

浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
期证券投资基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

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：2023 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 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	016587
前端交易代码	016587
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 14 日
报告期末基金份额总额	1,021,007,338.03 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	<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。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整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误差进一步扩大。</p> <p>本基金的同业存单投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略及回购策略详见法律文件。</p>
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份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	5,654,081.02
2. 本期利润	3,944,938.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0053
4. 期末基金资产净值	1,042,498,002.97
5. 期末基金份额净值	1.0210

注：1、上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。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

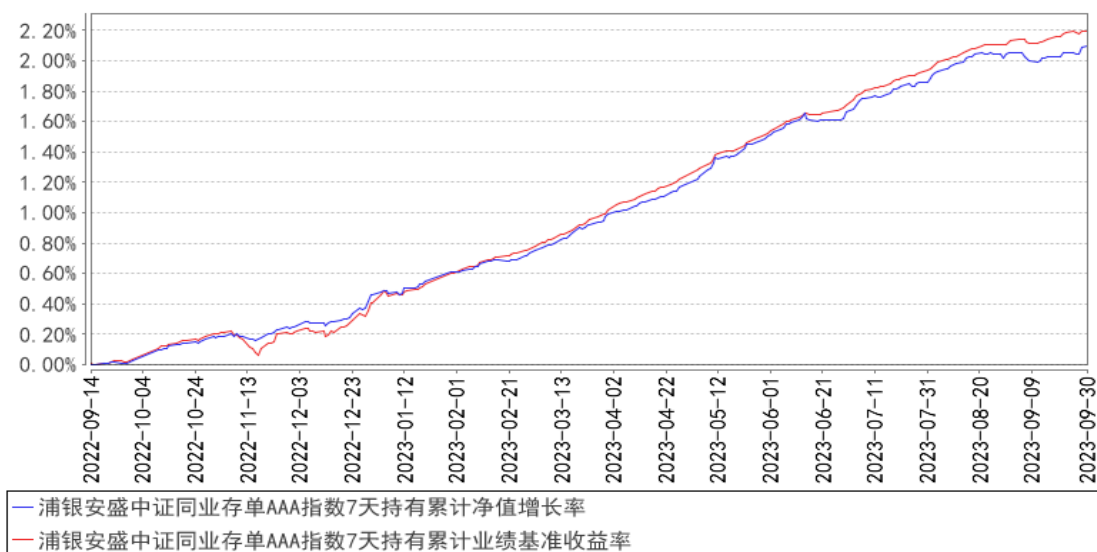
3.2 基金净值表现

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	0.43%	0.01%	0.48%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去六个月	1.10%	0.01%	1.17%	0.01%	-0.07%	0.00%
过去一年	2.07%	0.01%	2.17%	0.01%	-0.10%	0.00%
自基金合同 生效起至今	2.10%	0.01%	2.20%	0.01%	-0.10%	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

浦银安盛中证同业存单AAA指数7天持有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：根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2022 年 9 月 14 日至 2023 年 3 月 13 日。建仓期结束时符合相关规定。

§ 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		
廉素君	本基金的基金经理	2022 年 9 月 14 日	-	11 年	廉素君女士，华中科技大学金融学硕士。2012 年 3 月至 2013 年 6 月在第一创业证券股份有限公司任职稽核与风险管理岗；2013 年 7 月至 2017 年 11 月在郑州银行股份有限公司金融市场部，担任投资交易岗。2017 年 11 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，2017 年 11 月至 2019 年 3 月在固定收益投资部任职货币基金基金经理助理，现在固定收益投资部担任固定收益类基金经理。2019 年 3 月起担任浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。2021 年 10 月起担任浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月起担任浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。2022 年 11 月起担任浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资

					基金基金经理。2023 年 2 月起担任浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金及浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《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》的相关规定。

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，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

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违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他投资组合参与的交易公开竞价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% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，市场利率经历由小幅下行到迅速上行的一个过程。7、8 月份延续了基本面、经济数据持续疲软，同时市场怀揣着降息的预期，债券市场逐步有买盘 price-in 收益率震荡下行。8 月下旬央行完成降息，10 年国债收益率完成了 2.53% 的筑底，随后债券市场止盈反弹情绪集中，叠加房地产认房不认贷及贷款利率下调等多方面政策影响，收益率开始大幅回调，叠加着跨季资金面的扰动，10 年国债收益率回调至 2.7%。9 月央行虽然降准 0.25% 的百分点，但由于缴税因素及政府债券发行节奏提速等影响，收益率依然呈震荡上行趋势。

从资金面来看，央行对于资金面的维稳意图依然明显，关键时刻大规模的 OMO 操作及国庆提前进行的 14 天 OMO 跨季操作可以体现。但三季度资金面仍然以降息为分界点呈现了先松后紧的过程，DR001 在降息前加权平均利率为 1.78%，降息后为 1.97%，大幅上行 19bp。受降息后资金面收紧的影响，1 年国股存单由年内低点 2.22% 最高上行至 2.50%。同时，三季度末受逢中秋国庆双节扰动影响，跨季资金价格高企，对市场造成了较大冲击。虽然央行投放了大量的跨季资金，但资金面的紧张仍延续到节前最后一天，市场情绪整体较弱。

基于对经济基本面、货币政策及资金面的预判，本基金在 2023 年三季度灵活调整配置策略，并在关键时点保持合理的组合剩余期限和较高的杠杆水平，在类属配置方面以利率债、高等级信用债、存单为主，分析适当时机，配置收益率较高的短期资产，在保证组合良好流动性的基础上，提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金份额净值为 1.0210 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；同期业绩比较基准收益率为 0.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内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。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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	723,268,776.82	68.23
	其中：债券	723,268,776.82	68.23
	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	336,193,697.00	31.72
	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	577,094.19	0.05
8	其他资产	100.00	0.00
9	合计	1,060,039,668.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.3.2 报告期末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

注：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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	60,128,340.29	5.77
	其中：政策性金融债	60,128,340.29	5.77
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	663,140,436.53	63.61
9	其他	-	-
10	合计	723,268,776.82	69.38

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	112311052	23 平安银行 CD052	900,000	88,806,452.46	8.52
2	112307003	23 招商银行 CD003	500,000	49,899,287.18	4.79
3	112305007	23 建设银行 CD007	500,000	49,653,670.68	4.76
4	112320151	23 广发银行 CD151	500,000	49,652,941.58	4.76
5	112310043	23 兴业银行 CD043	500,000	49,593,883.15	4.76

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

注：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

注：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

注：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

注：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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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持有国债期货。

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

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在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行间市场交易商协会的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行间市场交易商协会的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国银行间市场交易商协会的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、重庆银保监局的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	100.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	100.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,537,466,946.57
报告期期间基金总申购份额	813,760,135.27
减：报告期期间基金总赎回份额	1,330,219,743.81
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	1,021,007,338.03

§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

注：本报告期本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

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

注：本基金报告期内无单一投资者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、 中国证监会批准浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集的文件
- 2、 浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛中证同业存单 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、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.py-axa.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日