

# 安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资 资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 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.....	45
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
8.8 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贵金属投资明细.....	46
8.9 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.....	46
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
8.11 投资组合报告附注.....	46
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	49
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
11.4 基金投资策略的改变.....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8 其他重大事件.....	50
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
12.1 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.....	52
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
13.1 备查文件目录.....	53
13.2 存放地点.....	53
13.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	2,121,098,233.74 份	
基金合同存续期	不定期	
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	1,981,153,606.79 份	139,944,626.95 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	罗菲菲
	联系电话	0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95568

传真	0755-82799292	010-57093382
注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	518026	100031
法定代表人	刘入领	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号 新世界商务中心 36 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021 年		2020 年 11 月 25 日(基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 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	安信中债 1-3 政金债 指数 A	安信中债 1-3 政 金债指数 C
本期已 实现收 益	19,599,800.05	1,948,785.68	7,568,224.24	183,826.22
本期利 润	20,056,528.54	2,300,318.30	11,834,652.08	300,063.99
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0280	0.0306	0.0044	0.0034
本期加 权平均	2.76%	2.85%	0.44%	0.34%

净值利润率				
本期基金份额净值增长率	3.61%	3.51%	0.43%	9.16%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	30,035,779.44	3,977,994.45	7,580,300.60	12,676.44
期末可供分配基金份额利润	0.0152	0.0284	0.0028	0.0901
期末基金资产净值	2,031,500,452.77	145,440,921.53	2,759,925,531.75	153,593.47
期末基金份额净值	1.0254	1.0393	1.0043	1.0916
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	4.05%	12.99%	0.43%	9.16%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.90%	0.02%	0.88%	0.02%	0.02%	0.00%
过去六个月	1.87%	0.03%	1.77%	0.02%	0.10%	0.01%
过去一年	3.61%	0.03%	3.40%	0.03%	0.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.05%	0.03%	4.33%	0.03%	-0.28%	0.00%

安信中债 1-3 政金债指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.87%	0.02%	0.88%	0.02%	-0.01%	0.00%
过去六个月	1.83%	0.03%	1.77%	0.02%	0.06%	0.01%
过去一年	3.51%	0.03%	3.40%	0.03%	0.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	12.99%	0.53%	4.33%	0.03%	8.66%	0.50%

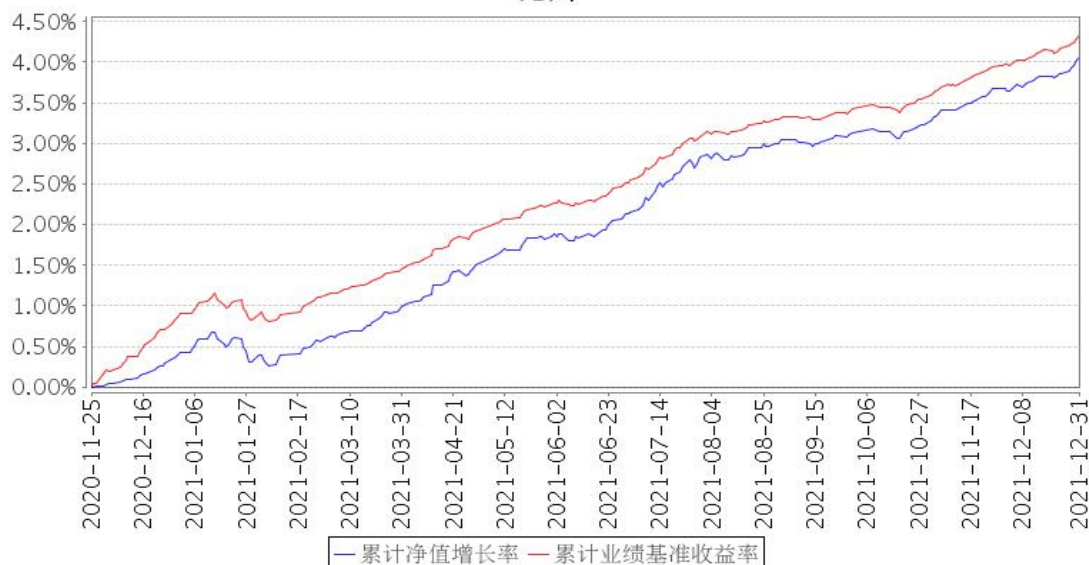
注：根据《安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中债-1-3 年政策性金融债指数收益率\*95%+银行人民币活期存款利率(税后)\*5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

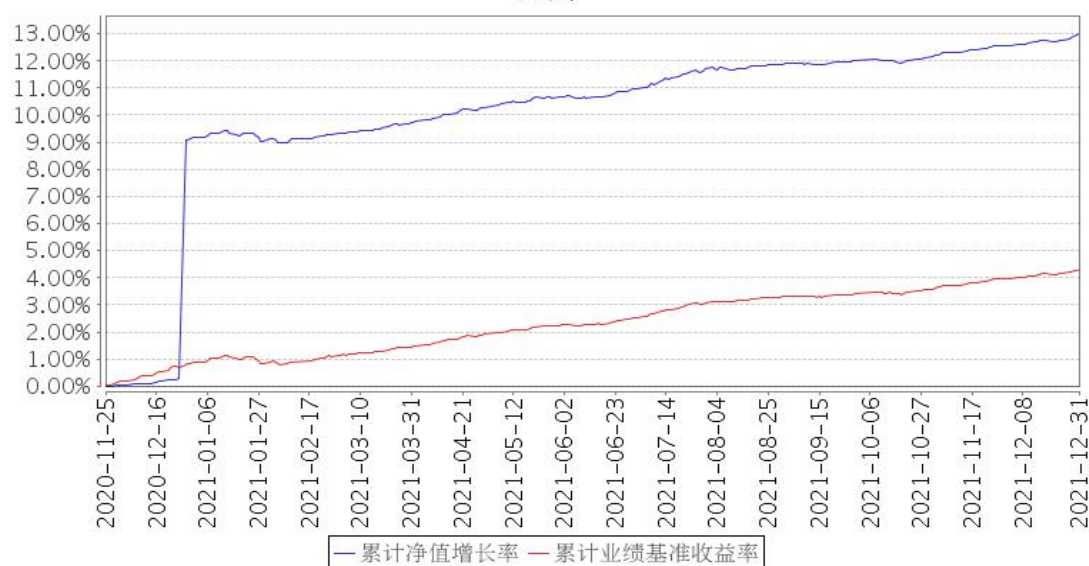


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

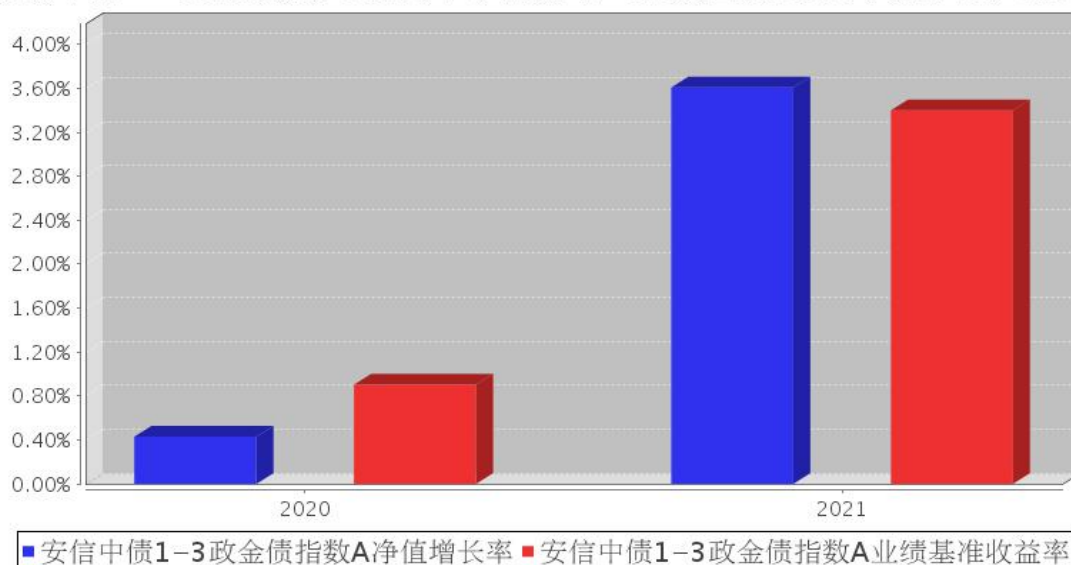


注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 25 日。

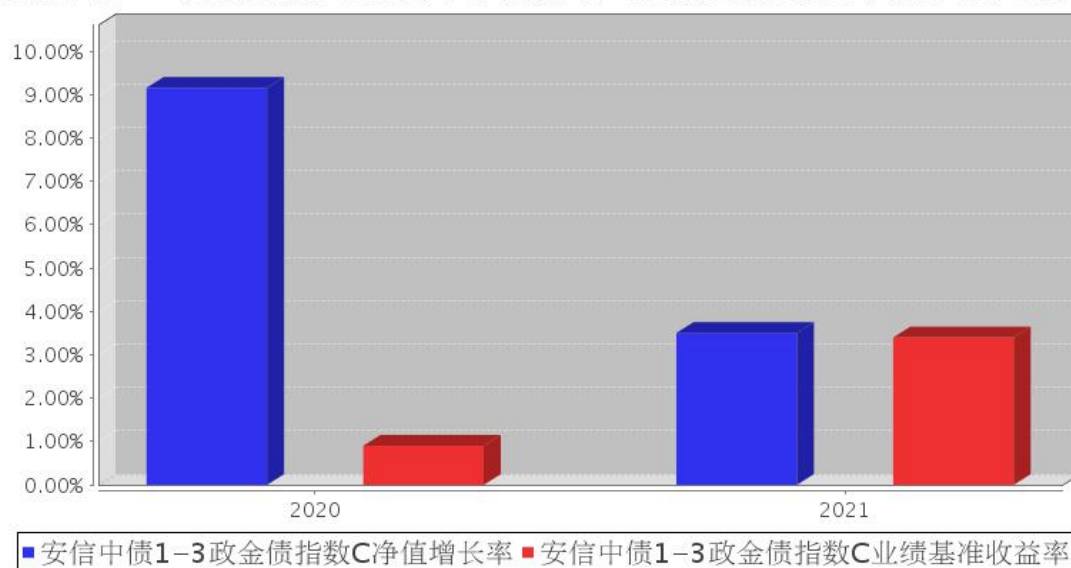
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信中债1-3政金债指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

安信中债 1-3 政金债指数 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.1500	5,966,351.49	1,513.42	5,967,864.91	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	0.1500	5,966,351.49	1,513.42	5,967,864.91	-

安信中债 1-3 政金债指数 C

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2021 年	0.9000	15,529,622.15	5,760,947.93	21,290,570.08	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	0.9000	15,529,622.15	5,760,947.93	21,290,570.08	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置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、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券

投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金(LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘巍	本基金的基金经理	2020 年 11 月 25 日	-	12 年	潘巍先生, 理学硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、信用研究员, 中华联合保险控股股份有限公司债券投资经理, 华夏基金管理有限公司专户投资经理, 安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信中证信

					用主体 50 债券指数证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理；现任安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合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	-	18 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。曾任安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金的基金经理；现任安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、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、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
祝璐琛	本基金的基金经理助理	2020 年 12 月 16 日	-	5 年	祝璐琛先生，经济学硕士，曾任华西证券股份有限公司固定收益部交易员，安信基金管理有限公司固定收益部分析师，现任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理，现任安信尊享添利利率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助理，安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一

					年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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。

#### 4.1.3 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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年全球经济仍然受到疫情影响，经济需求有所复苏但国内外有分化。供应链约束下，国外出现了通货膨胀。国内经济指标呈现前高后低的趋势，上半年经济整体经历复苏后的下半年延续下滑，经济总量呈现回落但结构分化。具体看一、二季度国内经济增长恢复情况较好，出口、投资和工业增加值两年复合增速向好，房地产投资恢复至与疫情前，但消费两年复合增速远低于疫情前。下半年三季度、四季度经济数据环比全面走弱，社融增速逐步探底。

货币政策方面，美国维持宽松货币政策至 4 季度才开始收缩量化宽松；中国下半年两度降准。债券市场上，由于国内 2020 年短端利率上行和信用事件的冲击，2021 年上半年利率水平在相对高位，下半年两次降准后，债券市场收益率大体上在波动中下行。全年一年期国债下行 30bp，十年期国债下行 40bp。

组合构造了与标的指数风险收益特征类似的债券资产组合，并动态选择了具备期限利差优势的 2 年内政金债券种。

### 4.4.2 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 1.0254 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.61%；安信中债 1-3 政金债指数 C 基金份额净值为 1.0393 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.51%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，国内二十大和美国中期选举都将受到全球特别关注。美联储加息、缩表也将成为影响全球金融市场的关键因素。国内经济情况和海外经济情况仍然会受到疫情的变化和自身的发展而变得复杂，国内新的增长动力崛起和旧的增长模式的渐退并行。伴随国内地产周期的逐步见顶，未来利率可能走入新的波动区间。新的增长模式也会催生与之相适应的金融模式，同时随着资管新规的推进，打破刚兑带来的利率中枢水平走低是大概率发生的事情。从信用扩张和资金供给框架来看，当前货币政策并没有明显放松，短端利率往下确实存在空间。2022 年关注 1-3 年内期限利差优势更为确定的利率债标的。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 27,258,434.99 元，其中本基金 A 类份额分配 5,967,864.91 元，C 类份额分配 21,290,570.08 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人的情形，时间范围分别为 2021 年 3 月 22 日至 2021 年 5 月 25 日、2021 年 7 月 22 日至 2021 年 10 月 18 日。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金



法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度和 2020 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无

其他事项	无
其他信息	无
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并</p>

	评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	沈兆杰	崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	56,436,249.26	214,026,700.92
结算备付金		18,181.82	6,952,343.78
存出保证金		7,221.34	37,972.48
交易性金融资产	7.4.7.2	2,102,974,000.00	2,075,174,170.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,102,974,000.00	2,075,174,170.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	436,564,602.95
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	18,008,214.46	27,809,438.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	32,244.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,177,443,866.88	2,760,597,473.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		198,858.44	354,870.64
应付托管费		66,286.14	118,290.20
应付销售服务费		23,227.42	7,670.30
应付交易费用	7.4.7.7	34,820.58	18,312.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,300.00	19,204.12
负债合计		502,492.58	518,348.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,121,098,233.74	2,748,281,175.51
未分配利润	7.4.7.10	55,843,140.56	11,797,949.71
所有者权益合计		2,176,941,374.30	2,760,079,125.22
负债和所有者权益总计		2,177,443,866.88	2,760,597,473.29

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,121,098,233.74 份，其中安信中债 1-3 政金债指数 A 基金份额总额为 1,981,153,606.79 份，基金份额净值 1.0254 元；安信中债 1-3 政金债指数 C 基金份额总额为 139,944,626.95 份，基金份额净值 1.0393 元。

## 7.2 利润表

会计主体：安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 25 日（基金合 同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		26,547,593.73	12,872,248.22
1. 利息收入		25,177,801.41	6,695,024.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,334,755.17	773,688.82
债券利息收入		23,552,946.77	3,983,975.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		290,099.47	1,937,360.32
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		373,010.97	1,794,558.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-

基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	373,010.97	1,794,558.08
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	808,261.11	4,382,665.61
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	188,520.24	0.18
减: 二、费用		4,190,746.89	737,532.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,211,112.31	408,156.86
2. 托管费	7.4.10.2.2	403,704.05	136,052.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	80,584.53	9,038.01
4. 交易费用	7.4.7.20	109,163.75	17,839.79
5. 利息支出		2,171,012.06	141,434.77
其中: 卖出回购金融资产支出		2,171,012.06	141,434.77
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	215,170.19	25,010.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		22,356,846.84	12,134,716.07
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		22,356,846.84	12,134,716.07

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,748,281,175.51	11,797,949.71	2,760,079,125.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,356,846.84	22,356,846.84
三、本期基金份额	-627,182,941.77	48,946,779.00	-578,236,162.77

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	2,738,517,005.63	88,183,651.88	2,826,700,657.51
2. 基金赎回款	-3,365,699,947.40	-39,236,872.88	-3,404,936,820.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-27,258,434.99	-27,258,434.99
五、期末所有者权益（基金净值）	2,121,098,233.74	55,843,140.56	2,176,941,374.30
项目	上年度可比期间 2020年11月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,600,212,156.27	-	2,600,212,156.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,134,716.07	12,134,716.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	148,069,019.24	-336,766.36	147,732,252.88
其中：1. 基金申购款	848,071,690.21	1,993,591.80	850,065,282.01
2. 基金赎回款	-700,002,670.97	-2,330,358.16	-702,333,029.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,748,281,175.51	11,797,949.71	2,760,079,125.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领	范瑛	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2439 号《关于准予安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》核准,由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,600,202,593.20 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 1044 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2020 年 11 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总 2,600,212,156.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,563.07 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《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》和《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》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用的基金份额,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的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,还可以投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的政策性金融债、国债、央行票据、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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的相关规定)。本基金不投资于股票等权益类资产。本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,其中,投资

于待偿期限为 1 至 3 年的标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：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%。

本财务报表由本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度和 2020 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年度和 2020 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。



本基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人

缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证

券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	活期存款	56,436,249.26	24,026,700.92	
定期存款	-	-		
其中：存款期限1个月以内	-	-		
存款期限1-3个月	-	-		
存款期限3个月以上	-	-		
其他存款	-	190,000,000.00		
合计	56,436,249.26	214,026,700.92		

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,315,000.00	56,115.00
	银行间市场	2,087,659,000.00	5,134,811.72
	合计	2,102,974,000.00	5,190,926.72
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,097,783,073.28	2,102,974,000.00	5,190,926.72
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债	370,139,524.99	370,735,170.60	595,645.61

券	银行间市场	1,700,651,980.00	1,704,439,000.00	3,787,020.00
	合计	2,070,791,504.99	2,075,174,170.60	4,382,665.61
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,070,791,504.99	2,075,174,170.60	4,382,665.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	274,600,000.00	-
银行间市场	161,964,602.95	-
合计	436,564,602.95	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	14,014.26	8,617.95
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	421,527.86
应收结算备付金利息	9.02	3,441.46
应收债券利息	17,994,187.66	26,783,152.91
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	592,679.56
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-

应收出借证券利息	-	-
其他	3.52	18.81
合计	18,008,214.46	27,809,438.55

注：其他存款应收利息所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款产生的应收利息

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	34,820.58	18,312.81
合计	34,820.58	18,312.81

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付银行间账户维护费	9,300.00	-
应付信息披露费	120,000.00	10,000.00
应付审计费	50,000.00	9,204.12
合计	179,300.00	19,204.12

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信中债 1-3 政金债指数 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,748,140,473.99	2,748,140,473.99
本期申购	2,414,274,843.79	2,414,274,843.79
本期赎回（以“-”号填列）	-3,181,261,710.99	-3,181,261,710.99
本期末	1,981,153,606.79	1,981,153,606.79

##### 安信中债 1-3 政金债指数 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,701.52	140,701.52
本期申购	324,242,161.84	324,242,161.84

本期赎回（以“-”号填列）	-184,438,236.41	-184,438,236.41
本期末	139,944,626.95	139,944,626.95

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2 本基金自 2020 年 10 月 20 日至 2020 年 11 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 2,600,202,593.20 元，折合为 2,600,202,593.20 份基金份额（其中 A 类基金份额 2,500,092,856.82 份，C 类基金份额 100,109,736.38 份）。根据《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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 9,563.07 元在本基金成立后，折合为 9,563.07 份基金份额（其中 A 类基金份额 9,505.70 份，C 类基金份额 57.37 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《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》、《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》及《安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 11 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 15 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自 2020 年 12 月 16 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信中债 1-3 政金债指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,580,300.60	4,204,757.16	11,785,057.76
本期利润	19,599,800.05	456,728.49	20,056,528.54
本期基金份额交易产生的变动数	8,823,543.70	15,649,580.89	24,473,124.59
其中：基金申购款	34,251,471.08	21,577,257.60	55,828,728.68
基金赎回款	-25,427,927.38	-5,927,676.71	-31,355,604.09
本期已分配利润	-5,967,864.91	-	-5,967,864.91
本期末	30,035,779.44	20,311,066.54	50,346,845.98

安信中债 1-3 政金债指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,676.44	215.51	12,891.95
本期利润	1,948,785.68	351,532.62	2,300,318.30
本期基金份额交易产生的变	23,307,102.41	1,166,552.00	24,473,654.41



动数			
其中：基金申购款	29,549,768.26	2,805,154.94	32,354,923.20
基金赎回款	-6,242,665.85	-1,638,602.94	-7,881,268.79
本期已分配利润	-21,290,570.08	-	-21,290,570.08
本期末	3,977,994.45	1,518,300.13	5,496,294.58

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	85,288.57	133,696.19
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,214,022.14	630,555.64
结算备付金利息收入	33,139.50	9,385.71
其他	2,304.96	51.28
合计	1,334,755.17	773,688.82

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,965,991,729.00	1,613,086,216.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,911,776,340.81	1,581,770,755.58
减：应收利息总额	53,842,377.22	29,520,903.17
买卖债券差价收入	373,010.97	1,794,558.08

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年11月25日（基金 合同生效日）至2020年12月 31日
1. 交易性金融资产	808,261.11	4,382,665.61
股票投资	-	-
债券投资	808,261.11	4,382,665.61
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	808,261.11	4,382,665.61

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年11月25日（基金合 同生效日）至2020年12月31 日
基金赎回费收入	188,520.07	0.18
基金转换费收入	0.17	-
合计	188,520.24	0.18

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年11月25日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	4,899.75	3,064.79
银行间市场交易费用	104,264.00	14,775.00
合计	109,163.75	17,839.79

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 11 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	40,795.88	9,204.12
信息披露费	120,000.00	10,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	17,174.31	5,406.32
银行间账户维护费	37,200.00	-
其他	-	400.00
合计	215,170.19	25,010.44

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,211,112.31	408,156.86
其中：支付销售机构的客户维护费	7,872.68	8.73

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	403,704.05	136,052.28

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2021年1月1日至2021年12月31日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C	合计
安信基金	-	50,155.43	50,155.43
安信证券	-	35.43	35.43
合计	-	50,190.86	50,190.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 11 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信中债 1-3 政金债指数 A	安信中债 1-3 政金债指数 C	合计
安信基金	-	9,026.71	9,026.71
合计	-	9,026.71	9,026.71

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年11月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	56,436,249.26	85,288.57	24,026,700.92	133,696.19

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

安信中债 1-3 政金债指数 A							
序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021年9月29日	2021年9月29日	0.1500	5,966,351.49	1,513.42	5,967,864.91	-
合计	-	-	0.1500	5,966,351.49	1,513.42	5,967,864.91	-
安信中债 1-3 政金债指数 C							
序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021年9月29日	2021年9月29日	0.4500	5,233,322.83	2,821,424.38	8,054,747.21	-
2	2021年12月1日	2021年12月1日	0.4500	10,296,299.32	2,939,523.55	13,235,822.87	-
合计	-	-	0.9000	15,529,622.15	5,760,947.93	21,290,570.08	-

				22.15	93	70.08	
--	--	--	--	-------	----	-------	--

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定

性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国民生银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2020 年 12 月 31 日：无）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	859,601,000.00	720,990,000.00
合计	859,601,000.00	720,990,000.00

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-



AAA 以下	-	-
未评级	1,243,373,000.00	1,354,184,170.60
合计	1,243,373,000.00	1,354,184,170.60

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式

借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	56,436,249.26	-	-	-	56,436,249.26
结算备付金	18,181.82	-	-	-	18,181.82
存出保证金	7,221.34	-	-	-	7,221.34
交易性金融资产	959,831,000.00	1,047,212,000.00	95,931,000.00	-	2,102,974,000.00
应收利息	-	-	-	18,008,214.46	18,008,214.46

资产总计	1,016,292,652.42	1,047,212,000.00	95,931,000.00	18,008,214.46	2,177,443,866.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	198,858.44	198,858.44
应付托管费	-	-	-	66,286.14	66,286.14
应付销售服务费	-	-	-	23,227.42	23,227.42
应付交易费用	-	-	-	34,820.58	34,820.58
其他负债	-	-	-	179,300.00	179,300.00
负债总计	-	-	-	502,492.58	502,492.58
利率敏感度缺口	1,016,292,652.42	1,047,212,000.00	95,931,000.00	17,505,721.88	2,176,941,374.30
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	214,026,700.92	-	-	-	214,026,700.92
结算备付金	6,952,343.78	-	-	-	6,952,343.78
存出保证金	37,972.48	-	-	-	37,972.48
交易性金融资产	961,332,170.60	1,113,842,000.00	-	-	2,075,174,170.60
买入返售金融资产	436,564,602.95	-	-	-	436,564,602.95
应收利息	-	-	-	27,809,438.55	27,809,438.55
应收申购款	-	-	-	32,244.01	32,244.01
资产总计	1,618,913,790.73	1,113,842,000.00	-	27,841,682.56	2,760,597,473.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	354,870.64	354,870.64
应付托管费	-	-	-	118,290.20	118,290.20
应付销售服务费	-	-	-	7,670.30	7,670.30
应付交易费用	-	-	-	18,312.81	18,312.81
其他负债	-	-	-	19,204.12	19,204.12
负债总计	-	-	-	518,348.07	518,348.07
利率敏感度缺口	1,618,913,790.73	1,113,842,000.00	-	27,323,334.49	2,760,079,125.22

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	8,769,180.42	5,940,277.29
	2. 市场利率上升	-8,667,699.25	-5,907,120.84

	25 个基点		
--	--------	--	--

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,102,974,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 2,075,174,170.60 元，无第一或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,102,974,000.00	96.58
	其中：债券	2,102,974,000.00	96.58
	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	56,454,431.08	2.59
8	其他各项资产	18,015,435.80	0.83
9	合计	2,177,443,866.88	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	348,371,000.00	16.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,754,603,000.00	80.60
	其中：政策性金融债	1,754,603,000.00	80.60
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	2,102,974,000.00	96.60

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210216	21 国开 16	7,500,000	749,700,000.00	34.44
2	092118003	21 农发清发 03	4,000,000	400,280,000.00	18.39
3	200005	20 付息国债	1,550,000	152,210,000.00	6.99

		05			
4	200407	20 农发 07	1,500,000	151,380,000.00	6.95
5	210411	21 农发 11	1,100,000	109,901,000.00	5.05

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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合约。

#### 8.10.3 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。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 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 21 国开 18（证券代码：210218 CY）、21 国开 16（证券代码：210216 CY）、18 国开 11（证券代码：180211 CY）、21 进出 12（证券代码：210312 CY）、21 农发清发 03（证券代码：092118003 CY）、20 农发 07（证券代码：200407 CY）、21 农发 11（证券代码：210411 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。

2021 年 1 月 8 日，国家开发银行因提供虚假材料或隐瞒真实情况、弄虚作假，违规经营被银保监会罚款 4,880 万元【银保监罚决字（2020）67 号】。

2021 年 7 月 16 日，中国进出口银行因违规经营被银保监会中国银行保险监督管理委员会罚款 7345.6 万元，没收违法所得【银保监罚决字（2021）31 号】。

2021 年 4 月 12 日，中国农业发展银行因未依法履行职责被乌审旗住房和城乡建设局罚款人民币 2479.3 元【乌住建罚决字（2021）002 号】。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,221.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,008,214.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,015,435.80

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信中债 1-3 政金债指数 A	69	28,712,371.11	1,980,960,600.76	99.99	193,006.03	0.01
安信中债 1-3 政金债指数 C	182	768,926.52	139,236,981.34	99.49	707,645.61	0.51
合计	233	9,103,425.90	2,120,197,582.10	99.96	900,651.64	0.04

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级



别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信中债 1-3 政金债指数 A	9,819.32	0.00
	安信中债 1-3 政金债指数 C	-	-
	合计	9,819.32	0.00

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信中债 1-3 政金债指数 A	0
	安信中债 1-3 政金债指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信中债 1-3 政金债指数 A	0
	安信中债 1-3 政金债指数 C	0
	合计	0

## § 10 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
基金合同生效日（2020 年 11 月 25 日）基金份额总额	2,500,102,362.52	100,109,793.75
本报告期期初基金份额总额	2,748,140,473.99	140,701.52
本报告期基金总申购份额	2,414,274,843.79	324,242,161.84
减：本报告期基金总赎回份额	3,181,261,710.99	184,438,236.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,981,153,606.79	139,944,626.95

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 40,795.88 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	-	-	-

海通证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	新租
中信建投	4	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,221,057,275.88	100.00%	1,689,059,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报	2021-01-08
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	2021 年度 安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报	2021-02-03
4	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
5	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-30

	金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告		
7	关于安信目标收益债券型证券投资基金等 35 只基金新增中国中金财富证券有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-04-06
8	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-04-21
9	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-05-20
10	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-06-26
11	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-15
12	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-20
13	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-08-27
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-03
15	关于暂停安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-09-13
16	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
17	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
18	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 2021 年第一次分红公告	中国证券报	2021-09-28
19	关于恢复安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-10-14
20	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-10-26
21	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金暂停 C 类份额大额申购、	中国证券报	2021-11-16

	大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告		
22	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 C 类份额 2021 年第二次分红公告	中国证券报	2021-11-30
23	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金恢复 C 类份额大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-12-08
24	安信基金管理有限责任公司关于安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金在五矿证券有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报	2021-12-14

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20211228-20211231	-	488,662,040.66	-	488,662,040.66	23.04
	2	20210209-20211216	299,999,000.00	-	-	299,999,000.00	14.14
	3	20210108-20210208	498,752,119.70	-	498,752,119.70	-	-
	4	20210209-20210408	299,999,000.00	-	299,999,000.00	-	-
	5	20211228-20211231	-	488,663,017.98	-	488,663,017.98	23.04
	6	20210409-20210510	100,003,722.22	48,879,655.88	100,003,722.22	48,879,655.88	2.30

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 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

2022 年 3 月 31 日