

安信鑫日享中短债债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度投资组合报告

§ 1 投资组合报告

1.1 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	2,120,521,676.35	99.36
	其中：债券	2,120,521,676.35	99.36
	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	4,831,308.03	0.23
8	其他资产	8,871,907.68	0.42
9	合计	2,134,224,892.06	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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。

1.2.2 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。

1.3 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

1.3.1 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。

1.4 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	156,305,582.49	7.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,733,093.30	6.08
	其中：政策性金融债	121,733,093.30	6.08
4	企业债券	120,240,822.29	6.00
5	企业短期融资券	785,555,809.24	39.22
6	中期票据	886,960,748.15	44.28
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,725,620.88	2.48
9	其他	-	-
10	合计	2,120,521,676.35	105.87

1.5 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	220013	22 付息国债 13	700,000	70,415,601.09	3.52
2	092218005	22 农发清发 05	500,000	50,960,150.68	2.54
3	112311127	23 平安银行 CD127	500,000	49,725,620.88	2.48
4	019678	22 国债 13	449,000	45,167,296.47	2.25
5	019693	22 国债 28	400,000	40,722,684.93	2.03

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.9.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的

长期稳定增值。

1.9.2 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。

1.9.3 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。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券除 23 平安银行 CD127（代码：112311127 CY）外其他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。

1. 平安银行股份有限公司

2023 年 1 月 18 日，平安银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律规定被中国银行间市场交易商协会通报批评。

2023 年 7 月 7 日，平安银行股份有限公司因违反反洗钱法、违规占压财政存款或资金被中国人民银行警告、罚款、没收违法所得。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

1.10.2 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。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	61,808.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,810,099.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,871,907.68

1.10.4 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。

1.10.5 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。

1.10.6 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。