

# 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2季度报告

2024年06月30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07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	10
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	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	14

## §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	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	50,461,717.21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04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	173,050.32
2.本期利润	140,676.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0030
4.期末基金资产净值	51,206,550.44
5.期末基金份额净值	1.0148

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。

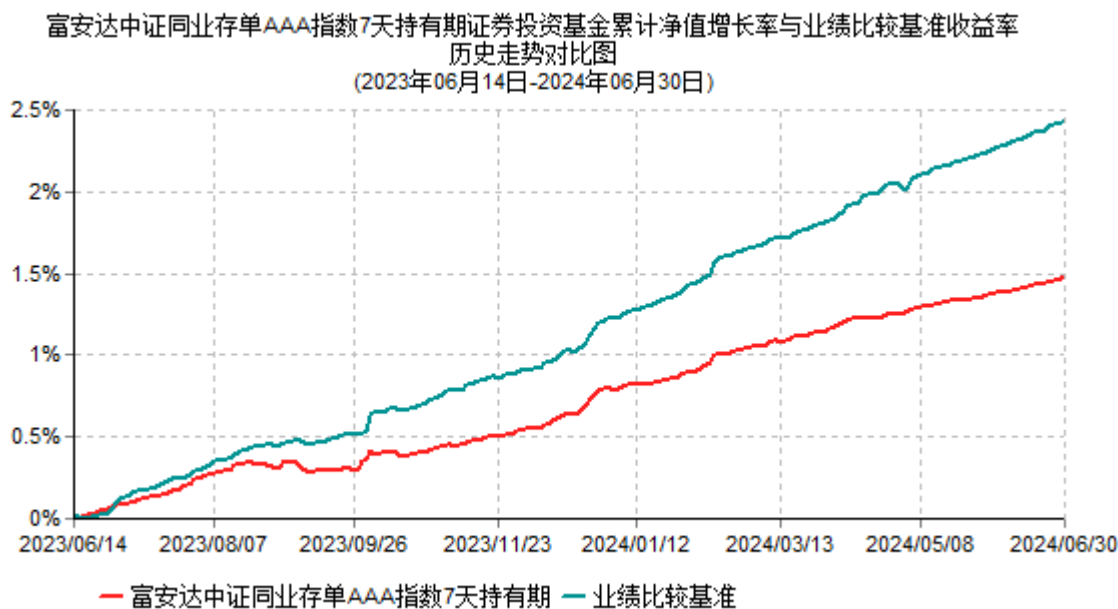
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.31%	0.01%	0.60%	0.01%	-0.29%	0.00%
过去六个月	0.67%	0.01%	1.22%	0.01%	-0.55%	0.00%
过去一年	1.41%	0.01%	2.36%	0.01%	-0.95%	0.00%

自基金合同生效起至今	1.48%	0.01%	2.43%	0.01%	-0.95%	0.00%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

### 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：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。
孙辰旻	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

二季度国内债市收益率经历短暂调整后再次转为震荡下行,债牛延续。4月初至中下旬,资金面均衡偏松,基本面偏弱,债市收益率进一步走低。截至2024年4月23日,30年期国债收益率由月初的2.49%下行7BP至2.42%;10年期国债收益率由月初的2.31%下行8BP至2.23%;1年期国债收益率由月初的1.74%下行8BP至1.66%;1年期AAA存单收益率则由月初的2.24%大幅下行23BP至2.01%,主因是4月初银行被禁止“手工补息”后,银行存款搬家至非银,资金大幅流入理财和货币,“资产荒”下此类机构对存单配置需求旺盛导致存单收益率大幅下行。

4月23日至月底,受央行表态长期国债收益率将运行在与长期经济增长预期相匹配的合理区间内、多地陆续出台地产优化政策、超长债供给放量预期以及机构行为等因素扰动,债市经历短暂的快速调整,形成V型走势。其中,30年期国债收益率由2.42%上行16BP至2.58%;10年期国债收益率由2.23%上行12BP至2.35%;1年期国债收益率由1.66%上行12BP至1.78%;1年期AAA存单收益率由2.01%上行16BP至2.17%。

5月,债市在震荡中缓慢走强,曲线牛陡,主线是基本面偏弱和资金面延续宽松,影响因素是央行多次提示长端收益率风险以及“517”房地产新政实施。6月,非银机构

资金充裕，资金面阶段性告别分层，叠加权益资产重回弱势，股债跷跷板效应下债市延续震荡走强态势。市场对央行提示长债风险反应钝化，30年期国债收益率下破2.50%关键点位，曲线牛平。跨季资金面收敛未能平缓市场整体做多情绪，各期限收益率全线下移，机构沿着曲线寻找机会，将债牛行情演绎到极致。截至2024年6月28日，30年期国债收益率收于2.43%，10年期国债收益率收于2.21%，1年期国债收益率收于1.54%，1年期AAA存单收益率收于1.96%。

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1.0148元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为0.60%。

#### 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，本基金曾存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本报告期内，本基金不存在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。

### §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	38,952,106.56	75.95
	其中：债券	38,952,106.56	75.95
	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	12,003,373.12	23.41
	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	328,187.26	0.64



	计		
8	其他资产	200.00	0.00
9	合计	51,283,866.94	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	3,032,693.44	5.92
	其中：政策性金融债	3,032,693.44	5.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,032,590.82	2.02
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	34,886,822.30	68.13
9	其他	-	-

10	合计	38,952,106.56	76.07
----	----	---------------	-------

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	112303144	23农业银行CD144	40,000	3,998,331.72	7.81
2	112305253	23建设银行CD253	40,000	3,978,638.36	7.77
3	112310323	23兴业银行CD323	40,000	3,973,699.15	7.76
4	240301	24进出01	30,000	3,032,693.44	5.92
5	112308256	23中信银行CD256	30,000	2,981,382.00	5.82

**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，中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国光大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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	200.00

#### 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	64,176,530.46
报告期期间基金总申购份额	52,135,908.22
减：报告期期间基金总赎回份额	65,850,721.47
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	50,461,717.21

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	20240403-20240630	10,948,442.80	0.00	0.00	10,948,442.80	21.70%
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4月1日，富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金清明节假期前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告

2. 2024年4月18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4月18日，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

3. 2024年4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劳动节假期前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告

4. 2024年5月9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

5. 2024年5月24日，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更新提示性公告

6. 2024年5月24日，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（更新）（二〇二四年第一号）

7. 2024年5月24日，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产品资料概要更新

8. 2024年5月30日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海大智慧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

9. 2024年6月5日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告

10. 2024年6月5日，富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金端午节假期前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告

11. 2024年6月13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

12. 2024年6月26日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加湘财证券股份有限公司为销售机构的公告

13. 2024年6月26日，关于富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金新增华金证券股份有限公司为销售机构的公告

14. 2024年6月26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

15. 2024年6月27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

16. 2024年6月28日，富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告

## §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](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司

2024年07月18日