

---

汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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7月1日起至2024年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	汇安中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	018343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年06月29日
报告期末基金份额总额	9,009,229.95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	本基金的投资策略包括指数化投资策略、债券投资策略、资产支持证券、证券公司短期公司债券等品种投资策略。本基金为被动管理基金，主要采用抽样复制和动态最优的策略进行组合构建，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，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。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平理论上低于股票型基金、偏股混合型基金，高于

	货币市场基金。
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

### §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07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	36,373.93
2.本期利润	29,159.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0028
4.期末基金资产净值	9,144,439.26
5.期末基金份额净值	1.0150

注：1、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。

2、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。

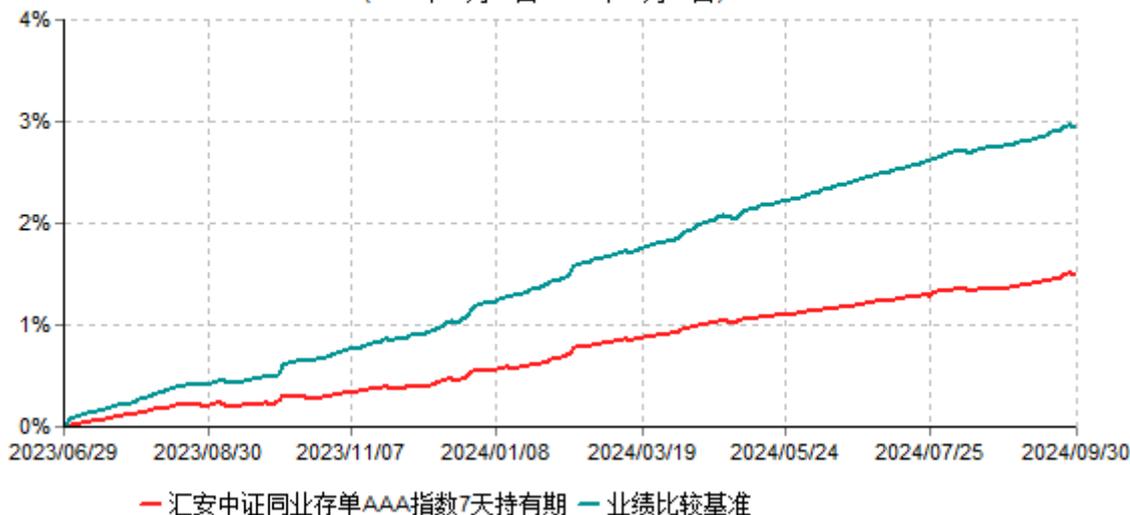
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.29%	0.01%	0.49%	0.01%	-0.20%	0.00%
过去六个月	0.56%	0.01%	1.11%	0.01%	-0.55%	0.00%
过去一年	1.24%	0.01%	2.43%	0.01%	-1.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.01%	2.96%	0.01%	-1.46%	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

汇安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023 年 06 月 29 日 - 2024 年 09 月 30 日)



注：①基金合同生效日为2023年6月29日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为更好实现投资目标，还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、金融债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券及其他经证监会允许投资的债券）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等允许基金投资的非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及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相关规定）。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本基金建仓期为2023年6月29日至2023年12月28日，在建仓期即将结束时基金规模变动幅度较大，由于临近年末，为降低流动性风险，维护基金持有人的利益，建仓期结束时本基金投资于同业存单的比例不足基金资产的80%。基金管理人已根据基金合同的规定在10个交易日内调整完毕。

#### §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		
黄济宽	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2023-06-29	-	12年	<p>黄济宽先生，英国纽卡斯尔大学金融学硕士研究生，12年证券、基金行业从业经验。曾任西藏同信证券股份有限公司固定收益业务委员会产品管理总部投资主办人，新沃基金管理有限公司特定客户资产投资部投资经理，华创证券有限责任公司资产管理总部高级投资经理。2019年9月加入汇安基金管理有限责任公司，担任绝对收益组基金经理。</p> <p>2019年12月11日至2021年7月23日、2022年7月1日至2023年7月19日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月23日，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月28日，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月28日，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年8月4日，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年8月4日，任汇安裕和纯债债券型</p>

					<p>证券投资基金基金经理；2019年11月13日至今，任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2020年4月29日至今，任汇安短债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至今，任汇安中短债债券型证券投资基金基金经理；2022年3月10日至今，任汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理；2022年5月10日至今，任汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理；2023年6月29日至今，任汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。</p>
王作舟	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2024-02-02	-	5年	<p>王作舟先生，清华大学金融学硕士，5年证券、基金行业从业经验。2019年10月加入汇安基金管理有限责任公司任交易部债券交易员，现任绝对收益组基金经理。2023年2月10日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年7月11日至今，任汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2023年7月19日至今，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年9月28日至今，任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>

					理；2024年2月2日至今，任汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理；2024年2月2日至今，任汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理；2024年3月13日至今，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，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。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，需求对于生产的拖累继续显现。PMI此前呈现生产强于需求的局面，但随着新订单预期低位徘徊，产销率持续低迷，利润率偏低，导致生产也开始快速下滑，企业的产成品库存位于历史高位，并开始反应性地降低原材料库存。地产方面，房价持续下跌，产生负向财富效应，收入预期下降导致消费数据偏弱，压制风险偏好。在此背景下，债券利率不断创下新低。

9月末，政策出现大幅转向。央行降准降息，同时推出针对股市的创新工具。政治局会议提到“干字当头，众志成城”，“切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感”，表态极为积极，风险偏好大幅扭转，股市大涨，地产方面，首次提及“要促进房地产市场止跌回稳”，市场对于房价企稳的信心有所增强，成交量大幅提高。受风险偏好提升影响，债券利率出现快速上行。

三季度，本基金主要通过不同期限的同业存单的配置，保持较高的流动性水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0150元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.29%，同期业绩比较基准收益率为0.49%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至报告期末，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。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。自2024年7月1日起由基金管理人承担本基金迷你基金期间项下信息披露费、审计费等相关固定费用。

## §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	8,547,339.70	93.16
	其中：债券	8,547,339.70	93.16
	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	619,559.32	6.75
8	其他资产	7,780.65	0.08
9	合计	9,174,679.67	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港股通股票。

## 5.3 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	609,042.58	6.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	7,938,297.12	86.81
9	其他	-	-
10	合计	8,547,339.70	93.47

## 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	019733	24国债02	6,000	609,042.58	6.66

2	112308256	23中信银行CD2 56	5,000	499,231.93	5.46
3	112402043	24工商银行CD0 43	5,000	498,882.98	5.46
4	112413079	24浙商银行CD0 79	5,000	498,527.62	5.45
5	112409010	24浦发银行CD0 10	5,000	497,424.58	5.44

**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股指期货交易情况说明**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金本报告期末未投资股指期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**  
本基金本报告期末未投资国债期货。

**5.10.2 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。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**  
本基金本报告期末未投资国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在本报告期编制前一年内曾受监管部门处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

**5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。**

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	267.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,513.01
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,780.65

**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**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	13,339,383.35
报告期期间基金总申购份额	733,348.41
减：报告期期间基金总赎回份额	5,063,501.81
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	9,009,229.95

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

无。

### 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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层  
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2024年10月25日