

富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

二〇二三年中期报告

2023年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023年08月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|     |  |    |
|-----|--|----|
| §1  | 重要提示及目录 .....                            | 2  |
| 1.1 | 重要提示 .....                               | 2  |
| 1.2 | 目录 .....                                 | 3  |
| §2  | 基金简介 .....                               | 6  |
| 2.1 | 基金基本情况 .....                             | 6  |
| 2.2 | 基金产品说明 .....                             | 6  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人.....                         | 7  |
| 2.4 | 境外投资顾问和境外资产托管人.....                      | 7  |
| 2.5 | 信息披露方式 .....                             | 7  |
| 2.6 | 其他相关资料 .....                             | 8  |
| §3  | 主要财务指标和基金净值表现 .....                      | 9  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标.....                         | 9  |
| 3.2 | 基金净值表现 .....                             | 9  |
| §4  | 管理人报告 .....                              | 11 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11 |
| 4.2 | 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....            | 12 |
| 4.3 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....             | 12 |
| 4.4 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                | 12 |
| 4.5 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....             | 13 |
| 4.6 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....               | 14 |
| 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 .....      | 15 |
| §5  | 托管人报告 .....                              | 16 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                 | 16 |
| 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 .... | 16 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....     | 16 |
| §6  | 中期财务报告（未经审计） .....                       | 17 |
| 6.1 | 资产负债表 .....                              | 17 |
| 6.2 | 利润表 .....                                | 18 |
| 6.3 | 净资产（基金净值）变动表.....                        | 19 |
| 6.4 | 报表附注 .....                               | 20 |

|      |   |    |
|------|---|----|
| §7   | 投资组合报告 .....                            | 44 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况.....                         | 44 |
| 7.2  | 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....            | 44 |
| 7.3  | 期末按行业分类的权益投资组合 .....                    | 44 |
| 7.4  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....       | 44 |
| 7.5  | 报告期内权益投资组合的重大变动.....                    | 44 |
| 7.6  | 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 45 |
| 7.7  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....    | 45 |
| 7.8  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... | 45 |
| 7.9  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 ..... | 46 |
| 7.10 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....    | 46 |
| 7.11 | 投资组合报告附注 .....                          | 46 |
| §8   | 基金份额持有人信息 .....                         | 48 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                  | 48 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....               | 48 |
| 8.3  | 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的情况 .....     | 48 |
| §9   | 开放式基金份额变动 .....                         | 49 |
| §10  | 重大事件揭示 .....                            | 50 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议.....                        | 50 |
| 10.2 | 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 .....       | 50 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 50 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                         | 50 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                   | 50 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....          | 50 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 50 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                            | 72 |
| §11  | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 73 |
| 11.1 | 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....      | 73 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息.....                     | 73 |
| §12  | 备查文件目录 .....                            | 74 |



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII） |
| 基金简称       | 富国亚洲收益债券（QDII）        |
| 基金主代码      | 008367                |
| 交易代码       | 008367                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日    | 2020年04月07日           |
| 基金管理人      | 富国基金管理有限公司            |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额 | 49,249,537.43份        |
| 基金合同存续期    | 不定期                   |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于亚洲债券市场，通过积极主动的资产管理，在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下，通过积极和深入的研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。  |
| 投资策略   | 本基金主要投资于亚洲市场债券，包括亚洲国家或地区的政府发行的债券，登记注册在亚洲国家或地区或主要业务收入/资产在亚洲国家或地区的机构、企业等发行的债券。本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。本基金将根据对全球市场经济发展的判断，以及对不同国家和地区宏观经济、财政政策、货币政策、金融市场环境和走势的分析，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。在普通债券的投资中本基金主要采用类属资产配置策略、久期控制及期限结构配置策略、利率债投资策略、信用债投资策略，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。此外本基金还将运用股票投资策略、基金投资策略、衍生品投资策略、汇率避险策略和资产支持证券投资策略等进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率×80%+人民币活期存款利率（税后）×20%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的  |

|  |  |
|--|--|
|  | 市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
|--|--|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                | 基金托管人                     |
|---------|------|--------------------------------------|---------------------------|
| 名称      |      | 富国基金管理有限公司                           | 中国银行股份有限公司                |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵瑛                                   | 许俊                        |
|         | 联系电话 | 021-20361818                         | 010-66596688              |
|         | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn               | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话  |      | 95105686、4008880688                  | 95566                     |
| 传真      |      | 021-20361616                         | 010-66594942              |
| 注册地址    |      | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 | 北京市西城区复兴门内大街1号            |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层       | 北京市西城区复兴门内大街1号            |
| 邮政编码    |      | 200120                               | 100818                    |
| 法定代表人   |      | 裴长江                                  | 葛海蛟                       |

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外投资顾问 | 境外资产托管人                                   |
|------|----|--------|---|
| 名称   | 英文 | —      | JPMorgan Chase Bank, National Association |
|      | 中文 | —      | 摩根大通银行                                    |
| 注册地址 |    | —      | —   |
| 办公地址 |    | —      | —   |
| 邮政编码 |    | —      | —   |

### 2.5 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  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn  |
| 基金中期报告备置地点          | 富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层<br>中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号 |

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                   |
|--------|------------|--|
| 注册登记机构 | 富国基金管理有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道 1196 号<br>世纪汇办公楼二座 27-30 层 |



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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 | 报告期(2023年01月01日至2023年06月30日) |
| 本期已实现收益       | 503,216.26                   |
| 本期利润          | 393,521.98                   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0097                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.93%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.37%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年06月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 2,673,417.42                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0543                       |
| 期末基金资产净值      | 51,922,954.85                |
| 期末基金份额净值      | 1.0543                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023年06月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 5.43%                        |

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。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（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.17%    | 0.33%       | 1.54%      | 0.24%         | -1.37% | 0.09%  |
| 过去三个月 | 0.66%    | 0.27%       | 4.43%      | 0.26%         | -3.77% | 0.01%  |
| 过去六个月 | 2.37%    | 0.32%       | 5.71%      | 0.34%         | -3.34% | -0.02% |
| 过去一年  | 7.48%    | 0.31%       | 7.81%      | 0.33%         | -0.33% | -0.02% |
| 过去三年  | 4.23%    | 0.34%       | -2.10%     | 0.30%         | 6.33%  | 0.04%  |

|            |       |       |       |       |       |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 5.43% | 0.33% | 1.10% | 0.29% | 4.33% | 0.04% |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2020 年 4 月 7 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 4 月 7 日起至 2020 年 10 月 6 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 304 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务        | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|-----------|-------------|------|--------|---|
|     |           | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 郭子琨 | 本基金现任基金经理 | 2022-08-15  | —    | 8      | 硕士，曾任中国工商银行股份有限公司外汇货币市场业务处交易员，中国工商银行股份有限公司香港外汇资金交易中心自营交易员，中国工商银行股份有限公司债券投资经 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 理；自 2022 年 6 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2022 年 08 月起任富国全球债券证券投资基金（QDII）（原富国全球债券证券投资基金）基金经理；自 2022 年 08 月起任富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 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亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）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》、《富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### **4.4.2 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。

### **4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2023 年上半年，境外债券市场波动剧烈，市场风格切换迅速，交易主题较为丰富。一月，市场对美联储加息放缓乃至结束的预期升温，非农就业、服务业 PMI 陆续发布都加强了市场对于美联储紧缩的预期。FOMC 会议后，市场更是完全忽略了通胀韧性，市场风险偏好也急剧上升，信用利差走窄，美元快速下跌。二月随着经济数据的超预期，市场开始反转，利率快速上升，美元也开始走强。三月初，随着硅谷银行和瑞士信贷银行的风险事件发生，市场风险偏好急剧下降，呈现美债收益率下行，信用利差展宽的走势，尤其是瑞银收购瑞信并完全减计其附属一级资本债券后，避险交易达到极致，市场利率开始大幅走低，加之美国政

府债务上限的拉扯，使得低利率的市场环境一直持续到五月中旬。但从五月下旬开始，市场风格再次切换，美国债务上限逐步达成协议，美国经济数据持续强劲，尤其是六月 FOMC 会议上美联储对今年加息的点阵图再次进行调整，预测今年还将有两次加息，年底联邦基金利率将达到 5.5%-5.75% 的区间，美债收益率持续上行，利率曲线再度扁平化，月底美国国债收益率再次突破 3.8% 的关键位置。

操作方面，整体维持了短久期策略，灵活适度开展外汇对冲，维持净值的稳健增长。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0543 元；份额累计净值为 1.0543 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 2.37%，同期业绩比较基准收益率为 5.71%。

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

预计下半年，美国衰退很难立刻出现，劳动力市场将仍旧保持扩张，通胀读数也将维持在 3%-4% 之间，战胜通胀还为时尚早。预计美国国债市场仍将维持较高的波动率，美债利率维持高位波动。预计欧洲将比美国更早进入衰退，美元指数还有上行的可能性。从操作上我们将择机降低锁汇比例，直到完全不锁汇，债券部分以中短久期和票息策略为主，力争实现可预期的稳健收益。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定

进行收益分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 3 月 9 日，2023 年 5 月 25 日至 2023 年 6 月 27 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

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



## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产            | 本期末<br>2023年06月<br>30日        | 上年度末<br>2022年12月31<br>日        |
|---------------|-------------------------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>    |                               |                                |
| 银行存款          | 972,679.87                    | 3,515,175.27                   |
| 结算备付金         | 555,289.59                    | 7,887.45                       |
| 存出保证金         | 1,163,459.34                  | —                              |
| 交易性金融资产       | 48,073,075.81                 | 42,846,805.25                  |
| 其中：股票投资       | —                             | —                              |
| 基金投资          | 30,998.68                     | 29,216.50                      |
| 债券投资          | 48,042,077.13                 | 42,817,588.75                  |
| 资产支持证券投资      | —                             | —                              |
| 贵金属投资         | —                             | —                              |
| 其他投资          | —                             | —                              |
| 衍生金融资产        | —                             | —                              |
| 买入返售金融资产      | 1,696,435.61                  | -94.22                         |
| 应收清算款         | 4,441.37                      | 3,831,289.08                   |
| 应收股利          | —                             | —                              |
| 应收申购款         | 10,938.10                     | 122,732.84                     |
| 递延所得税资产       | —                             | —                              |
| 其他资产          | —                             | —                              |
| 资产总计          | 52,476,319.69                 | 50,323,795.67                  |
| <b>负债和净资产</b> | <b>本期末</b><br>2023年06月<br>30日 | <b>上年度末</b><br>2022年12月31<br>日 |
| <b>负债：</b>    |                               |                                |
| 短期借款          | —                             | —                              |
| 交易性金融负债       | —                             | —                              |
| 衍生金融负债        | —                             | —                              |
| 卖出回购金融资产款     | —                             | —                              |
| 应付清算款         | —                             | —                              |
| 应付赎回款         | 444,635.97                    | 5,173,997.52                   |
| 应付管理人报酬       | 17,665.58                     | 34,575.51                      |
| 应付托管费         | 3,533.10                      | 8,643.87                       |
| 应付销售服务费       | —                             | —                              |
| 应付投资顾问费       | —                             | —                              |
| 应交税费          | 2,925.93                      | 4,439.83                       |

|             |               |               |
|-------------|---------------|---------------|
| 应付利润        | —             | —             |
| 递延所得税负债     | —             | —             |
| 其他负债        | 84,604.26     | 49,674.93     |
| 负债合计        | 553,364.84    | 5,271,331.66  |
| <b>净资产：</b> |               |               |
| 实收基金        | 49,249,537.43 | 43,743,960.42 |
| 其他综合收益      | —             | —             |
| 未分配利润       | 2,673,417.42  | 1,308,503.59  |
| 净资产合计       | 51,922,954.85 | 45,052,464.01 |
| 负债和净资产总计    | 52,476,319.69 | 50,323,795.67 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0543 元，基金份额总额 49,249,537.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>(2023 年 01 月 01<br>日至 2023 年 06 月<br>30 日) | 上年度可比期间<br>(2022 年 01 月 01 日<br>至 2022 年 06 月 30<br>日) |
|-----------------------|--|--|
| <b>一、营业总收入</b>        | <b>651,068.89</b>                                | <b>1,231,085.45</b>                                    |
| 1.利息收入                | 50,963.18  | 42,143.47  |
| 其中：存款利息收入             | 19,860.59  | 7,055.91   |
| 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            | 31,102.59  | 35,087.56  |
| 证券出借利息收入              | —  | —  |
| 其他利息收入                | —  | —  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 781,649.36                                       | -7,081,526.23  |
| 其中：股票投资收益             | —  | 52,609.60  |
| 基金投资收益                | —  | -1,062,412.44  |
| 债券投资收益                | 2,113,446.90                                     | -5,024,068.18  |
| 资产支持证券投资收益            | —  | —  |
| 贵金属投资收益               | —  | —  |
| 衍生工具收益                | -1,332,681.04                                    | -1,050,896.22  |
| 股利收益                  | 883.50   | 3,241.01   |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | —  | —  |
| 其他投资收益                | —  | —  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -109,694.28                                      | 6,730,501.37   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -74,491.54                                       | 1,534,985.98   |

|                            |                   |                   |
|----------------------------|-------------------|-------------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 2,642.17          | 4,980.86          |
| <b>减：二、营业总支出</b>           | <b>257,546.91</b> | <b>991,582.10</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 129,747.91        | 698,201.66        |
| 2. 托管费                     | 29,189.58         | 174,550.46        |
| 3. 销售服务费                   | —                 | —                 |
| 4. 投资顾问费                   | —                 | —                 |
| 5. 利息支出                    | 20,712.88         | —                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 20,712.88         | —                 |
| 6. 信用减值损失                  | —                 | —                 |
| 7. 税金及附加                   | 1,982.52          | 9,412.87          |
| 8. 其他费用                    | 75,914.02         | 109,417.11        |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>393,521.98</b> | <b>239,503.35</b> |
| 减：所得税费用                    | —                 | —                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>393,521.98</b> | <b>239,503.35</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       | <b>—</b>          | <b>—</b>          |
| <b>六、综合收益总额</b>            | <b>393,521.98</b> | <b>239,503.35</b> |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>(2023年01月01日至2023年06月30日) |              |               |
|--|---------------------------------|--------------|---------------|
|  | 实收基金                            | 未分配<br>利润    | 净资产<br>合计     |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 43,743,960.42                   | 1,308,503.59 | 45,052,464.01 |
| 加：会计政策变更                                 | —                               | —            | —             |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 43,743,960.42                   | 1,308,503.59 | 45,052,464.01 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 5,505,577.01                    | 1,364,913.83 | 6,870,490.84  |
| （一）、综合收益总额                               | —                               | 393,521.98   | 393,521.98    |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 5,505,577.01                    | 971,391.85   | 6,476,968.86  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 52,596,923.11                   | 2,210,025.38 | 54,806,948.49 |
| 2. 基金赎回款                                 | —                               | —            | —             |
|  | 47,091,346.10                   | 1,238,633.53 | 48,329,979.63 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | —                               | —            | —             |
| （四）、其他综合收益结转留存收                          | —                               | —            | —             |

|  |                                      |                   |                |
|--|--------------------------------------|-------------------|----------------|
| 益  |                                      |                   |                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 49,249,537.43                        | 2,673,417.42      | 51,922,954.85  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>(2022年01月01日至2022年06月30日) |                   |                |
|  | 实收基金                                 | 未分配<br>利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 211,642,861.89                       | -<br>6,453,102.52 | 205,189,759.37 |
| 加: 会计政策变更                                | -                                    | -                 | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 211,642,861.89                       | -<br>6,453,102.52 | 205,189,759.37 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -39,880,524.81                       | 3,170,062.30      | -36,710,462.51 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                    | 239,503.35        | 239,503.35     |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -39,880,524.81                       | 2,930,558.95      | -36,949,965.86 |
| 其中: 1.基金申购款                              | 11,731,282.41                        | -410,494.39       | 11,320,788.02  |
| 2.基金赎回款                                  | -51,611,807.22                       | 3,341,053.34      | -48,270,753.88 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                    | -                 | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                    | -                 | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 171,762,337.08                       | -<br>3,283,040.22 | 168,479,296.86 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国亚洲收益债券型证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2235号文《关于准予富国亚洲收益债券型证券投资基金(QDII)注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于2020年4月7日正式生效,首次设立募集规模为207,028,603.98份基金份额。本基金为契约

型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行。

本基金投资于境内境外市场。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资产品。

针对境内投资，本基金可投资于国内债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、国债期货和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的相关规定）。

本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于亚洲市场债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于境内发行的债券资产的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终，在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

“亚洲市场债券”包括亚洲国家或地区的政府发行的债券，登记注册在亚洲国家或地区或主要业务收入/资产在亚洲国家或地区的机构、企业等发行的债券。如果法律法规对上述比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率×80%+人民币活期存款利率(税后)×20%。

#### **6.4.2 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3号《半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。

#### **6.4.3 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6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>(2023年06月30日) |
|--------------|----------------------|
| 活期存款         | 972,679.87           |
| 等于：本金        | 972,540.95           |
| 加：应计利息       | 138.92               |
| 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           | 972,679.87           |

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

本基金外币存款余额构成列示如下

| 币种 | 2023年6月30日 |        |           |        |            |
|----|------------|--------|-----------|--------|------------|
|    | 外币本金       | 外币应计利息 | 外币总额      | 折算汇率   | 总额折合人民币    |
| 港币 | 89.10      | —      | 89.10     | 0.9220 | 82.15      |
| 美元 | 69,185.99  | 0.20   | 69,186.19 | 7.2258 | 499,925.57 |
| 欧元 | 296.02     | —      | 296.02    | 7.8771 | 2,331.78   |
| 合计 |            |        |           |        | 502,339.50 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末(2023年06月30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            | 10,012,288.00 | 306,090.42 | 10,319,290.42 | 912.00       |
|               | 银行间市场            | —             | —          | —             | —            |
|               | 其它场外交易市场         | 36,568,953.39 | 153,139.21 | 37,722,786.71 | 1,000,694.11 |
|               | 合计               | 46,581,241.39 | 459,229.63 | 48,042,077.13 | 1,001,606.11 |
| 资产支持证券        | —                | —             | —          | —             |              |



|    |               |            |               |            |
|----|---------------|------------|---------------|------------|
| 基金 | 33,708.67     | —          | 30,998.68     | -2,709.99  |
| 其他 | —             | —          | —             | —          |
| 合计 | 46,614,950.06 | 459,229.63 | 48,073,075.81 | 998,896.12 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目     | 本期末（2023年06月30日） |      |    |    |
|--------|------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>金额      | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                  | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | —                | —    | —  | —  |
| 货币衍生工具 | -31,304,930.00   | —    | —  | —  |
| UC2309 | -31,304,930.00   | —    | —  | —  |
| 权益衍生工具 | —                | —    | —  | —  |
| 其他衍生工具 | —                | —    | —  | —  |
| 合计     | -31,304,930.00   | —    | —  | —  |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值          | 公允价值变动      |
|------------|--------|----------|---------------|-------------|
| UC2309     | UC2309 | -44.00   | 31,830,040.00 | -525,110.00 |
| 合计         |        |          |               | -525,110.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |               | -525,110.00 |
| 净额         |        |          |               | —           |

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末（2023年06月30日） |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,696,435.61     | —         |
| 银行间市场 | —                | —         |
| 合计    | 1,696,435.61     | —         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末（2023年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                |
| 应付赎回费       | 157.04           |
| 应付证券出借违约金   | —                |
| 应付交易费用      | —                |
| 其中：交易所市场    | —                |
| 银行间市场       | —                |
| 应付利息        | —                |
| 预提信息披露费     | 40,000.00        |
| 预提审计费       | 44,447.22        |
| 合计          | 84,604.26        |

#### 6.4.7.7实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 43,743,960.42               | 43,743,960.42  |
| 本期申购          | 52,596,923.11               | 52,596,923.11  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -47,091,346.10              | -47,091,346.10 |
| 本期末           | 49,249,537.43               | 49,249,537.43  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8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      |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 本期期初           | 1,782,019.15 | -473,515.56  | 1,308,503.59 |
| 本期利润           | 503,216.26   | -109,694.28  | 393,521.98   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 391,752.22   | 579,639.63   | 971,391.85   |
| 其中：基金申购款       | 2,653,695.31 | -443,669.93  | 2,210,025.38 |
| 基金赎回款          | —            | 1,023,309.56 | —            |
|                | 2,261,943.09 |              | 1,238,633.53 |
| 本期已分配利润        | —            | —            | —            |
| 本期末            | 2,676,987.63 | -3,570.21    | 2,673,417.42 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 16,416.52                   |
| 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 | 626.92                      |
| 其他        | 2,817.15                    |
| 合计        | 19,860.59                   |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|------------------------------|-----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 643,942.50                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,469,504.40                |
| 合计                           | 2,113,446.90                |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|------------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 108,137,747.79              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 105,740,147.95              |
| 减：应计利息总额               | 928,095.44                  |
| 减：交易费用                 | —                           |
| 债券投资收益-差价收入            | 1,469,504.40                |

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目   | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|------|-----------------------------|
| 外汇期货 | -1,332,681.04               |

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|---------------|-----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | —                           |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                           |
| 基金投资产生的股利收益   | 883.50                      |
| 合计            | 883.50                      |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|------------------------|-----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 415,415.72                  |
| 股票投资                   | —                           |
| 债券投资                   | 413,633.54                  |
| 资产支持证券投资               | —                           |
| 基金投资                   | 1,782.18                    |
| 贵金属投资                  | —                           |
| 其他                     | —                           |
| 2. 衍生工具                | -525,110.00                 |
| 权证投资                   | —                           |
| 外汇期货                   | -525,110.00                 |
| 3. 其他                  | —                           |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | —                           |
| 合计                     | -109,694.28                 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,919.62                    |
| 其他      | 722.55                      |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 2,642.17 |
|----|----------|

#### 6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 审计费用    | 6,447.22                    |
| 信息披露费   | 40,000.00                   |
| 证券出借违约金 | —                           |
| 银行费用    | 7,710.80                    |
| 债券账户维护费 | 18,000.00                   |
| 其他      | 3,756.00                    |
| 合计      | 75,914.02                   |

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 富国基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（“海通证券”） | 基金管理人的股东            |
| 申万宏源证券有限公司（“申万宏源”） | 基金管理人的股东            |
| 中国银行股份有限公司         | 基金托管人、基金代销机构        |
| 摩根大通银行             | 基金境外托管行             |
| 海通国际证券有限公司         | 基金管理人的股东控制的子公司      |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |                 | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日） |                 |
|--|-----------------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------|
|  | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| Haitong International Securities Company Limited | 15,930,336.11               | 7.61            | 12,616,664.90                    | 3.99            |
| JPMorgan Chase Bank, N.A.                        | —                           | —               | 19,607,413.36                    | 6.20            |

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |                 | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日） |                 |
|-------|-----------------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                        | 占当期回购成交总额的比例（%） | 成交金额                             | 占当期回购成交总额的比例（%） |
| 海通证券  | 2,080,000.00                | 2.00            | 23,300,000.00                    | 8.03            |

###### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期（2023年01月01日至<br>2023年06月30日） | 上年度可比期间（2022年01月<br>01日至2022年06月30日） |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 129,747.91                      | 698,201.66                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,259.23                        | 115,417.42                           |

注：2023年3月27日前，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。自2023年3月27日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期（2023年01月01<br>日至2023年06月30<br>日） | 上年度可比期间（2022年01<br>月01日至2022年06月30<br>日） |
|----------------|-------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 29,189.58                           | 174,550.46                               |

注：2023年3月27日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。自2023年3月27日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

| 项目                          | 份额单位：份                      |                                  |
|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
|                             | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日） |
| 基金合同生效日（2020年04月07日）持有的基金份额 | —                           | —                                |
| 期初持有的基金份额                   | —                           | —                                |
| 期间申购/买入总份额                  | 9,446,386.40                | —                                |
| 期间因拆分变动份额                   | —                           | —                                |
| 减：期间赎回/卖出总份额                | —                           | —                                |
| 期末持有的基金份额                   | 9,446,386.40                | —                                |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例           | 19.18%                      | —                                |

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。



#### 6.4.10.5.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期（2023年01月01日至2023年06月30日） |           | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日） |          |
|------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|----------|
|            | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入   |
| 摩根大通银行     | 421,562.25                  | 12,978.28 | 27,760,385.17                    | —        |
| 中国银行股份有限公司 | 551,117.62                  | 3,438.24  | 948,921.73                       | 5,195.52 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正

回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的 10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开

放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过合同及法规规定。本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资等。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

| 本期末（2023年06月30日）  | 1个月以内        | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年          | 5年以上 | 不计息          | 合计            |
|-------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|------|--------------|---------------|
| 资产                |              |               |               |               |      |              |               |
| 银行存款              | 972,679.87   | —             | —             | —             | —    | —            | 972,679.87    |
| 结算备付金             | 555,289.59   | —             | —             | —             | —    | —            | 555,289.59    |
| 存出保证金             | 1,859.34     | —             | —             | —             | —    | 1,161,600.00 | 1,163,459.34  |
| 交易性金融资产           | 3,652,150.55 | 15,157,167.81 | 17,154,050.43 | 12,078,708.34 | —    | 30,998.68    | 48,073,075.81 |
| 买入返售金融资产          | 1,696,435.61 | —             | —             | —             | —    | —            | 1,696,435.61  |
| 应收清算款             | —            | —             | —             | —             | —    | 4,441.37     | 4,441.37      |
| 应收申购款             | —            | —             | —             | —             | —    | 10,938.10    | 10,938.10     |
| 资产总计              | 6,878,414.96 | 15,157,167.81 | 17,154,050.43 | 12,078,708.34 | —    | 1,207,978.15 | 52,476,319.69 |
| 负债                |              |               |               |               |      |              |               |
| 应付赎回款             | —            | —             | —             | —             | —    | 444,635.97   | 444,635.97    |
| 应付管理人报酬           | —            | —             | —             | —             | —    | 17,665.58    | 17,665.58     |
| 应付托管费             | —            | —             | —             | —             | —    | 3,533.10     | 3,533.10      |
| 应交税费              | —            | —             | —             | —             | —    | 2,925.93     | 2,925.93      |
| 其他负债              | —            | —             | —             | —             | —    | 84,604.26    | 84,604.26     |
| 负债总计              | —            | —             | —             | —             | —    | 553,364.84   | 553,364.84    |
| 利率敏感度缺口           | 6,878,414.96 | 15,157,167.81 | 17,154,050.43 | 12,078,708.34 | —    | 654,613.31   | 51,922,954.85 |
| 上年度末（2022年12月31日） | 1个月以内        | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年          | 5年以上 | 不计息          | 合计            |
| 资产                |              |               |               |               |      |              |               |
| 银行存款              | 3,515,175.27 | —             | —             | —             | —    | —            | 3,515,175.27  |

|          |              |               |              |               |              |               |               |
|----------|--------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|---------------|
| 结算备付金    | 7,887.45     | —             | —            | —             | —            | —             | 7,887.45      |
| 交易性金融资产  | —            | 12,975,482.07 | 9,502,272.57 | 11,354,698.41 | 8,985,135.70 | 29,216.50     | 42,846,805.25 |
| 买入返售金融资产 | -94.22       | —             | —            | —             | —            | —             | -94.22        |
| 应收清算款    | —            | —             | —            | —             | —            | 3,831,289.08  | 3,831,289.08  |
| 应收申购款    | 10.00        | —             | —            | —             | —            | 122,722.84    | 122,732.84    |
| 资产总计     | 3,522,978.50 | 12,975,482.07 | 9,502,272.57 | 11,354,698.41 | 8,985,135.70 | 3,983,228.42  | 50,323,795.67 |
| 负债       |              |               |              |               |              |               |               |
| 应付赎回款    | —            | —             | —            | —             | —            | 5,173,997.52  | 5,173,997.52  |
| 应付管理人报酬  | —            | —             | —            | —             | —            | 34,575.51     | 34,575.51     |
| 应付托管费    | —            | —             | —            | —             | —            | 8,643.87      | 8,643.87      |
| 应交税费     | —            | —             | —            | —             | —            | 4,439.83      | 4,439.83      |
| 其他负债     | —            | —             | —            | —             | —            | 49,674.93     | 49,674.93     |
| 负债总计     | —            | —             | —            | —             | —            | 5,271,331.66  | 5,271,331.66  |
| 利率敏感度缺口  | 3,522,978.50 | 12,975,482.07 | 9,502,272.57 | 11,354,698.41 | 8,985,135.70 | -1,288,103.24 | 45,052,464.01 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

| 假设 | 1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。 |                             |                   |
|----|---|-----------------------------|-------------------|
| 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06月30日）            | 上年度末（2022年12月31日） |
|    | 1. 基准点利率增加0.1%                            | -39,576.83                  | -29,895.97        |
|    | 2. 基准点利率减少0.1%                            | 39,576.83                   | 29,895.97         |

#### 6.4.13.4.2 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。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末（2023年06月30日）  |             |             |               |               |
|---------------|-------------------|-------------|-------------|---------------|---------------|
|               | 美元<br>折合人民币       | 港币<br>折合人民币 | 欧元<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                   |             |             |               |               |
| 银行存款          | 499,925.57        | 82.15       | 2,331.78    | —             | 502,339.50    |
| 交易性金融资产       | 37,753,785.39     | —           | —           | —             | 37,753,785.39 |
| 结算备付金         | 575,504.19        | —           | —           | —             | 575,504.19    |
| 资产合计          | 38,829,215.15     | 82.15       | 2,331.78    | —             | 38,831,629.08 |
| 以外币计价的负债      |                   |             |             |               |               |
| —             | —                 | —           | —           | —             | —             |
| 负债合计          | —                 | —           | —           | —             | —             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 38,829,215.15     | 82.15       | 2,331.78    | —             | 38,831,629.08 |
| 项目            | 上年度末（2022年12月31日） |             |             |               |               |
|               | 美元                | 港币          | 欧元          | 其他币种          | 合计            |

|               | 折合人民币         | 折合人民币 | 折合人民币    | 折合人民币 |               |
|---------------|---------------|-------|----------|-------|---------------|
| 以外币计价的资产      |               |       |          |       |               |
| 银行存款          | 2,138,805.96  | 79.59 | 1,736.36 | —     | 2,140,621.91  |
| 交易性金融资产       | 37,635,344.98 | —     | —        | —     | 37,635,344.98 |
| 结算备付金         | 7,877.45      | —     | —        | —     | 7,877.45      |
| 应收清算款         | 3,451,053.53  | —     | —        | —     | 3,451,053.53  |
| 资产合计          | 43,233,081.92 | 79.59 | 1,736.36 | —     | 43,234,897.87 |
| 以外币计价的负债      |               |       |          |       |               |
| —             | —             | —     | —        | —     | —             |
| 负债合计          | —             | —     | —        | —     | —             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 43,233,081.92 | 79.59 | 1,736.36 | —     | 43,234,897.87 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | (1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。 |                             |                        |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 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 06 月 30 日）       | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 港币相对人民币贬值 1%  | -0.82                       | -0.80                  |
|    | 港币相对人民币升值 1%  | 0.82                        | 0.80                   |
|    | 美元相对人民币贬值 1%  | -388,292.15                 | -432,330.82            |
|    | 美元相对人民币升值 1%  | 388,292.15                  | 432,330.82             |
|    | 欧元相对人民币贬值 1%  | -23.32                      | -17.36                 |
|    | 欧元相对人民币升值 1%  | 23.32                       | 17.36                  |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融

---

工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括股票、基金（含 ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他融工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。针对境内投资，本基金可投资于国内债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、国债期货和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的相关规定）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于亚洲市场债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于境内发行的债券资产的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终，在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。“亚洲市场债券”包括亚洲国家或地区的政府发行的债券，登记注



册在亚洲国家或地区或主要业务收入/资产在亚洲国家或地区的机构、企业等发行的债券。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末（2023年06月30日） |              | 上年度末（2022年12月31日） |              |
|---------------|------------------|--------------|-------------------|--------------|
|               | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | —                | —            | —                 | —            |
| 交易性金融资产—基金投资  | 30,998.68        | 0.06         | 29,216.50         | 0.06         |
| 交易性金融资产—债券投资  | 48,042,077.13    | 92.53        | 42,817,588.75     | 95.04        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                | —            | —                 | —            |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                | —            | —                 | —            |
| 其他            | —                | —            | —                 | —            |
| 合计            | 48,073,075.81    | 92.59        | 42,846,805.25     | 95.10        |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

| 假设             | 1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。 |                             |                   |
|----------------|---|-----------------------------|-------------------|
| 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06月30日）            | 上年度末（2022年12月31日） |
|                | 1. 业绩比较基准增加 1%  | 291,183.16                  | 251,668.35        |
| 2. 业绩比较基准减少 1% | -291,183.16   | -251,668.35                 |                   |

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 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06月30日) | 上年度末<br>(2022年12月31日) |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 30,998.68            | 29,216.50             |
| 第二层次          | 48,042,077.13        | 42,817,588.75         |
| 第三层次          | —                    | —                     |
| 合计            | 48,073,075.81        | 42,846,805.25         |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

---

#### **6.4.14.4 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。

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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：普通股            | —             | —             |
|    | 存托凭证              | —             | —             |
|    | 房地产信托凭证           | —             | —             |
| 2  | 基金投资              | 30,998.68     | 0.06          |
| 3  | 固定收益投资            | 48,042,077.13 | 91.55         |
|    | 其中：债券             | 48,042,077.13 | 91.55         |
|    | 资产支持证券            | —             | —             |
| 4  | 金融衍生品投资           | —             | —             |
|    | 其中：远期             | —             | —             |
|    | 期货                | —             | —             |
|    | 期权                | —             | —             |
|    | 权证                | —             | —             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 1,696,435.61  | 3.23          |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —             |
| 6  | 货币市场工具            | —             | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,527,969.46  | 2.91          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,178,838.81  | 2.25          |
| 9  | 合计                | 52,476,319.69 | 100.00        |

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期内无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期内无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期内未进行权益投资。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|------------|---------------|--------------|
| AAA+至 AAA- | —             | —            |
| AA+至 AA-   | 2,156,605.33  | 4.15         |
| A+至 A-     | 25,020,408.72 | 48.19        |
| BBB+至 BBB- | 6,985,303.06  | 13.45        |
| BB+至 BB-   | —             | —            |
| B+至 B-     | —             | —            |
| 未评级        | 13,879,760.02 | 26.73        |

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、惠誉等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息，其中境内债券取自境内第三方评级机构的债项评级。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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  | 018008                      | 国开 1802                  | 80,000 | 8,296,905.21 | 15.98        |
| 2  | AGRBK 0.7<br>06/17/24       | AGRBK 0.7<br>06/17/24    | 7,000  | 4,829,092.90 | 9.30         |
| 3  | CCB Float<br>10/24/24       | CCB Float<br>10/24/24    | 5,000  | 3,652,150.55 | 7.03         |
| 4  | BOSBVI 1<br>1/4<br>09/10/23 | BOSBVI 1 1/4<br>09/10/23 | 5,000  | 3,595,645.36 | 6.92         |
| 5  | INDUBK<br>1.125<br>11/06/23 | INDUBK 1.125<br>11/06/23 | 5,000  | 3,562,892.99 | 6.86         |

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称  | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------|--------|------|---------------|
| 1  | 外汇期货  | UC2309 | —    | —             |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。期货投资的公允价值变动金额为-525,110.00元，已包含在结算备付金中。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                         | 基金类型    | 运作方式 | 管理人                               | 公允价值      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------|---------|------|-----------------------------------|-----------|---------------|
| 1  | PIMCO-HI YIELD BD-\$INST INC | 普通开放式基金 | 开放式  | PIMCO Global Advisors Ireland Ltd | 30,998.68 | 0.06          |

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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 | 1,163,459.34 |
| 2 | 应收清算款 | 4,441.37     |
| 3 | 应收股利  | —            |
| 4 | 应收利息  | —            |
| 5 | 应收申购款 | 10,938.10    |
| 6 | 其他应收款 | —            |
| 7 | 待摊费用  | —            |
| 8 | 其他    | —            |
| 9 | 合计    | 1,178,838.81 |

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |           |              |           |
|----------|-----------|---------------|-----------|--------------|-----------|
|          |           | 机构投资者         |           | 个人投资者        |           |
|          |           | 持有份额          | 占总份额比例(%) | 持有份额         | 占总份额比例(%) |
| 865      | 56,935.88 | 45,561,003.05 | 92.51     | 3,688,534.38 | 7.49      |

### 8.2 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 | 225,747.23 | 0.4584      |

### 8.3 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的情况

| 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<br>研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                    | 10~50             |



---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2020年04月07日)基金份额总额 | 207,028,603.98 |
| 报告期期初基金份额总额                | 43,743,960.42  |
| 本报告期基金总申购份额                | 52,596,923.11  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 47,091,346.10  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 49,249,537.43  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 (%) |    |
| ABCI Securities Company Limited | 0      | —    | —                | —         | —              | —  |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Australia and New Zealand Banking Group Limited | 0 | — | — | — | — | — |
| Bank of America – Merrill Lynch International   | 0 | — | — | — | — | — |
| BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED               | 0 | — | — | — | — | — |
| Bank of China HK Branch                         | 0 | — | — | — | — | — |
| Bank of Montreal                                | 0 | — | — | — | — | — |
| Barclays Bank                                   | 0 | — | — | — | — | — |
| Bernstein Bank                                  | 0 | — | — | — | — | — |
| BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking     | 0 | — | — | — | — | — |
| BOCI Securities Limited                         | 0 | — | — | — | — | — |
| BOCOM International Holdings Company Limited    | 0 | — | — | — | — | — |
| Cathay Securities((HK) Limited                  | 0 | — | — | — | — | — |
| CCB International Securities Limited            | 0 | — | — | — | — | — |
| CEB International Capital Corporation Limited   | 0 | — | — | — | — | — |
| Central Wealth Securities Investment Limited    | 0 | — | — | — | — | — |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CGS-CIMB Securities (HK) Ltd                                | 0 | — | — | — | — | — |
| China CITIC Bank International Limited                      | 0 | — | — | — | — | — |
| China Galaxy International Financial Holdings Limited       | 0 | — | — | — | — | — |
| China Industrial Securities International Brokerage Limited | 0 | — | — | — | — | — |
| China International Capital Corporation HK Securities Ltd   | 0 | — | — | — | — | — |
| China Merchants Securities (HK) Co., Limited                | 0 | — | — | — | — | — |
| China Renaissance Securities (HK) Limited                   | 0 | — | — | — | — | — |
| China Securities (International) Brokerage Company Limited  | 0 | — | — | — | — | — |
| CITIC Futures International Co., Ltd                        | 0 | — | — | — | — | — |
| CITIC Securities Brokerage (HK) Limited                     | 0 | — | — | — | — | — |
| CITIBANK, N. A.   | 0 | — | — | — | — | — |
| CLSA  | 0 | — | — | — | — | — |

|  |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|
| CMB International Capital Corporation Limited          | 0 | — | — | — | — | — |
| CMB International Global Markets Limited               | 0 | — | — | — | — | — |
| CMB Wing Lung Bank Ltd.                                | 0 | — | — | — | — | — |
| CMBC Securities Company Limited                        | 0 | — | — | — | — | — |
| Credit Agricole Corporate and Investment Bank          | 0 | — | — | — | — | — |
| CREDIT SUISSE (HK) LIMITED                             | 0 | — | — | — | — | — |
| CTI Capital Management Limited                         | 0 | — | — | — | — | — |
| Daiwa Capital Markets (HK) Limited                     | 0 | — | — | — | — | — |
| DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch                        | 0 | — | — | — | — | — |
| DBS Vickers (Hong Kong) Ltd                            | 0 | — | — | — | — | — |
| Deutsche Bank AG, London                               | 0 | — | — | — | — | — |
| DTCC Singapore PTE Ltd                                 | 0 | — | — | — | — | — |
| Essence International Securities (HK) Limited          | 0 | — | — | — | — | — |
| Everbright Securities Investment Services (HK) Limited | 0 | — | — | — | — | — |

|  |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|
| FIL Investment Management (HK) Limited             | 0 | — | — | — | — | — |
| First Shanghai Investments Limited                 | 0 | — | — | — | — | — |
| GF Securities Co., Ltd.                            | 0 | — | — | — | — | — |
| Goldman Sachs                                      | 0 | — | — | — | — | — |
| Goldman Sachs Gao Hua Securities Company Limited   | 0 | — | — | — | — | — |
| Guosen Securities (HK) Financial Holdings Co., Ltd | 0 | — | — | — | — | — |
| Guotai Junan Securities (HK) Limited               | 0 | — | — | — | — | — |
| Haitong Bank, S. A.                                | 0 | — | — | — | — | — |
| Haitong International Securities Company Limited   | 0 | — | — | — | — | — |
| Huatai Financial Holdings (HK) Limited             | 0 | — | — | — | — | — |
| ICBC International Securities Limited              | 0 | — | — | — | — | — |
| Instinet Pacific Ltd.                              | 0 | — | — | — | — | — |
| Jefferies International Limited                    | 0 | — | — | — | — | — |
| JPMorgan Chase Bank, N. A.                         | 0 | — | — | — | — | — |
| Macquarie Group Limited                            | 0 | — | — | — | — | — |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Mizuho Securities International                           | 0 | — | — | — | — | — |
| Morgan Stanley & Co. International PLC                    | 0 | — | — | — | — | — |
| NatWest Markets Plc                                       | 0 | — | — | — | — | — |
| Nomura Singapore Limited                                  | 0 | — | — | — | — | — |
| Orient Securities (HK) Limited                            | 0 | — | — | — | — | — |
| Royal Bank of Canada                                      | 0 | — | — | — | — | — |
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited                | 0 | — | — | — | — | — |
| Societe Generale Corporate & Investment Banking           | 0 | — | — | — | — | — |
| Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited | 0 | — | — | — | — | — |
| SPDB International Holdings Limited                       | 0 | — | — | — | — | — |
| Standard Chartered Bank                                   | 0 | — | — | — | — | — |
| The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited     | 0 | — | — | — | — | — |
| Toronto-Dominion Bank                                     | 0 | — | — | — | — | — |
| UBS Securities Asia Limited                               | 0 | — | — | — | — | — |
| UOB Kay Hian (HK) Limited                                 | 0 | — | — | — | — | — |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Valuable Capital Limited                          | 0 | — | — | — | — | — |
| Zhongtai International Financial Products Limited | 0 | — | — | — | — | — |
| Zurcher Kantonalbank                              | 0 | — | — | — | — | — |
| 长江证券  | 3 | — | — | — | — | — |
| 诚通证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 东方证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 东吴证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 方正证券  | 1 | — | — | — | — | — |
| 广发证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 国盛证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 国信证券  | 1 | — | — | — | — | — |
| 海通证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 华泰证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 华西证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 民生证券  | 1 | — | — | — | — | — |
| 申港证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 申万宏源  | 2 | — | — | — | — | — |
| 太平洋证券   | 2 | — | — | — | — | — |
| 银河证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 浙商证券  | 2 | — | — | — | — | — |
| 中金公司  | 2 | — | — | — | — | — |
| 中信建投  | 2 | — | — | — | — | — |
| 中信证券  | 2 | — | — | — | — | — |

注：注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

### 10.7.2 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 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|----|------|--------|------|------|
|----|------|--------|------|------|



| 名称  | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
|---|---------------|------------------|------|--------------------|------|------------------|------|------------------|
| ABCI Securities Company Limited                 | —             | —                | —    | —                  | —    | —                | —    | —                |
| Australia and New Zealand Banking Group Limited | 20,793,157.75 | 9.93             | —    | —                  | —    | —                | —    | —                |
| Bank of America Merrill Lynch International     | 4,806,696.40  | 2.30             | —    | —                  | —    | —                | —    | —                |
| BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED               | —             | —                | —    | —                  | —    | —                | —    | —                |

|  |              |      |   |   |   |   |   |   |
|--|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| Bank of China HK Branch                      | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Bank of Montreal                             | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Barclays Bank                                | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Bernstein Bank                               | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking  | 6,916,857.50 | 3.30 | — | — | — | — | — | — |
| BOCI Securities Limited                      | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| BOCOM International Holdings Company Limited | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|   |              |      |   |   |   |   |   |   |
|---|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| Cathay Securities((HK) Limited                | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| CCB International Securities Limited          | 4,218,122.54 | 2.02 | — | — | — | — | — | — |
| CEB International Capital Corporation Limited | 3,568,789.57 | 1.70 | — | — | — | — | — | — |
| Central Wealth Securities Investment Limited  | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| CGS-CIMB Securities (HK) Ltd                  | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|  |                   |       |   |   |   |   |   |   |
|--|-------------------|-------|---|---|---|---|---|---|
| China<br>CITIC<br>Bank<br>Intern<br>ationa<br>l<br>Limite<br>d                                     | —                 | —     | — | — | — | — | — | — |
| China<br>Galaxy<br>Intern<br>ationa<br>l<br>Financ<br>ial<br>Holdin<br>gs<br>Limite<br>d           | —                 | —     | — | — | — | — | — | — |
| China<br>Indust<br>rial<br>Securi<br>ties<br>Intern<br>ationa<br>l<br>Broker<br>age<br>Limite<br>d | —                 | —     | — | — | — | — | — | — |
| China<br>Intern<br>ationa<br>l<br>Capita<br>l<br>Corpor<br>ation<br>HK<br>Securi<br>ties<br>Ltd    | 22,060,05<br>2.84 | 10.54 | — | — | — | — | — | — |

|  |              |      |   |   |   |   |   |   |
|--|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| China Merchants Securities (HK) Co., Limited               | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| China Renaissance Securities (HK) Limited                  | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| China Securities (International) Brokerage Company Limited | 4,968,366.00 | 2.37 | — | — | — | — | — | — |
| CITIC Futures International Co., Ltd                       | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|   |               |       |   |   |   |   |   |   |   |
|---|---------------|-------|---|---|---|---|---|---|---|
| CITIC Securities Brokerage (HK) Limited       | 2,038,449.75  | 0.97  | — | — | — | — | — | — | — |
| CITIBANK, N. A.                               | 22,327,665.23 | 10.67 | — | — | — | — | — | — | — |
| CLSA  | 10,248,872.27 | 4.90  | — | — | — | — | — | — | — |
| CMB International Capital Corporation Limited | —             | —     | — | — | — | — | — | — | — |
| CMB International Global Markets Limited      | —             | —     | — | — | — | — | — | — | — |
| CMB Wing Lung Bank Ltd.                       | —             | —     | — | — | — | — | — | — | — |
| CMBC Securities Company Limited               | —             | —     | — | — | — | — | — | — | — |

|   |              |      |   |   |   |   |   |   |
|---|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| Credit Agricole Corporate and Investment Bank | 1,441,039.30 | 0.69 | — | — | — | — | — | — |
| CREDIT SUISSE (HK) LIMITED                    | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| CTI Capital Management Limited                | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Daiwa Capital Markets (HK) Limited            | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch               | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| DBS Vickers (Hong Kong) Ltd                   | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|  |              |      |   |   |   |   |   |   |
|--|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG, London                               | 1,388,484.55 | 0.66 | — | — | — | — | — | — |
| DTCC Singapore PTE Ltd                                 | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Essence International Securities (HK) Limited          | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Everbright Securities Investment Services (HK) Limited | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| FIL Investment Management (HK) Limited                 | —            | —    | — | — | — | — | — | — |



|  |               |      |   |   |   |   |   |   |
|--|---------------|------|---|---|---|---|---|---|
| First Shanghai Investments Limited                 | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| GF Securities Co., Ltd.                            | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| Goldman Sachs                                      | 13,579,912.64 | 6.49 | — | — | — | — | — | — |
| Goldman Sachs Gao Hua Securities Company Limited   | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| Guosen Securities (HK) Financial Holdings Co., Ltd | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| Guotai Junan Securities (HK) Limited               | 9,673,926.50  | 4.62 | — | — | — | — | — | — |

|  |               |      |   |   |   |   |   |   |
|--|---------------|------|---|---|---|---|---|---|
| Haitong Bank, S.A.                               | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| Haitong International Securities Company Limited | 15,930,336.11 | 7.61 | — | — | — | — | — | — |
| Huatai Financial Holdings (HK) Limited           | 8,202,858.39  | 3.92 | — | — | — | — | — | — |
| ICBC International Securities Limited            | 3,498,933.38  | 1.67 | — | — | — | — | — | — |
| Instinet Pacific Ltd.                            | —             | —    | — | — | — | — | — | — |
| Jefferies International Limited                  | 3,921,623.36  | 1.87 | — | — | — | — | — | — |

|  |              |      |   |   |   |   |   |   |
|--|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| JPMorgan Chase Bank, N. A.             | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Macquarie Group Limited                | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Mizuho Securities International        | 8,669,704.89 | 4.14 | — | — | — | — | — | — |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | 4,098,940.89 | 1.96 | — | — | — | — | — | — |
| NatWest Markets Plc                    | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Nomura Singapore Limited               | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Orient Securities (HK) Limited         | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Royal Bank of Canada                   | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited                | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Societe Generale Corporate & Investment Banking           | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited | — | — | — | — | — | — | — | — |
| SPDB International Holdings Limited                       | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Standard Chartered Bank                                   | — | — | — | — | — | — | — | — |

|   |              |      |   |   |   |   |   |   |
|---|--------------|------|---|---|---|---|---|---|
| The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | 7,510,045.03 | 3.59 | — | — | — | — | — | — |
| Toronto-Dominion Bank                                 | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| UBS Securities Asia Limited                           | 3,453,069.20 | 1.65 | — | — | — | — | — | — |
| UOB Kay Hian (HK) Limited                             | —            | —    | — | — | — | — | — | — |
| Valuable Capital Limited                              | —            | —    | — | — | — | — | — | — |

|   |              |      |               |       |   |   |   |   |
|---|--------------|------|---------------|-------|---|---|---|---|
| Zhongtai International Financial Products Limited | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| Zurcher Kanton albank                             | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 长江证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 诚通证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 东方证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 东吴证券  | 8,017,600.00 | 3.83 | 6,100,000.00  | 5.87  | — | — | — | — |
| 方正证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 广发证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 国盛证券  | —            | —    | 16,096,000.00 | 15.50 | — | — | — | — |
| 国信证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 海通证券  | —            | —    | 2,080,000.00  | 2.00  | — | — | — | — |
| 华泰证券  | 4,992,350.00 | 2.39 | 10,230,000.00 | 9.85  | — | — | — | — |
| 华西证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 民生证券  | —            | —    | 29,076,000.00 | 27.99 | — | — | — | — |
| 申港证券  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |
| 申万宏源  | —            | —    | —             | —     | — | — | — | — |

|           |                   |      |                   |       |   |   |   |   |
|-----------|-------------------|------|-------------------|-------|---|---|---|---|
| 太平洋<br>证券 | —                 | —    | —                 | —     | — | — | — | — |
| 银河证<br>券  | —                 | —    | —                 | —     | — | — | — | — |
| 浙商证<br>券  | 12,991,13<br>0.00 | 6.21 | 36,485,00<br>0.00 | 35.13 | — | — | — | — |
| 中金公<br>司  | —                 | —    | 3,800,000<br>.00  | 3.66  | — | — | — | — |
| 中信建<br>投  | —                 | —    | —                 | —     | — | — | — | — |
| 中信证<br>券  | —                 | —    | —                 | —     | — | — | — | — |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 信息披露方式 | 披露日期        |
|----|--|--------|-------------|
| 1  | 关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）暂停个人投资者申购、定期定额投资业务的公告       | 规定披露媒介 | 2023年01月10日 |
| 2  | 关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）恢复个人投资者申购、定期定额投资业务的公告       | 规定披露媒介 | 2023年02月10日 |
| 3  | 关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）基金资产净值低于5000万元的提示性公告        | 规定披露媒介 | 2023年02月22日 |
| 4  | 关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）基金资产净值低于5000万元的提示性公告        | 规定披露媒介 | 2023年03月08日 |
| 5  | 富国基金管理有限公司关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）调整费率并修改基金合同等事项的公告 | 规定披露媒介 | 2023年03月23日 |



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 2023-02-06 至<br>2023-03-09 | —             | 9,895,101.43  | 9,895,101.43  | —             | —      |
|  | 2              | 2023-01-01 至<br>2023-02-05 | 20,713,619.89 | —             | 20,713,619.89 | —             | —      |
|  | 3              | 2023-03-13 至<br>2023-06-30 | 7,199,119.02  | 38,092,299.31 | —             | 45,291,418.33 | 91.96% |
| 产品特有风险   |                |                            |               |               |               |               |        |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> |                |                            |               |               |               |               |        |

### 11.2 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》和《富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人决定自 2023 年 3 月 27 日起将本基金管理费率年费率由 0.80%调整为 0.50%，托管费率年费率从 0.20%调整为 0.10%并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。具体可参见基金管理人于 2023 年 3 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）调整费率并修改基金合同等事项的公告》及修改后的基金合同等法律文件。

## § 12 备查文件目录

| 备查文件名称   | 备查文件存放地点                                     | 备查文件查阅方式  |
|--|--|---|
| 1、中国证监会批准设立富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）的文件<br>2、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同<br>3、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）托管协议<br>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件<br>5、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）财务报表及报表附注<br>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告 | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 | 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）<br>公司地址：<br><a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。 |