

安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证 券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	018355
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 15 日
报告期末基金份额总额	3,534,649,921.08 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。当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，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 投资策略为：1、优化抽样复制策略；2、替代性策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略。
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。

	根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	6,623,720.34
2. 本期利润	8,917,770.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0061
4. 期末基金资产净值	3,559,741,678.06
5. 期末基金份额净值	1.0071

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。

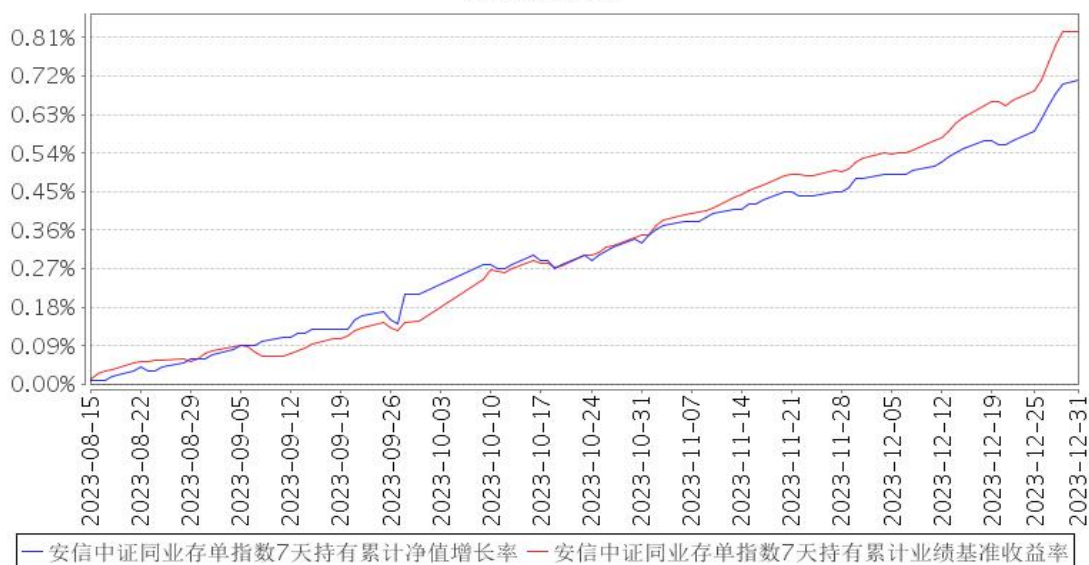
3.2 基金净值表现

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	0.50%	0.01%	0.68%	0.02%	-0.18%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.71%	0.01%	0.82%	0.01%	-0.11%	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

安信中证同业存单指数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：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 8 月 15 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

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。截止本报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 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		
任凭	本基金的基金经理	2023 年 8 月 15 日	-	15 年	任凭女士，硕士研究生。曾任职于招商基金管理有限公司，2011 年加入安信基金管理有限责任公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。现任安信活期宝货币市场基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。
祝璐琛	本基金的基金经理	2023 年 9 月 18 日	-	7 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，安信基金管理有限责任公司固定收益部分析师，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信现金增利货币市场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、

					安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、此处的“任职日期”、“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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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

宏观层面，四季度“稳增长”政策密集出台，稳地产政策不断加码、国债供给放量等“宽信用”政策并举，国内经济继续温和复苏；海外方面，市场开始对美联储降息有所预期，其他国家货币政策受其约束相对减弱；货币政策方面，央行表示要加大已出台货币政策实施力度，保持流动性合理充裕，引导信贷合理增长、均衡投放，保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配。

四季度以来债市收益率整体呈现横盘震荡、中枢下移的特征，整体呈“M”型走势。

10 月，由于资金面偏紧、经济数据超预期叠加利率债供给预期扰动下债市偏弱震荡，月末 10 年国债收益率上行至 2.72%附近；11 月，基本面内生动能偏弱叠加利好房企政策频出，10 年国债收益率在 2.65%-2.72%波动；12 月央行投放较为积极，跨年资金无忧，重要会议落地，银行存款利率下调，债市收益率继续下行。

具体看货币市场，季末 1 年国债下行约 10bp 至 2.07%，1 年国股存单下行约 5bp 至 2.41%，SHIBOR 3M 上行约 23bp 至 2.53%。

本基金操作方面，持仓以 3M-6M 中短国股大行存单为底仓，低杠杆波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0071 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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	2,178,244,992.43	60.66
	其中：债券	2,178,244,992.43	60.66
	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	947,340,340.92	26.38
	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	2,506,962.75	0.07
8	其他资产	462,816,080.36	12.89
9	合计	3,590,908,376.46	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	407,566.03	0.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	211,982,404.38	5.95
	其中：政策性金融债	211,982,404.38	5.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,053,409.84	0.28
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,955,801,612.18	54.94
9	其他	-	-
10	合计	2,178,244,992.43	61.19

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	112315517	23 民生银行 CD517	1,700,000	166,004,246.15	4.66
2	230206	23 国开 06	1,000,000	101,293,934.43	2.85
3	112302022	23 工商银行 CD022	1,000,000	99,672,493.15	2.80
4	112311171	23 平安银行 CD171	1,000,000	99,535,345.05	2.80
5	112317107	23 光大银行 CD107	1,000,000	99,336,422.95	2.79

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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 民生银行 CD517（代码：112315517 CY）、23 工商银行 CD022（代码：112302022 CY）、23 平安银行 CD171（代码：112311171 CY）、23 建设银行 CD076（代码：112305076 CY）、23 农业银行 CD068（代码：112303068 CY）、23 广发银行 CD207（代码：112320207 CY）、23 中信银行 CD103（代码：112308103 CY）、23 中国银行 CD063（代码：112304063 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. 中国民生银行股份有限公司

2023 年 2 月 17 日，中国民生银行股份有限公司因资金占用、信息披露虚假或严重误导性陈述被中国银行保险监督管理委员会罚款、没收违法所得。

2023 年 5 月 9 日，中国民生银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

2023 年 8 月 16 日，中国民生银行股份有限公司因违规事项被中国银行间市场交易商协会责令限期改正、一般警告。

2023 年 8 月 18 日，中国民生银行股份有限公司因内部制度不完善、违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

2. 中国工商银行股份有限公司

2023 年 4 月 4 日，中国工商银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

2023 年 4 月 12 日，中国工商银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被资溪县城建管理监察队罚款、责令改正。

3. 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。

2023 年 12 月 15 日，平安银行股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款。

4. 中国建设银行股份有限公司

2023 年 1 月 31 日，中国建设银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被北京市通信管理局通知整改。

2023 年 2 月 17 日，中国建设银行股份有限公司因信息披露虚假、严重误导性陈述、违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款、没收违法所得。

2023 年 5 月 11 日，中国建设银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

2023 年 12 月 1 日，中国建设银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

5. 中国农业银行股份有限公司

2023 年 8 月 18 日，中国农业银行股份有限公司因内部制度不完善、违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

2023 年 11 月 17 日，中国农业银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 1 日，中国农业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

6. 广发银行股份有限公司

2023 年 8 月 18 日，广发银行股份有限公司因信息披露类、市场监管类被 国家金融监督管理总局处以罚款。

2023 年 12 月 27 日，广发银行股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市税务局第三税务分局采取行政监管措施。

7. 中信银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，中信银行股份有限公司因违规提供担保及财务资助、违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

8. 中国银行股份有限公司

2023 年 2 月 17 日，中国银行股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2023 年 12 月 1 日，中国银行股份有限公司因违反反洗钱法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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,461.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	462,814,618.61
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	462,816,080.36

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,971,929,770.68
报告期期间基金总申购份额	3,243,783,658.86
减：报告期期间基金总赎回份额	1,681,063,508.46
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	3,534,649,921.08

§ 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

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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

2024 年 1 月 19 日