

# 国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月20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及其更新。

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	国联中证同业存单AAA指数7天持有
基金主代码	016684
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年11月23日
报告期末基金份额总额	1,414,447,117.61份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	1、指数化投资策略 2、资产配置策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、证券公司短期公司债券投资策略
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。

基金管理人	国联基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

### §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07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	4,453,091.03
2.本期利润	3,576,004.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045
4.期末基金资产净值	1,443,034,647.18
5.期末基金份额净值	1.0202

注：1、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。

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

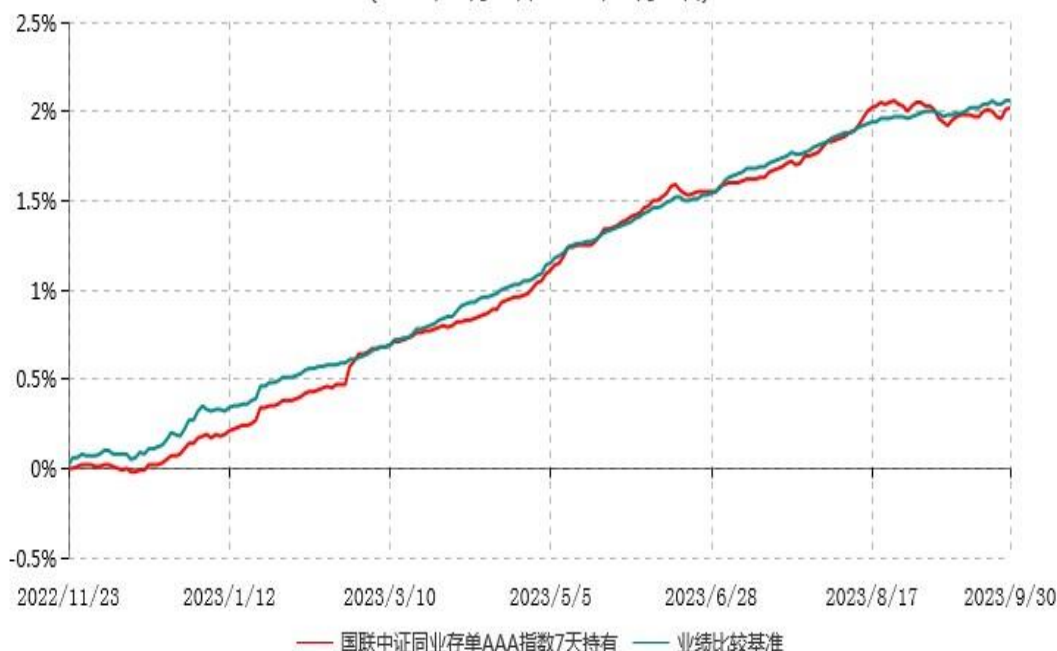
#### 3.2 基金净值表现

##### 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%	0.02%	0.48%	0.01%	-0.05%	0.01%
过去六个月	1.19%	0.02%	1.17%	0.01%	0.02%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.02%	0.02%	2.06%	0.01%	-0.04%	0.01%

##### 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

国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年11月23日-2023年09月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

## §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		
韩正宇	国联日日盈交易型货币市场基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、	2022-11-23	-	6	韩正宇先生，中国国籍，毕业于美国罗格斯新泽西州立大学金融分析专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限6年。2015年7月至2017年5月中国光大银行资产负债管理部流动性管理处流动性管理岗；2017年5月至2020年5月中国人保资产管理有限公司公募基金事业部固定

	国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。				收益交易员、基金经理助理。2020年5月加入公司，现任绝对收益部基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券投资基金从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所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5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度我国经济恢复继续波浪式发展，房地产政策有所调整，各项稳经济政策稳步推进。受政府债券供给增加等因素影响，月末季末资金面波动加大。债市整体呈现偏弱

震荡格局，收益率曲线平坦化。1年期国开债收益率上行16bp至2.26%，5年期国开债收益率上行4bp至2.57%，10年期国开债收益率下行3bp至2.74%。

本基金密切跟踪指数，并根据申购赎回情况做好流动性管理。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联中证同业存单AAA指数7天持有基金份额净值为1.0202元，本报告期内，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%。

## §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	1,427,799,190.89	97.23
	其中：债券	1,427,799,190.89	97.23
	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	-	-
	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	1,062,549.37	0.07
8	其他资产	39,581,341.96	2.70
9	合计	1,468,443,082.22	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

注：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

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

### 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

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	16,749,214.11	1.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,630,858.10	4.20
	其中：政策性金融债	60,630,858.10	4.20
4	企业债券	30,727,720.55	2.13
5	企业短期融资券	91,800,825.13	6.36
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,227,890,573.00	85.09
9	其他	-	-
10	合计	1,427,799,190.89	98.94

#### 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	112302024	23工商银行CD024	1,000,000	99,578,432.00	6.90
2	112305149	23建设银行CD149	1,000,000	98,237,239.34	6.81
3	112396499	23宁波银行CD058	500,000	49,357,743.17	3.42
4	112310203	23兴业银行CD203	500,000	49,093,778.69	3.40
5	112311102	23平安银行CD102	500,000	49,083,725.68	3.40

#### 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

无。

## 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

无。

### 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

无。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内基金投资的前十名证券除中国工商银行股份有限公司,中国建设银行股份有限公司,兴业银行股份有限公司,平安银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国农业银行股份有限公司,江苏银行股份有限公司,上海银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未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。中国银行间市场交易商协会2023年04月04日发布对中国工商银行股份有限公司开展立案调查,北京市通信管理局2023年01月30日发布对中国建设银行股份有限公司的处罚,银保监会2023年02月16日发布对中国建设银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字〔2023〕10号),中国银行间市场交易商协会2023年05月11日发布对中国建设银行股份有限公司开展立案调查,中国银行间市场交易商协会2023年01月18日发布对兴业银行股份有限公司的处罚,福建证监局2023年05月08日发布对兴业银行股份有限公司的处罚(政监管措施决定书[2023]18号),银保监会2023年02月16日发布对中国银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字〔2023〕5号),中国银行保险监督管理委员会重庆监管局2022年12月29日发布对中国银行股份有限公司的处罚(渝银保监罚决字(2022)45号),央行2023年07月07日发布对平安银行股份有限公司的处罚(银罚决字[2023]55号),国家金融监督管理总局2023年08月15日发布对中国农业银行股份有限公司的处罚(金罚决字[2023]8号),江苏证监局2022年12月05日发布对江苏银行股份有限公司的处罚(江苏证监局[2022]114号),



中国银行间市场交易商协会2023年01月18日发布对江苏银行股份有限公司的处罚,央行2023年02月06日发布对江苏银行股份有限公司的处罚(银罚决字〔2023〕1号),国家外汇管理局上海市分局2023年04月21日发布对上海银行股份有限公司的处罚(上海汇管罚字〔2023〕3111221101号),国家金融监督管理总局江苏监管局2023年08月10日发布对江苏银行股份有限公司的处罚(苏金罚决字[2023]2号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

**5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选库股票。**

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,024.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,570,317.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	39,581,341.96

### 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

### 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,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,290,237,989.61
报告期期间基金总申购份额	2,617,375,725.49
减:报告期期间基金总赎回份额	2,493,166,597.49
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	1,414,447,117.61
-------------	------------------

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期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：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

### §9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金注册的批复文件

(2) 《国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》

(3) 《国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》

(4) 关于申请募集中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金之法律意见

(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) 中国证监会要求的其他文件

#### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

#### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com>

国联基金管理有限公司

**2023年10月24日**