

安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：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 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。

基金托管人招商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	安信 60 天滚动持有债券
基金主代码	021332
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 18 日
报告期末基金份额总额	158,069,887.03 份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、久期配置策略 本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入研究，分析宏观经济运行的可能情景。</p> <p>2、收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。</p> <p>3、骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。</p> <p>4、息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>5、类属配置策略 类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。</p> <p>6、个券选择策略 本基金在综合考虑上述配置原则基础上，通过对个体券种的价值分</p>

	析，重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级，选择相应的最优投资对象。 7、信用债投资策略（含资产支持证券） 本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。	
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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	
下属分级基金的基金简称	安信 60 天滚动持有债券 A	安信 60 天滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	021332	021347
报告期末下属分级基金的份额总额	5,918,447.60 份	152,151,439.43 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）	
	安信 60 天滚动持有债券 A	安信 60 天滚动持有债券 C
1. 本期已实现收益	45,382.60	1,749,483.74
2. 本期利润	37,468.35	1,403,522.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.0060
4. 期末基金资产净值	5,957,965.22	153,078,960.94
5. 期末基金份额净值	1.0067	1.0061

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、本基金基金合同生效日为 2024 年 6 月 18 日，截至本报告末本基金合同生效未满一年。

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

安信 60 天滚动持有债券 A

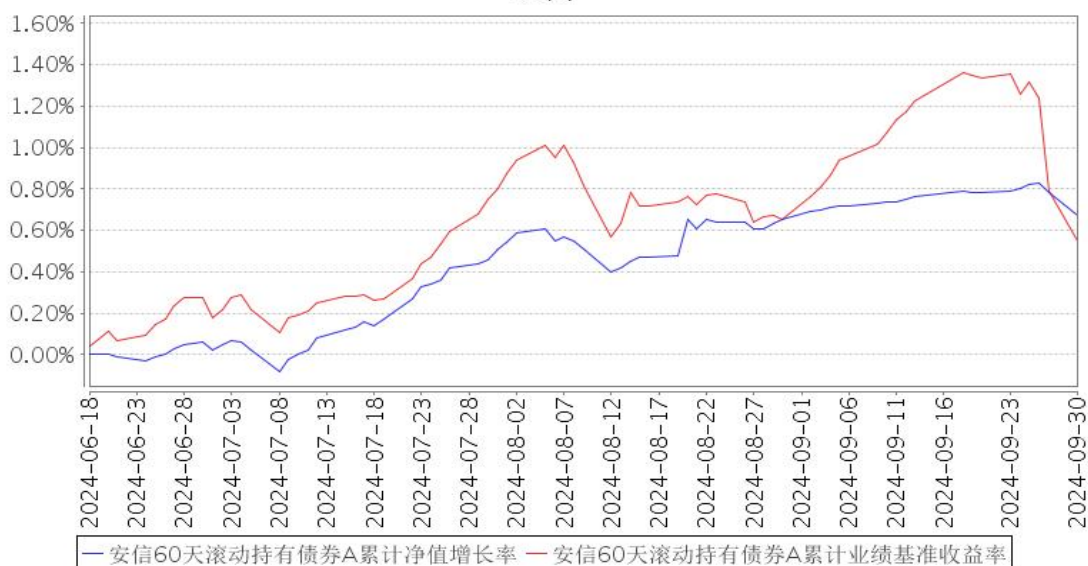
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.61%	0.04%	0.27%	0.09%	0.34%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.67%	0.04%	0.55%	0.09%	0.12%	-0.05%

安信 60 天滚动持有债券 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	0.56%	0.04%	0.27%	0.09%	0.29%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.61%	0.04%	0.55%	0.09%	0.06%	-0.05%

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60天滚动持有债券A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



安信60天滚动持有债券C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 2024 年 6 月 18 日，截至本报告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。截至本报告期末，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		
黄晓宾	本基金的基金经理	2024年6月18日	-	18年	黄晓宾先生，经济学硕士，历任中信银行股份有限公司金融市场部投资经理，东兴证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳双利3个月持有期混合型证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信60天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。
宛晴	本基金的基金经理	2024年7月8日	-	11年	宛晴女士，工商管理硕士，历任东兴证券股份有限公司资产管理业务总部交易员、交易主管、投资经理助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信浩盈6个月持有期混合型证

				券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理；安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型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合规守信情况的说明

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

三季度国内经济延续弱修复态势，固定资产投资和消费增速继续下行。受需求端较弱影响，生产也有所放缓。整体来看三季度内内需较弱的格局延续，政策对三季度经济的提振作用有限。

7 月份以来，经济基本面延续弱修复态势，货币政策方面央行下调政策利率，债券收益率持续下行。央行在多次提示长债下行过快风险之后，在 8 月进行长期限国债卖出操作，债券市场出现短暂调整，随后经济基础面走弱债券收益率重拾下行趋势季末有所上行。信用利差季末也有所走阔。

货币政策方面，央行三季度进行两次降息一次降准，继续坚定支持性的货币政策立场，表示将要加大货币政策调控力度，提高货币政策调控精准性。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，促进物价保持在合理水平；整体看货币政策总量仍维持宽松趋势。

本基金三季度以中高评级信用债为主，季末适度降低债券仓位，维持短久期高流动性的组合结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信 60 天滚动持有债券 A 基金份额净值为 1.0067 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.61%；安信 60 天滚动持有债券 C 基金份额净值为 1.0061 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.56%；同期业绩比较基准收益率为 0.27%。

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	123,703,408.34	77.72
	其中：债券	123,703,408.34	77.72
	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	33,226,127.56	20.88
	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	2,208,639.80	1.39
8	其他资产	18,427.45	0.01
9	合计	159,156,603.15	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	8,771,711.15	5.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	67,363,994.44	42.36
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	37,565,694.53	23.62
6	中期票据	10,002,008.22	6.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,703,408.34	77.78

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	212380022	23 华夏银行债 04	100,000	10,393,830.60	6.54
2	042380592	23 三门峡 CP004	100,000	10,304,295.08	6.48
3	240517	24 兴业 01	100,000	10,263,547.40	6.45
4	240519	24 信投 G1	100,000	10,240,637.26	6.44

5	115448	23 中金 G3	100,000	10,175,597.81	6.40
---	--------	----------	---------	---------------	------

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

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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 24 兴业 01(代码: 240517 SH)、24 信投 G1(代码: 240519 SH)、23 中金 G3(代码: 115448 SH)、22 广发 04(代码: 148009 SZ)、23 中证 15(代码: 115780 SH) 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. 兴业证券股份有限公司

2023 年 11 月 14 日，兴业证券股份有限公司因未依法履行职责被合肥经济技术开发区财政局列入不良行为记录名单。

2024 年 3 月 7 日，兴业证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被北京证券交易所要求提交书

面承诺。

2024 年 8 月 2 日，兴业证券股份有限公司因内部制度不完善被国家金融监督管理总局福建监管局出具警示函。

2. 中信建投证券股份有限公司

2023 年 10 月 13 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会北京监管局出具警示函。

2023 年 11 月 6 日，中信建投证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局北京市分局罚款。

2024 年 1 月 3 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 1 月 24 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会山东监管局出具警示函。

2024 年 4 月 30 日，中信建投证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会北京监管局责令合规检查与报告；因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函。

2024 年 5 月 15 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所警示。

2024 年 5 月 17 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函。

2024 年 6 月-9 月，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所警示、书面警示、限期改正、要求提交书面承诺。

3. 中国国际金融股份有限公司

2024 年 1 月 8 日，中国国际金融股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会出具警示函。

2024 年 1 月 18 日，中国国际金融股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函。

2024 年 4 月-5 月，中国国际金融股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会北京监管局出具警示函、责令改正、责令合规检查与报告。

2024 年 5 月 29 日，中国国际金融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自律调查。

2024 年 8 月 23 日，中国国际金融股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 9 月 30 日，中国国际金融股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会北京监管局出具警示函。

4. 广发证券股份有限公司

2023 年 10 月—2024 年 5 月，广发证券股份有限公司多次因欠税、未按期申报税款被国家税务总局广州市天河区税务局天河南税务所责令改正。

2023 年 12 月 27 日，广发证券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。

2024 年 3 月 22 日，广发证券股份有限公司因内部制度不完善被上海证券交易所警示。

5. 中信证券股份有限公司

2024 年 1 月 12 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管警示。

2024 年 4 月 13 日，中信证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2024 年 4 月 19 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会罚款、没收违法所得。

2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 5 月 10 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函。

2024 年 8 月 7 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会贵州监管局出具警示函。

2024 年 8 月 26 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证券交易所出具警示函。

2024 年 8 月 29 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会出具警示函。

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	18,427.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,427.45

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

项目	安信 60 天滚动持有债券 A	安信 60 天滚动持有债券 C
报告期期初基金份额总额	6,252,115.99	292,969,415.99
报告期期间基金总申购份额	23,772.15	3,304,371.75
减：报告期期间基金总赎回份额	357,440.54	144,122,348.31
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	5,918,447.60	152,151,439.43

§ 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 60 天滚动持有债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

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 10 月 24 日