

富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

二〇二二年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---|---------------------|
| 基金简称 | 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 | |
| 基金主代码 | 011999 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式。每开放日开放申购，每份基金份额设定 90 天滚动运作期。 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 04 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,577,811,019.29 份 | |
| 投资目标 | 本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金采取稳健灵活的投资策略，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值，力求提高基金总体收益率。在资产配置方面，本基金在最大限度地降低投资组合的风险前提下，提高投资组合的收益。在债券投资方面，本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略。本基金的动态收益增强策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略详见法律文件。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1 年以下）指数收益率*90%+银行一年期定期存款利率（税后）*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A | 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011999 | 012000 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 104,254,217.94 份 | 1,473,556,801.35 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022年7月1日-2022年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
| | 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A | 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 512,063.20 | 9,890,568.60 |
| 2. 本期利润 | 525,023.27 | 11,253,939.04 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0073 | 0.0074 |
| 4. 期末基金资产净值 | 109,013,490.13 | 1,536,092,247.36 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0457 | 1.0424 |

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 0.76% | 0.02% | 0.53% | 0.01% | 0.23% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.67% | 0.02% | 1.22% | 0.01% | 0.45% | 0.01% |
| 过去一年 | 3.33% | 0.02% | 2.46% | 0.01% | 0.87% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.57% | 0.02% | 3.66% | 0.01% | 0.91% | 0.01% |

(2) 富国安泰 90 天滚动持有短债债券 C

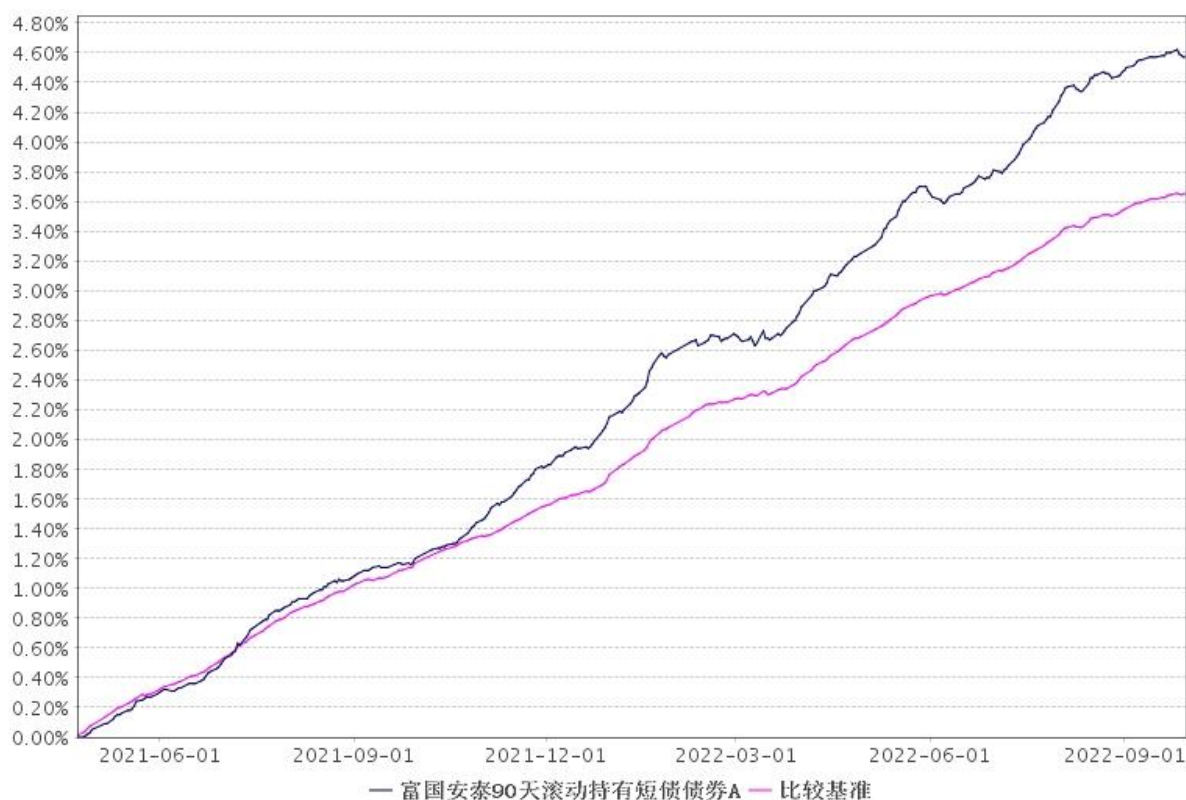
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.71% | 0.02% | 0.53% | 0.01% | 0.18% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.56% | 0.02% | 1.22% | 0.01% | 0.34% | 0.01% |
| 过去一年 | 3.12% | 0.02% | 2.46% | 0.01% | 0.66% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 4.24% | 0.02% | 3.66% | 0.01% | 0.58% | 0.01% |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较

基准收益率变动的比较

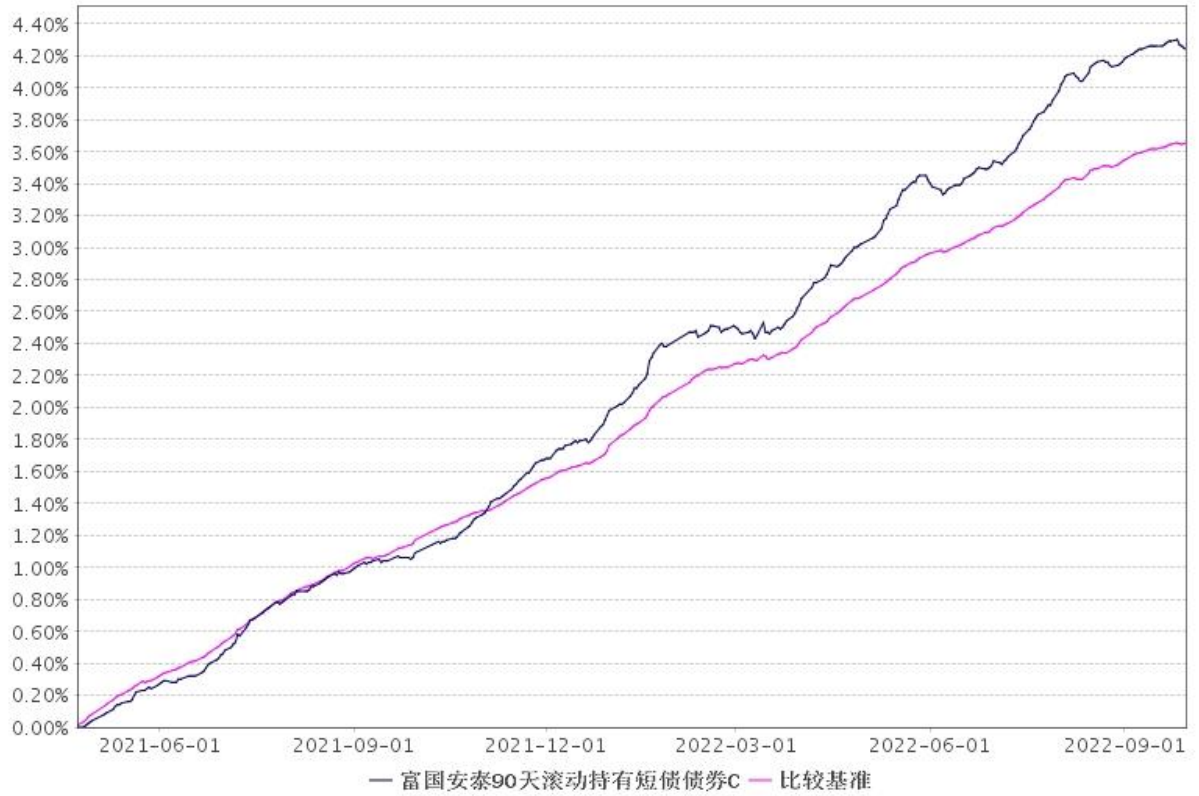
(1) 自基金合同生效以来富国安泰 90 天滚动持有短债债券 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2022 年 9 月 30 日。

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

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



注：1、截止日期为2022年9月30日。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|-----|-----------|-------------|------|----------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴旅忠 | 本基金现任基金经理 | 2021-04-23 | — | 14 | <p>硕士，曾任国泰君安证券投资经理，中银基金管理有限公司基金经理；自 2018 年 10 月加入富国基金管理有限公司，自 2019 年 1 月起历任固定收益基金经理、固定收益策略研究部固定收益投资总监助理、固定收益策略研究部固定收益投资副总监；现任富国基金固定收益策略研究部副总经理，兼任富国基金固定收益基金经理。</p> <p>自 2019 年 02 月起任富国安益货币市场基金(原富国收益宝货币市场基金)基金经理；自 2019 年 02 月起任富国富钱包货币市场基金基金经理；自 2019 年 02 月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；自 2019 年 02 月起任富国天时货币市场基金基金经理；自 2019 年 04 月起任富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；自 2020 年</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 12月起任富国中债0-2年国开行债券指数证券投资基金基金经理；自2021年04月起任富国安泰90天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理；自2021年11月起任富国安福30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及

授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年3季度，国内宏观经济呈弱复苏态势：基建向好，工业触底反弹，疫情对消费抑制持续，地产政策有所松动，但地产投资仍处低位。美国加息带动10Y美国债收益率上行至3.97%；美元强势下，人民币经历一波贬值。国内政策仍坚持“以我为主”的稳健货币政策基调。7-8月份隔夜加权逐级下行，最低至1.1%，8月中旬央行顺势下调公开市场操作利率，带动一波收益率下行，1年期AAA信用债最低降至2.05%。9月份受宽信用推进，缴税及季末等因素综合影响，银行间资金价格波动加大，中枢水平相对7-8月份，有明显抬升。资金面带动短端资产收益率上行，1年期AAA信用债上行至2.15%，较季内低点抬升约10bp。整体

而言，在银行间流动性合理充裕条件下，短端资产收益率整体处低位小幅波动。

报告期内，本基金秉承稳健投资原则谨慎操作，根据市场情况灵活调整组合资产分布、杠杆比率和剩余期限，严控组合流动性风险、利率风险和信用风险，3季度组合整体运行状况良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 0.76%，C 级为 0.71%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.53%，C 级为 0.53%

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | — | — |
| | 其中：股票 | — | — |
| 2 | 固定收益投资 | 1,869,079,963.45 | 99.65 |
| | 其中：债券 | 1,869,079,963.45 | 99.65 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,339,905.89 | 0.23 |
| 7 | 其他资产 | 2,146,693.15 | 0.11 |
| 8 | 合计 | 1,875,566,562.49 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 479,452,848.78 | 29.14 |
| | 其中：政策性金融债 | 142,580,194.52 | 8.67 |
| 4 | 企业债券 | 10,130,814.25 | 0.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | 912,954,331.83 | 55.50 |
| 6 | 中期票据 | 462,557,179.15 | 28.12 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7 | 可转债（可交换债） | — | — |
| 8 | 同业存单 | 3,984,789.44 | 0.24 |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 1,869,079,963.45 | 113.61 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 210312 | 21 进出 12 | 700,000 | 71,577,838.36 | 4.35 |
| 2 | 185037 | 21 中泰 S2 | 700,000 | 71,331,457.53 | 4.34 |
| 3 | 072210112 | 22 银河证券 CP009 | 700,000 | 70,479,452.05 | 4.28 |
| 4 | 072210010 | 22 国泰君安 CP001 | 500,000 | 50,970,986.30 | 3.10 |
| 5 | 220203 | 22 国开 03 | 500,000 | 50,830,000.00 | 3.09 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现

货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

| | | |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 7,236.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | 93,829.73 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 2,045,627.24 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 2,146,693.15 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 富国安泰 90 天滚动持有 短债债券 A | 富国安泰 90 天滚动持有短 债债券 C |
|-------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 68,956,295.20 | 1,574,139,169.66 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 70,706,019.51 | 150,441,184.15 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 35,408,096.77 | 251,023,552.46 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | — | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 104,254,217.94 | 1,473,556,801.35 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | — |
| 报告期期间买入/申购总份额 | — |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | — |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | — |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | — |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和相关基金合同的约定，基金管理人决定自 2022 年 10 月 10 日起调整本基金的发售对象。具体可参见基金管理人于 2022 年 9 月 30 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整发售对象并修改招募说明书等事项的公告》及修改后的招募说明书等法律文件。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的文件
- 2、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国安泰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司
2022 年 10 月 26 日