

# 富安达上海清算所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09月30日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:苏州银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月24日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	10
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

## §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。基金托管人苏州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	富安达上清所0-3年政金债指数
基金主代码	021563
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年06月20日
报告期末基金份额总额	2,324,582,321.15份
投资目标	本基金通过指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中具有代表性和流动性较好的证券，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。</p> <p>本基金主要以标的指数的成份券和备选成份券为基础，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。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0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整等其他因素，导致跟踪偏离度和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。</p> <p>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基金份额持有人利益优先的原则，</p>

	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	上海清算所0-3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	本基金为债券型指数基金，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	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达上清所0-3年政金 债指数A	富安达上清所0-3年政金 债指数C
下属分级基金的交易代码	021563	021564
报告期末下属分级基金的份额总 额	2,242,996,622.35份	81,585,698.80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07月01日 - 2024年09月30日)	
	富安达上清所0-3年政 金债指数A	富安达上清所0-3年政 金债指数C
1.本期已实现收益	13,786,417.69	879,620.20
2.本期利润	11,183,806.90	781,418.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0040
4.期末基金资产净值	2,255,475,150.69	82,014,553.56
5.期末基金份额净值	1.00556333	1.00525649

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

富安达上清所0-3年政金债指数A净值表现

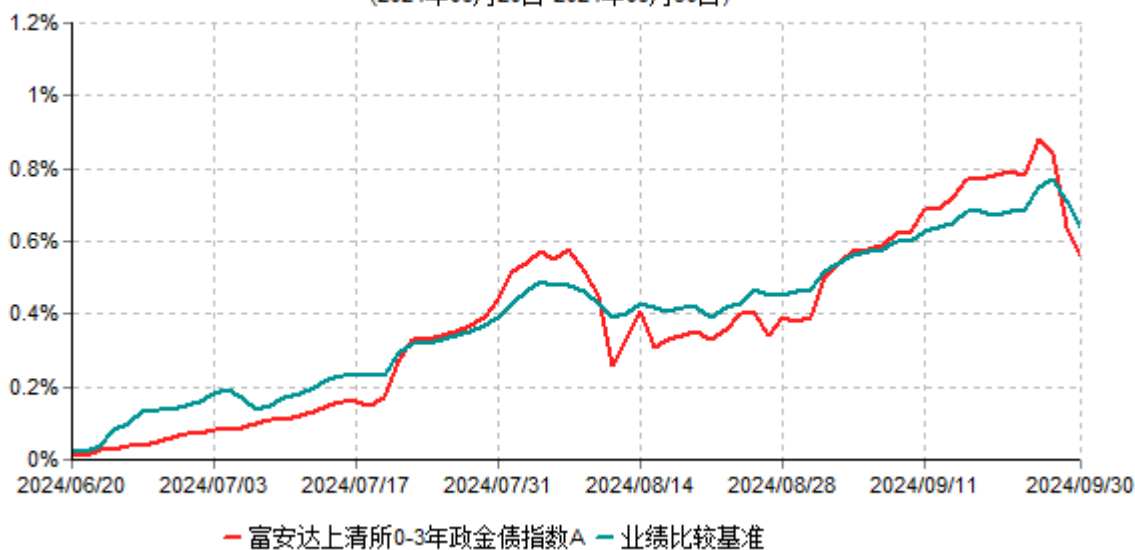
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.05%	0.50%	0.02%	0.00%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.56%	0.05%	0.64%	0.02%	-0.08%	0.03%

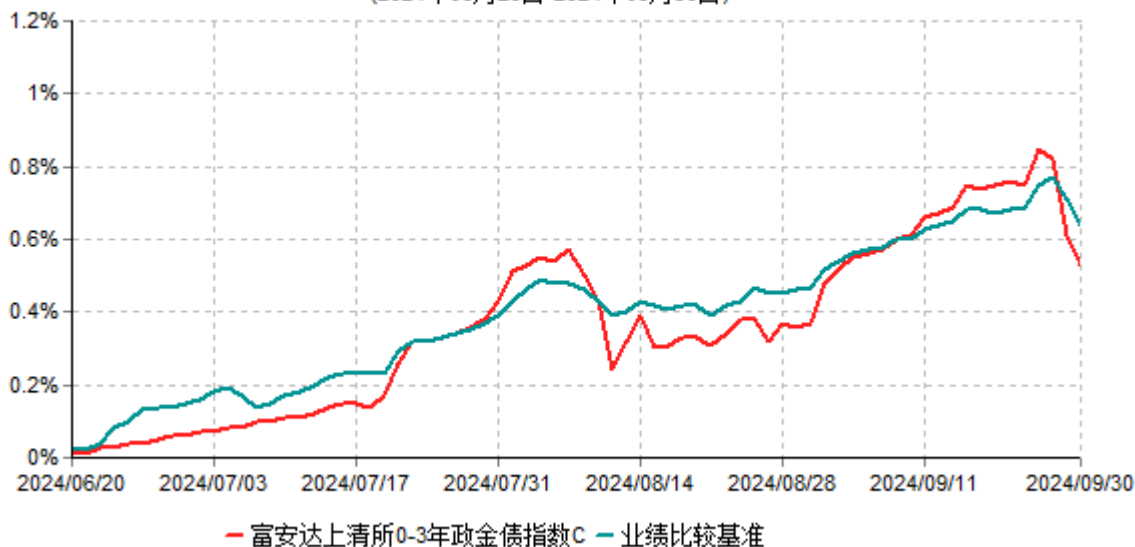
富安达上清所0-3年政金债指数C净值表现

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	0.47%	0.05%	0.50%	0.02%	-0.03%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.53%	0.05%	0.64%	0.02%	-0.11%	0.03%

### 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

富安达上清所0-3年政金债指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年06月20日-2024年09月30日)



富安达上清所0-3年政金债指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年06月20日-2024年09月30日)

注：①本基金《基金合同》生效日为2024年6月20日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2024年12月19日。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §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		
郑良海	本基金的基金经理	2024-06-20	-	12年	博士。历任上海电气电站集团订单项目处项目经理；山西证券股份有限公司宏观债券分析师；东兴证券股份有限公司债券高级分析师；财通基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员。2022年加入富安达基金管理有限公司，现任富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、

					富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------

注：

- ① 基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；
- ② 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内总需求总体仍较为偏弱，内生动力不强。一方面受暴雨、洪涝、高温等多重天气因素影响，另一方面上半年货币宽松、房地产、财政等稳增长政策尚待发挥效果。国内投资增速有所回落，消费仍需提振，出口保持较高速度增长，工业企业利润增速走低。市场期待稳增长政策进一步发力。三季度“7.30”和“9.26”两次中央政治

局会议聚力稳增长，房地产政策进一步放开，降低首付比和下调存量房贷利率；货币政策方面两度降息，一次全面降准；财政政策提速和加力，超长期特别国债落地使用加快，新增专项债发行提速，使用资本金范围研究扩大，加大超长期国债对“两新两重”的支持力度。央行在9月24日新闻发布会表示，年内还有降准空间，同时央行创设两项货币政策工具，支持非银金融机构互换便利和上市公司回购。海外来看，欧元区三季度两次降息，美联储9月降息50bp，为四年来首次降息，市场预期年内还将有50bp左右降息空间，英国等多国亦进入降息通道，全球主要经济体除日本外，均开启新一轮降息之旅。多国PMI环比回落，制造业和服务业分化，美国非农就业增速波动加大。央行三季度在债券市场出台多项政策，政策利率之锚由MLF转向7天OMO，增加临时正逆回购，构建短期利率走廊。央行亲自下场进行国债交易，总体看买短卖长，8月起央行开展了公开市场国债买卖操作，向部分公开市场业务一级交易商买入短期限国债并卖出长期国债，并加强对市场交易等监管。债券市场三季度收益率先下后上，在突破前低后，收益率中枢上移，信用利差走阔，新的化债政策和流动性风险偏好变化，对债券市场资产配置策略带来一定影响。央行货币政策委员会2024年第三季度例会中，提出“充实货币政策工具箱，开展国债买卖，关注长期收益率的变化”。

报告期内，本产品按照基金合同约定，以配置指数成份政金债为主，根据市场波动灵活调整仓位和久期，产品运行整体平稳。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达上清所0-3年政金债指数A基金份额净值为1.00556333元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.50%，同期业绩比较基准收益率为0.50%；截至报告期末富安达上清所0-3年政金债指数C基金份额净值为1.00525649元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.47%，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	1,496,257,907.54	63.98
	其中：债券	1,496,257,907.54	63.98



	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	841,110,743.90	35.97
	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	1,186,256.69	0.05
8	其他资产	200.00	0.00
9	合计	2,338,555,108.13	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 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投资。

### 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港股通投资的股票。

## 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投资。

## 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	1,496,257,907.54	64.01
	其中：政策性金融债	1,496,257,907.54	64.01
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	1,496,257,907.54	64.01

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

### 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	190406	19农发06	2,100,000	228,479,942.47	9.77
2	200204	20国开04	1,500,000	158,948,975.41	6.80
3	230305	23进出05	1,500,000	157,329,426.23	6.73
4	09230412	23农发清发12	1,300,000	130,758,986.30	5.59
5	230420	23农发20	1,000,000	107,402,049.18	4.59

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投资。

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  
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  
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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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	200.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	200.00

#### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达上清所0-3年政金 债指数A	富安达上清所0-3年政金 债指数C
报告期期初基金份额总额	5,242,353,863.86	697,645,475.72
报告期期间基金总申购份额	397,678,116.04	67,081,609.66
减：报告期期间基金总赎回份额	3,397,035,357.55	683,141,386.58
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	2,242,996,622.35	81,585,698.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### §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

单位：份

	富安达上清所0-3年政 金债指数A	富安达上清所0-3年政 金债指数C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	36,997,002.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00

报告期期末管理人持有的本基金份额	36,997,002.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.65	0.00

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。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。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §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	20240704-20240930	1,187,599,000.00	0.00	0.00	1,187,599,000.00	51.09%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

注：

- ① "申购份额"包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ② "赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2024年7月2日，富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告

2. 2024年7月3日，富安达基金管理有限公司关于富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金新增部分销售机构的公告

3. 2024年7月4日，富安达基金管理有限公司关于提高富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金份额净值精度的公告

4. 2024年7月6日，富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、基金转换业务的公告

5. 2024年7月11日，富安达基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告

6. 2024年9月25日，富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金国庆节前暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的公告

7. 2024年9月26日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金设立的文件：

《富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书》；

《富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》；

《富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

3、基金管理人业务资格批件和营业执照；

4、基金托管人业务资格批件和营业执照；

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司

2024年10月24日