

安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资  
资基金  
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

## § 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月17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。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信中债1-3政金债指数
基金主代码	010406
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年11月25日
报告期末基金份额总额	7,301,085.05份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中债-1-3年政策性金融债指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，

	基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定,因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C
下属分级基金的交易代码	010406	010407
报告期末下属分级基金的份额总额	869,092.14 份	6,431,992.91 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C
1. 本期已实现收益	6,156.96	65,151.32
2. 本期利润	5,752.08	68,138.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0067	0.0106
4. 期末基金资产净值	890,156.79	6,649,119.07
5. 期末基金份额净值	1.0242	1.0338

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

#### 3.2 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

安信中债 1-3 政金债指数 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	0.67%	0.05%	0.85%	0.03%	-0.18%	0.02%
过去六个月	1.34%	0.04%	1.71%	0.03%	-0.37%	0.01%
过去一年	2.48%	0.04%	2.91%	0.03%	-0.43%	0.01%
过去三年	7.94%	0.04%	8.98%	0.03%	-1.04%	0.01%

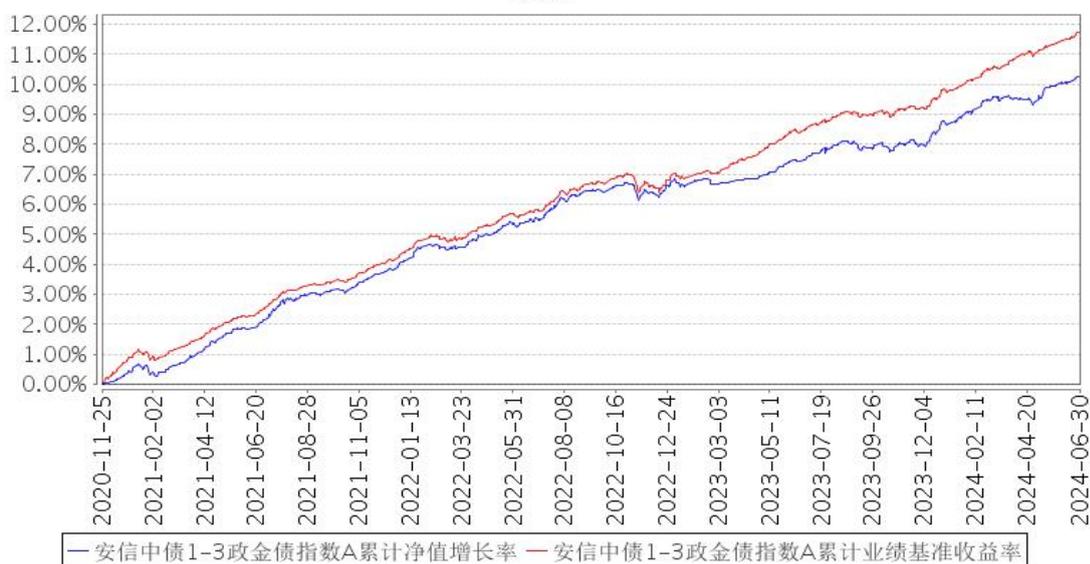
自基金合同生效起至今	10.25%	0.04%	11.72%	0.03%	-1.47%	0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

安信中债 1-3 政金债指数 C

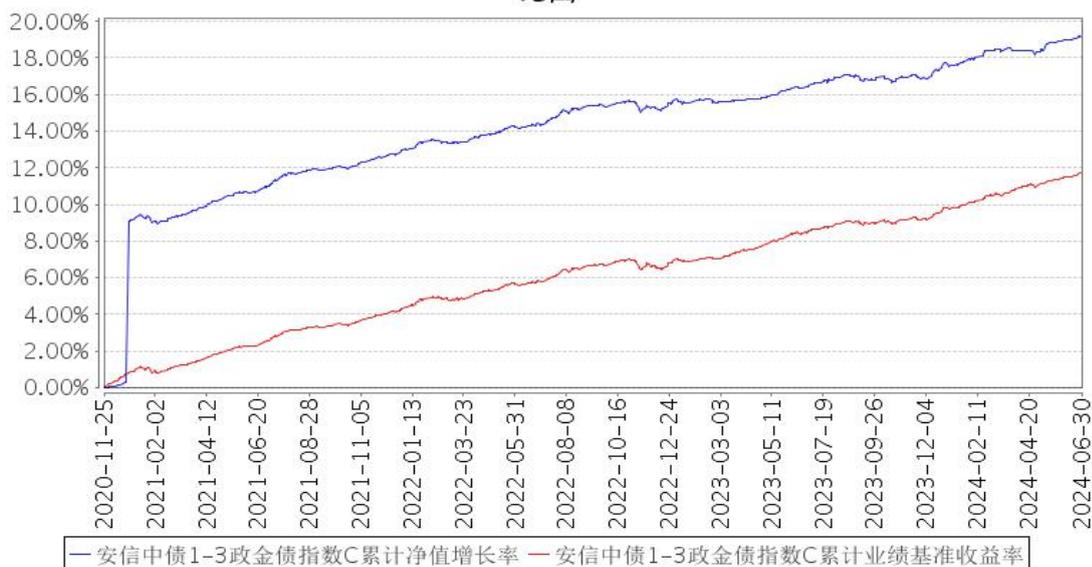
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.64%	0.05%	0.85%	0.03%	-0.21%	0.02%
过去六个月	1.21%	0.04%	1.71%	0.03%	-0.50%	0.01%
过去一年	2.29%	0.04%	2.91%	0.03%	-0.62%	0.01%
过去三年	7.41%	0.04%	8.98%	0.03%	-1.57%	0.01%
自基金合同生效起至今	19.19%	0.30%	11.72%	0.03%	7.47%	0.27%

### 3.2.2 自基金合同生效以来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

安信中债1-3政金债指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信中债1-3政金债指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 25 日。

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

## § 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		
魏晓菲	本基金的基金经理	2023 年 1 月 20 日	-	11 年	魏晓菲女士，法学硕士。历任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理、固定收益部投资经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司机构投资部投资经理，华润元大基金管理有限公司专户投资部投资经理、投资管理部基金经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。
任凭	本基金的基金经理	2024 年 4 月 29 日	-	15 年	任凭女士，硕士研究生。曾任职于招商基金管理有限公司，2011 年加入安信基金管理有限责任公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。现任安信活期宝货币市场基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资

					基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。
王涛	本基金的基金经理	2021 年 2 月 2 日	2024 年 4 月 29 日	21 年	王涛先生，经济学硕士，CFA、FRM。历任中国工商银行股份有限公司深圳分行资金运营部交易员、招商银行股份有限公司金融市场部交易员、东莞证券有限责任公司深圳分公司投资经理、融通基金管理有限公司基金经理、安信基金管理有限公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

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

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

从国内经济情况来看，总体来说二季度我国经济延续回升向好的态势，但也仍然面临有效需求不足、国内大循环不够顺畅、外部环境严峻复杂等挑战；二季度，制造业 PMI 再次回落至荣枯线以下，4-6 月分别录得 50.40、49.50 和 49.50，并呈现出生产强需求弱的特点；通胀方面表现温和，5 月 CPI 同比 0.30%，PPI 降幅延续收窄为-1.40%。金融方面，央行一方面坚持稳健宽松的政策基调，综合运用多种货币政策工具，助力实体经济高质量发展；在地产政策方面，推出房地产支持政策组合，包括降低个人住房贷款最低首付比例、取消个人房贷利率下限、下调公积金贷款利率，并设立保障性住房再贷款，用市场化方式加快推动存量商品房去库存；另一方面也着力规范市场行为，盘活低效存量金融资源，提高资金使用效率，畅通货币政策传导。5 月末，社会融资规模同比增长 8.4%，M2 同比增长 7%，均高于名义 GDP 增速。

本基金二季度继续追踪目标指数，以 1.5-2 年期限的政策性金融债作为主要投资标的，在本报告期随着短久期利率债收益率下行获得了较好的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信中债 1-3 政金债指数 A 基金份额净值为 1.0242 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.67%；安信中债 1-3 政金债指数 C 基金份额净值为 1.0338 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.64%；同期业绩比较基准收益率为 0.85%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日。

自 2024 年 3 月 27 日至本报告期末，本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

## § 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,734,940.46	89.07
	其中：债券	6,734,940.46	89.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	792,996.32	10.49
8	其他资产	33,347.55	0.44
9	合计	7,561,284.33	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	6,734,940.46	89.33
	其中：政策性金融债	6,734,940.46	89.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,734,940.46	89.33

### 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	210203	21 国开 03	30,000	3,105,447.95	41.19
2	200408	20 农发 08	20,000	2,093,963.93	27.77
3	220203	22 国开 03	10,000	1,028,367.76	13.64
4	220202	22 国开 02	5,000	507,160.82	6.73

### 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

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国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以降低债券仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 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

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

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,325.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	33,347.55

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C
报告期期初基金份额总额	1,674,168.55	342,843.14
报告期期间基金总申购份额	88,638.82	11,765,392.82
减：报告期期间基金总赎回份额	893,715.23	5,676,243.05
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	869,092.14	6,431,992.91

## § 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

项目	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C
----	------------------	------------------

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	-	1,947,798.99
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	-	1,947,798.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	26.68

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2024-04-25	1,947,798.99	2,000,000.00	-
合计			1,947,798.99	2,000,000.00	

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率或费用与本基金法律文件的规定一致。

## § 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

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	20240527-20240630	-	1,947,798.99	-	1,947,798.99	26.68
	2	20240527-20240630	-	2,142,559.92	-	2,142,559.92	29.35
个人	1	20240401-20240424	635,325.81	-	-	635,325.81	8.70
	2	20240527-20240630	-	1,948,824.75	-	1,948,824.75	26.69

#### 产品特有风险

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

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

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

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

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

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

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

### 9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2024 年 7 月 18 日