| 净资产合计       |         | 1,722,707,287.67 | 1,684,424,298.67 |
| 负债和净资产总计    |         | 1,723,548,103.39 | 1,867,331,165.10 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0767 元，基金份额总额 1,600,000,992.33 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金

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<br>年 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>    |          | 45,976,260.43                             | 52,547,814.82                                  |
| 1. 利息收入           |          | 3,967,106.97                              | 118,431.25                                     |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.9  | 73,069.57                                 | 111,863.85                                     |
| 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        |          | 3,894,037.40                              | 6,567.40                                       |
| 其他利息收入            |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 40,923,873.49                             | 62,332,452.98                                  |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.10 | -   | -  |
| 基金投资收益            |          | -   | -  |

|                                 |            |               |               |
|---------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 债券投资收益                          | 7.4.7.11   | 40,923,873.49 | 62,332,452.98 |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 7.4.7.12   | -             | -             |
| 贵金属投资收益                         | 7.4.7.13   | -             | -             |
| 衍生工具收益                          | 7.4.7.14   | -             | -             |
| 股利收益                            | 7.4.7.15   | -             | -             |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产<br>生的收益   |            | -             | -             |
| 其他投资收益                          |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 7.4.7.16   | 1,085,279.97  | -9,903,069.41 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 7.4.7.17   | -             | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 7,693,251.29  | 11,931,794.45 |
| 1. 管理人报酬                        | 7.4.10.2.1 | 5,110,731.71  | 5,010,207.00  |
| 2. 托管费                          | 7.4.10.2.2 | 1,703,577.31  | 1,670,068.99  |
| 3. 销售服务费                        |            | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                        |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                         |            | 531,093.77    | 4,844,759.57  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 531,093.77    | 4,844,759.57  |
| 6. 信用减值损失                       | 7.4.7.18   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                        |            | 96,216.27     | 153,462.08    |
| 8. 其他费用                         | 7.4.7.19   | 251,632.23    | 253,296.81    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | 38,283,009.14 | 40,616,020.37 |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | 38,283,009.14 | 40,616,020.37 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 38,283,009.14 | 40,616,020.37 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金

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                                | 1,600,001,011.21                 | -      | 84,423,287.46  | 1,684,424,298.67 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,600,001,011.21                 | -      | 84,423,287.46  | 1,684,424,298.67 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -18.88                           | -      | 38,283,007.88  | 38,282,989.00    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | 38,283,009.14  | 38,283,009.14    |
| (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)      | -18.88                           | -      | -1.26          | -20.14           |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                | -      | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                                 | -18.88                           | -      | -1.26          | -20.14           |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 1,600,000,992.33                 | -      | 122,706,295.34 | 1,722,707,287.67 |
| 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                                | 1,600,001,011.21                 | -      | 43,807,267.09  | 1,643,808,278.30 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,600,001,011.21                 | -      | 43,807,267.09  | 1,643,808,278.30 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                | -      | 40,616,020.37  | 40,616,020.37    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | 40,616,020.37  | 40,616,020.37    |
| (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） | -                | - | -             | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 1,600,001,011.21 | - | 84,423,287.46 | 1,684,424,298.67 |

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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>刘入领</u> | <u>廖维坤</u> | <u>苗杨</u> |
| 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

安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金（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”）2017 年 8 月 18 日下发的证监许可[2017]1524 文“关于准予安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，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《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，以定期开放方式运作，存续期限不定。本基金募集期间为 2018 年 2 月 14 日至 2018 年 3 月 27 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2018)验字 60962175\_H06 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,609,999,000.00 份，其中认购资金利息折合 0 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，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信永盛定期开放债券型发起式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，包括国债、金融债、央行票据、企业债券、公司债券、债券回购、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、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他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资于股票、权证，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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金在开放期、封闭期前 10 个工作日以及封闭期最后 10 个工作日不受上述投资比例限制。在开放期，本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；封闭期内不受上述 5% 的限制。

本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

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

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

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

实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基



金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。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。

（2）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投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基

金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。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

本基金本报告期无分部报告。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### (1) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### (2) 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (3) 个人所得税

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款   | 5,217,390.08            | 10,574,173.35            |
| 等于：本金  | 5,216,367.75            | 10,571,840.96            |
| 加：应计利息 | 1,022.33                | 2,332.39                 |
| 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             | 5,217,390.08 | 10,574,173.35 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>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                    | -                | -                | -                |               |
|               | 银行间市场                    | 1,483,168,390.06 | 18,972,560.27    | 1,498,066,560.27 | -4,074,390.06 |
|               | 合计                       | 1,483,168,390.06 | 18,972,560.27    | 1,498,066,560.27 | -4,074,390.06 |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                | -                |               |
| 基金            | -                        | -                | -                | -                |               |
| 其他            | -                        | -                | -                | -                |               |
| 合计            | 1,483,168,390.06         | 18,972,560.27    | 1,498,066,560.27 | -4,074,390.06    |               |
| 项目            | 上年度末<br>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                    | -                | -                | -                |               |
|               | 银行间市场                    | 1,835,123,670.03 | 26,792,991.75    | 1,856,756,991.75 | -5,159,670.03 |
|               | 合计                       | 1,835,123,670.03 | 26,792,991.75    | 1,856,756,991.75 | -5,159,670.03 |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                | -                |               |
| 基金            | -                        | -                | -                | -                |               |

|    |                  |               |                  |               |
|----|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 其他 | -                | -             | -                | -             |
| 合计 | 1,835,123,670.03 | 26,792,991.75 | 1,856,756,991.75 | -5,159,670.03 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | 220,264,153.04           | -         |
| 合计    | 220,264,153.04           | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |

##### 7.4.7.4.2 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 其他资产

本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.6 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      | 8,765.20                | 14,108.64                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 8,765.20                | 14,108.64                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 应付信息披露费     | 120,000.00              | 120,000.00               |
| 应付审计费       | 80,000.00               | 80,000.00                |
| 应付银行间账户维护费  | 9,300.00                | 9,300.00                 |
| 合计          | 218,065.20              | 223,408.64               |

#### 7.4.7.7 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          | 1,600,001,011.21            | 1,600,001,011.21 |
| 本期申购          | -                           | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -18.88                      | -18.88           |
| 本期末           | 1,600,000,992.33            | 1,600,000,992.33 |

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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           | 89,576,561.07  | -5,153,273.61 | 84,423,287.46  |
| 本期期初           | 89,576,561.07  | -5,153,273.61 | 84,423,287.46  |
| 本期利润           | 37,197,729.17  | 1,085,279.97  | 38,283,009.14  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1.26          | -             | -1.26          |
| 其中：基金申购款       | -              | -             | -              |
| 基金赎回款          | -1.26          | -             | -1.26          |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 126,774,288.98 | -4,067,993.64 | 122,706,295.34 |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

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 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                    | 73,069.57                        |
| 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 | -                           | -                                |
| 其他        | -                           | -                                |
| 合计        | 73,069.57                   | 111,863.85                       |

#### 7.4.7.10 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。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 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 |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 49,711,348.38         | 63,227,940.77         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,787,474.89         | -895,487.79           |
| 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                           | 40,923,873.49         | 62,332,452.98         |

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<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 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,084,465,837.16            | 1,256,466,087.67                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,056,854,034.89            | 1,229,320,467.59                 |
| 减：应计利息总额               | 36,389,027.16               | 28,034,932.87                    |
| 减：交易费用                 | 10,250.00                   | 6,175.00                         |
| 买卖债券差价收入               | -8,787,474.89               | -895,487.79                      |

#### 7.4.7.12 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。

#### 7.4.7.13 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。

#### 7.4.7.14 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。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金于本期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------|----|---------|
|------|----|---------|

|                            | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 1,085,279.97                        | -9,903,069.41                       |
| 股票投资                       | -                                   | -                                   |
| 债券投资                       | 1,085,279.97                        | -9,903,069.41                       |
| 资产支持证券投资                   | -                                   | -                                   |
| 基金投资                       | -                                   | -                                   |
| 贵金属投资                      | -                                   | -                                   |
| 其他                         | -                                   | -                                   |
| 2. 衍生工具                    | -                                   | -                                   |
| 权证投资                       | -                                   | -                                   |
| 3. 其他                      | -                                   | -                                   |
| 减：应税金融商品公允价值<br>变动产生的预估增值税 | -                                   | -                                   |
| 合计                         | 1,085,279.97                        | -9,903,069.41                       |

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金于本期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|          | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12<br>月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
| 审计费用     | 80,000.00                           | 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   | 14,382.23                           | 16,416.81                           |
| 银行间账户维护费 | 37,200.00                           | 36,880.00                           |
| 其他       | 50.00                               | -                                   |
| 合计       | 251,632.23                          | 253,296.81                          |

#### 7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。



#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 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 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）   | 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            |
| 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                               | 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管理费   | 5,110,731.71                     | 5,010,207.00                     |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 3.65                             | 3.65                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 5,110,728.06                     | 5,010,203.35                     |

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基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 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 | 1,703,577.31                     | 1,670,068.99                     |

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基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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均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均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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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 (%) |
|------|------------------|------------------------------|------------------|------------------------------|
| 交通银行 | 1,599,999,000.00 | 100.00                       | 1,599,999,000.00 | 100.00                       |

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     |
| 交通银行  | 5,217,390.08                    | 73,069.57 | 10,574,173.35                    | 111,863.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

本基金于本期未进行利润分配。

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

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

本基金本报告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，本基金无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，无抵押债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无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，无抵押债券。

#### 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在限定的范围之内，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

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金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。

本基金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，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 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 68.05%（2022 年 12 月 31 日：74.07%）。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 264,748,468.00          | 101,048,054.79           |
| 合计     | 264,748,468.00          | 101,048,054.79           |

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 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。

#### 7.4.13.2.2 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | 99,396,986.30            |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | -                        |
| 合计     | -                       | 99,396,986.30            |

- 注：1. 同业存单评级取自第三方评级机构的主体评级。
2. 短期信用评级 A-1 所填列的同业存单均为 AAA 级的同业存单。
3. 短期信用评级 A-1 以下所填列的同业存单均为 AAA 级以下的同业存单。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 603,998,160.66          | 895,402,854.77           |
| AAA 以下 | 51,746,393.44           | 50,472,808.22            |
| 未评级    | 577,573,538.17          | 710,436,287.67           |
| 合计     | 1,233,318,092.27        | 1,656,311,950.66         |

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金

类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。货币资金、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，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<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                     | 5,217,390.08     | -              | -               | -           | 5,217,390.08     |
| 交易性金融资产                  | 1,240,766,379.95 | -              | -257,300,180.32 | -           | 1,498,066,560.27 |
| 买入返售金融资产                 | 220,264,153.04   | -              | -               | -           | 220,264,153.04   |
| 资产总计                     | 1,466,247,923.07 | -              | -257,300,180.32 | -           | 1,723,548,103.39 |
| 负债                       |                  |                |                 |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -               | 437,990.01  | 437,990.01       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -               | 145,996.66  | 145,996.66       |
| 应交税费                     | -                | -              | -               | 38,763.85   | 38,763.85        |
| 其他负债                     | -                | -              | -               | 218,065.20  | 218,065.20       |
| 负债总计                     | -                | -              | -               | 840,815.72  | 840,815.72       |
| 利率敏感度缺口                  | 1,466,247,923.07 | -              | -257,300,180.32 | -840,815.72 | 1,722,707,287.67 |
| 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                     | 10,574,173.35    | -              | -               | -           | 10,574,173.35    |
| 交易性金融资产                  | 907,890,189.02   | 691,126,142.46 | 257,740,660.27  | -           | 1,856,756,991.75 |
| 资产总计                     | 918,464,362.37   | 691,126,142.46 | 257,740,660.27  | -           | 1,867,331,165.10 |
| 负债                       |                  |                |                 |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -               | 428,074.54  | 428,074.54       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -               | 142,691.50  | 142,691.50       |
| 卖出回购金融资产款                | 182,046,148.04   | -              | -               | -           | 182,046,148.04   |
| 应交税费                     | -                | -              | -               | 66,543.71   | 66,543.71        |
| 其他负债                     | -                | -              | -               | 223,408.64  | 223,408.64       |
| 负债总计                     | 182,046,148.04   | -              | -               | 860,718.39  | 182,906,866.43   |
| 利率敏感度缺口                  | 736,418,214.33   | 691,126,142.46 | 257,740,660.27  | -860,718.39 | 1,684,424,298.67 |

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

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 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） |
|    | 1. 市场利率下降          | 1,955,251.07                | 4,469,876.17           |

|  |                     |               |               |
|--|---------------------|---------------|---------------|
|  | 25 个基点              |               |               |
|  | 2. 市场利率上升<br>25 个基点 | -1,948,429.54 | -4,444,740.83 |

#### 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。本基金主要投资于交易所市场和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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 1,498,066,560.27        | 1,856,756,991.75         |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 1,498,066,560.27        | 1,856,756,991.75         |



#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,498,066,560.27 | 86.92         |
|    | 其中：债券             | 1,498,066,560.27 | 86.92         |
|    | 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          | 220,264,153.04   | 12.78         |
|    | 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      | 5,217,390.08     | 0.30          |
| 8  | 其他各项资产            | -                | -             |
| 9  | 合计                | 1,723,548,103.39 | 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      | 878,633,784.32   | 51.00         |
|    | 其中：政策性金融债 | 325,772,263.01   | 18.91         |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 60,581,180.33    | 3.52          |
| 6  | 中期票据      | 558,851,595.62   | 32.44         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,498,066,560.27 | 86.96         |

## 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  | 230401   | 23 农发 01 | 2,000,000 | 204,167,287.67 | 11.85         |
| 2  | 10210186 | 21 苏交通   | 1,500,000 | 151,664,918.03 | 8.80          |

|   |         |              |           |                |      |
|---|---------|--------------|-----------|----------------|------|
|   | 5       | MTN007       |           |                |      |
| 3 | 2128012 | 21 浦发银行 01   | 1,000,000 | 102,945,049.18 | 5.98 |
| 4 | 1928028 | 19 中国银行二级 01 | 1,000,000 | 102,011,245.90 | 5.92 |
| 5 | 2120071 | 21 上海银行      | 1,000,000 | 101,467,475.41 | 5.89 |

### 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 19 中国银行二级 01（代码：1928028 CY）、21 上海银行（代码：2120071 CY）、23 广发证券 CP006（代码：072310156 CY）、19 农业银行二级 04（代码：1928009 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. 中国银行股份有限公司

2023 年 2 月 17 日，中国银行股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2023 年 12 月 1 日，中国银行股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行警告、罚款、没收违法所得。

## 2. 上海银行股份有限公司

2023 年 4 月 21 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得。

2023 年 11 月 17 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款、责令改正。

2023 年 11 月 27 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局上海市分局罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 29 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局上海监管局罚款。

## 3. 广发证券股份有限公司

2023 年 4 月 18 日，广发证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2023 年 7 月 18 日，广发证券股份有限公司因违规经营, 提供虚假资料证明文件被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2023 年 8 月 19 日，广发证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局广州市天河区税务局天河南税务所责令改正。

2023 年 8 月 28 日，广发证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局广州市天河区税务局天河南税务所责令改正。

2023 年 8 月 31 日，广发证券股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行广东省分行罚款。

2023 年 9 月 11 日，广发证券股份有限公司因违规经营、提供虚假资料证明文件被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2023 年 9 月 27 日，广发证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局广州市天河区税务局天河南税务所责令改正。

2023 年 12 月 27 日，广发证券股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市税务局第三税务分局采取行政监管措施。

## 4. 中国农业银行股份有限公司

2023 年 8 月 18 日，中国农业银行股份有限公司因内部制度不完善、违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

2023 年 11 月 17 日，中国农业银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 1 日，中国农业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

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

本基金本报告期末无其他资产。

### 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 (%) |
| 202          | 7,920,796.99  | 1,600,000,992.33 | 100.00         | 0.00  | 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                  |

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018年3月30日）基金份额总额 | 1,609,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,600,001,011.21 |
| 本报告期基金总申购份额               | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 18.88            |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 1,600,000,992.33 |

### § 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

本报告期内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安永华明会计师事务所（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 80,000.00 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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 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 (%) |    |
| 国投证券 | 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 (%) |
| 国投证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

## 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、证券时报、上海证券报 | 2023-01-19 |
| 2  | 安信基金管理有限责任公司关于旗下                       | 中国证券报、证券日报、           | 2023-03-30 |

|    |  |                           |            |
|----|--|---------------------------|------------|
|    | 基金 2022 年年度报告提示性公告   | 证券时报、上海证券报                |            |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 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 |
| 6  | 安信基金管理有限责任公司关于安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告 | 上海证券报                     | 2023-07-05 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 84 只基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告                  | 中国证券报、证券日报、<br>证券时报、上海证券报 | 2023-10-24 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |          |
|--|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 机构   | 1              | 20230101-20231231       | 1,599,999,000.00 | -    | -    | 1,599,999,000.00 | 100.00   |
| 产品特有风险   |                |                         |                  |      |      |                  |          |
| <p>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：</p> <p>(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；</p> |                |                         |                  |      |      |                  |          |



(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

无。

## § 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永盛定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件;
- 2、《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、《安信永盛定期开放债券型发起式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

本基金管理人及基金托管人的住所。

### 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