

信澳中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资 基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十四日

§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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳中债 0-3 年政策性金融债指数
基金主代码	021110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	2,677,090,765.68 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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，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，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差控制在 4% 以内。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。本基金运作过程中，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。
业绩比较基准	中债-0-3 年政策性金融债指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 A	信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 C
下属分级基金的交易代码	021110	021111
报告期末下属分级基金的份额总额	2,670,449,800.75 份	6,640,964.93 份

§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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 A	信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 C
1. 本期已实现收益	24,562,347.14	52,331.96
2. 本期利润	15,193,165.43	17,443.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0043	0.0025
4. 期末基金资产净值	2,688,148,713.18	6,996,255.43
5. 期末基金份额净值	1.0066	1.0535

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

信澳中债0-3年政策性金融债指数A

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	0.35%	0.07%	0.50%	0.03%	-0.15%	0.04%
自基金合同 生效起至今	0.66%	0.06%	0.82%	0.02%	-0.16%	0.04%

信澳中债0-3年政策性金融债指数C

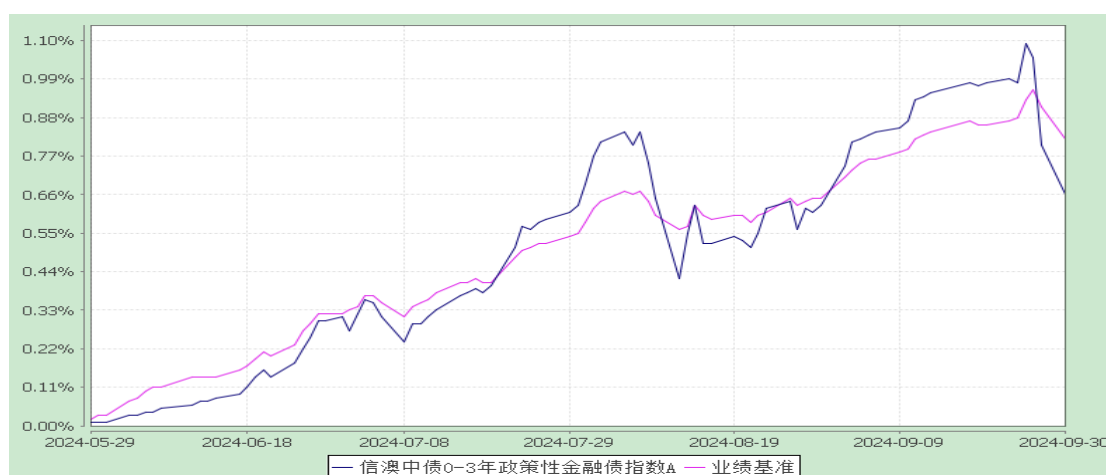
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.35%	0.07%	0.50%	0.03%	-0.15%	0.04%
自基金合同 生效起至今	0.66%	0.06%	0.82%	0.02%	-0.16%	0.04%

过去三个月	0.26%	0.07%	0.50%	0.03%	-0.24%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.35%	0.52%	0.82%	0.02%	4.53%	0.50%

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

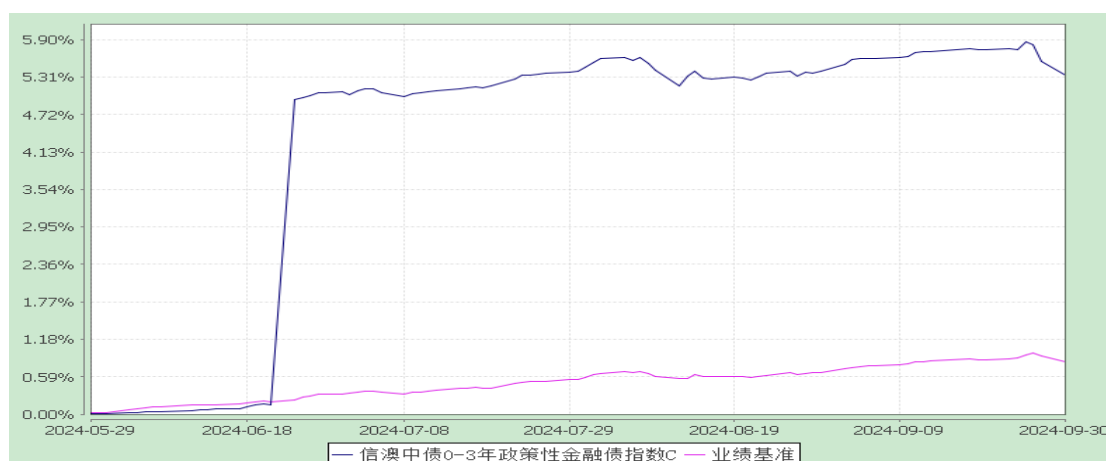
信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 5 月 29 日至 2024 年 9 月 30 日)



信澳中债 0-3 年政策性金融债指数 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 5 月 29 日至 2024 年 9 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2024 年 5 月 29 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§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		
赵琳婧	本基金的基金经理	2024-05-29	-	15 年	硕士。历任光大永明资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，泓德基金管理有限公司基金经理，招商信诺资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2023 年 4 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳汇享三个月定期开放债券基金基金经理（2023 年 6 月 7 日起至今）、信澳慧管家货币基金经理（2023 年 8 月 18 日起至今）、信澳悦享利率债基金基金经理（2023 年 12 月 7 日起至今）、信澳中债 0-3 年政策性金融债指数基金基金经理（2024 年 5 月 29 日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组

合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，外部环境变化带来的不确定性增多，美国大选及地缘政治风险存在较大变数。美联储降息 50BP 落地，人民币汇率贬值压力大幅缓解。国内方面，经济边际走弱，内需不足的问题仍未明显改善。出口数据高位回落，生产边际降温，固定资产投资和消费增速继续下行，地产投资维持低位，物价指数延续弱势。9 月底政治局会议对稳增长政策定调积极，使得基本面改善的预期升温，市场风险偏好大幅提升。

货币政策方面，三季度货币政策加大宏观调控力度，央行两度降低 7 天逆回购利率共 30BP，同时降准 50BP，释放长期资金约 1 万亿。央行持续丰富货币政策工具箱，设立临时隔夜正、逆回购工具，开展国债借入并卖出国债。在央行灵活适度、精准有效的货币政策指引下，三季度资金面整体较为平稳，市场利率中枢下移，流动性分层不大。

债券市场方面，三季度债市虽然大部分时间在偏弱的基本面和宽松的货币政策导向下仍然偏顺风，但受制于央行卖出国债、调查违规行为等较强的干预举措，出现多轮的调整和博弈。最终在 9 月底受政治局会议政策转向、悲观预期得到明显改善影响下，收益率出现快速上行。而前期利率品种收益下行过快，交易较为拥挤，调整幅度也较为明显，超长端利率单日跌幅达到历史极值。在此背景下，本产品净值亦出现了明显波动。

报告期内，本基金基本完成建仓，主要建仓品种为跟踪指数成分券，即剩余期限在 3 年以内的政金债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.0066 元，份额累计净值为 1.0066 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0535 元，份额累计净值为 1.0535 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

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	2,695,111,208.93	89.91
	其中：债券	2,695,111,208.93	89.91
	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	2,438,817.21	0.08
8	其他资产	300,056,283.33	10.01
9	合计	2,997,606,309.47	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境内股票。

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	61,891,711.96	2.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,633,219,496.97	97.70
	其中：政策性金融	2,633,219,496.97	97.70

	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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,695,111,208.93	100.00

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	09240202	24 国开清发 02	4,400,000	445,686,849.32	16.54
2	170215	17 国开 15	3,000,000	321,184,273.97	11.92
3	092018002	20 农发清发 02	2,600,000	268,946,136.99	9.98
4	220407	22 农发 07	2,600,000	265,018,712.33	9.83
5	170303	17 进出 03	2,000,000	215,151,506.85	7.98

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

本基金未参与投资股指期货。

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

本基金未参与投资国债期货。

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

本基金未参与投资国债期货。

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报告期内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报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金本报告期末无股票投资。

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	300,056,283.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,056,283.33

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不存在流通受限的情况。

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，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳中债0-3年政策性金融债 指数A	信澳中债0-3年政策性金融债 指数C
报告期期初基金份额总额	5,049,619,933.42	4,497,132.53
报告期期间基金总申购份额	991,374,967.98	17,990,144.50
减：报告期期间基金总赎回份 额	3,370,545,100.65	15,846,312.10
报告期期间基金拆分变动份 额	-	-
报告期期末基金份额总额	2,670,449,800.75	6,640,964.93

§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

基金管理人本报告期末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

基金管理人报告期末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

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	2024年07月05日-2024年09月29日	999,999,000.00	-	520,000,000.00	479,999,000.00	17.93%
产品特有风险							

- (1) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；
- (2) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的流动性风险；
- (3) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险；
- (4) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

二〇二四年十月二十四日