

富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

2024年第1季度报告

2024年03月31日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2024年04月18日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	9
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息	11
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	11
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	12
9.1 备查文件目录	12
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§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。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年4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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	018348
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年06月14日
报告期末基金份额总额	64,176,530.46份
投资目标	本基金采用指数化投资，力争在扣除各项费用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	<p>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。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.20%，将年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策</p>

	程序后及时对相关成份券进行调整。
业绩比较基准	中证同业存单AAA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	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分券及备选成分券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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01月01日 - 2024年03月31日）
1.本期已实现收益	240,027.96
2.本期利润	257,026.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040
4.期末基金资产净值	64,927,889.50
5.期末基金份额净值	1.0117

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。

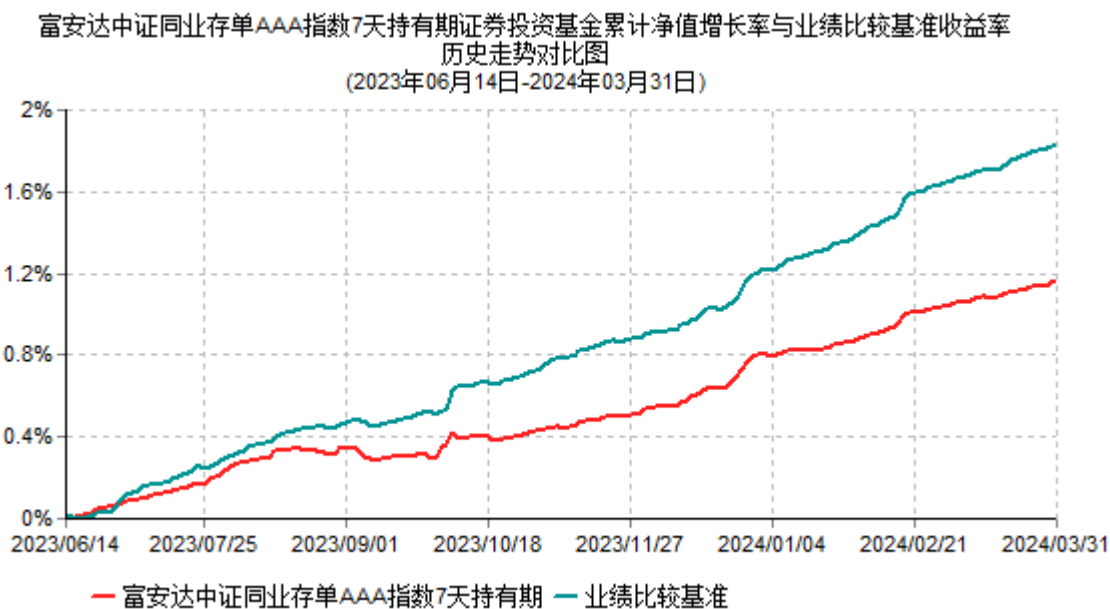
3.2 基金净值表现

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

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	0.37%	0.01%	0.61%	0.01%	-0.24%	0.00%
过去六个月	0.81%	0.01%	1.28%	0.01%	-0.47%	0.00%
自基金合同	1.17%	0.01%	1.82%	0.01%	-0.65%	0.00%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



- 注：①本基金《基金合同》生效日为2023年6月14日，截至本报告期末，基金成立未满1年。
- ②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2023年12月13日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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		
康佳燕	本基金的基金经理、固定收益部总监助理	2023-06-14	-	18年	硕士。历任工银安盛人寿保险有限公司财务部投资分析，泰信基金管理有限公司基金会计；浦银安盛基金管理有限公司基金会计、债券交易员、货币基金经理、专户投资经理；南洋商业银行

					固定收益部投资经理。2021年加入富安达基金管理有限公司任固定收益部总监助理。现任富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。
孙辰昶	本基金的基金经理	2023-12-08	-	10年	硕士。历任富安达资产管理（上海）有限公司产品设计专员；2016年3月加入富安达基金管理有限公司历任交易员、债券研究员兼投资经理、富安达现金货币市场证券投资基金的基金经理助理、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理助理。现任富安达现金货币市场证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理。

注：

①基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内债市收益率呈下行态势。1月初至春节前,跨年后资金面趋于平稳,大型商业银行和股份行先后下调定期存款利率,降准降息预期下机构抢跑叠加股债跷跷板效应导致债市走强。1月24日央行宣布降准后债市收益率进一步下行,曲线牛平。10年期国债收益率突破2.50%重要关口后来2.40%阻力位;1年期国债收益率由月初的2.12%下行24BP至低点1.88%;存单收益率曲线大幅下移,1年期AAA存单收益率由去年12月中旬的高点2.67%一路下行至2.29%。

春节后至3月初,资金价格维持在较低水平,资产荒下机构欠配压力推升债市做多情绪延续,LPR超预期调降带动广谱利率下行,1年期国债收益率下行至1.75%,但10年期国债收益率在2.40%强阻力位下行受阻,后受中小银行调降存款利率影响进一步向下突破2.30%。存单收益率曲线再次整体下移,1年期AAA存单收益率下行7BP至2.22%。

3月初至3月末,两会公布的经济增长目标5%左右和政策力度符合市场预期,但超长期特别国债带来潜在供给担忧,叠加地产信息扰动和人民币汇率波动加大,市场止盈情绪升温,超长端有所盘整。但随着央行发布会表示后续降准仍有空间,存款利率降息

预期升温，跨季资金转松等因素影响，债市收益率重回震荡下行。截至2024年3月29日，10年期国债收益率收于2.29%，1年期国债收益率收于1.72%，1年期AAA存单收益率收于2.23%。

报告期内，本基金采用抽样复制指数与动态优化相结合的方法，主要投资于中证AAA同业存单指数的成份券和备选成份券，并综合运用久期策略、骑乘策略、票息策略和杠杆策略等来增厚投资组合的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0117元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.37%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	74,951,291.88	99.90
	其中：债券	74,951,291.88	99.90
	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	77,603.35	0.10
8	其他资产	-	-
9	合计	75,028,895.23	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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（指数投资）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投资。

5.2.2 报告期末（积极投资）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投资。

5.2.3 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港股通投资的股票。

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 报告期末指数投资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投资。

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	3,566,721.86	5.49
	其中：政策性金融债	3,566,721.86	5.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	8,108,038.80	12.49
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	63,276,531.22	97.46
9	其他	-	-
10	合计	74,951,291.88	115.44

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例（%）
1	012382972	23京能电力SCP 001	50,000	5,072,043.72	7.81
2	112310149	23兴业银行CD1 49	50,000	4,993,877.95	7.69
3	112316085	23上海银行CD0 85	50,000	4,961,604.14	7.64
4	112396499	23宁波银行CD0 58	40,000	3,997,999.45	6.16
5	112303063	23农业银行CD0 63	40,000	3,995,542.56	6.15

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投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该证券纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资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投资。

5.11.5.2 期末积极投资前五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投资。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	56,579,636.50
报告期期间基金总申购份额	177,467,865.33
减：报告期期间基金总赎回份额	169,870,971.37
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	64,176,530.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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	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

别							
机构	1	20240101-20240116	10,948,442.80	0.00	0.00	10,948,442.80	17.06%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

注：

- ① “申购份额”包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ② “赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2024年1月19日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告
2. 2024年1月19日，富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2023年第4季度报告
3. 2024年1月30日，富安达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
4. 2024年2月6日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加乾道基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
5. 2024年3月13日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加众惠基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
6. 2024年3月27日，富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告
7. 2024年3月28日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
8. 2024年3月29日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告
9. 2024年3月29日，富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2023年年度报告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金设立的文件：

- 《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》；
- 《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；
- 《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》。

- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；

- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司

2024年04月18日