

# 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 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

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 1         |
| 1.2 目录                                  | 2         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>4</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 4         |
| 2.2 基金产品说明                              | 4         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 4         |
| 2.4 信息披露方式                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 5         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>5</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 5         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 7.6 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      | 41        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 41        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.8 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贵金属投资明细 ..... | 41        |
| 7.9 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 .....    | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 42        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 45        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>48</b> |
| 11.1 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 .....    | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                  |
|-----------------|----------------------|------------------|
| 基金名称            | 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 安信 90 天滚动持有债券        |                  |
| 基金主代码           | 020391               |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                  |
| 基金合同生效日         | 2024 年 1 月 17 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           |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 239,479,641.40 份     |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 安信 90 天滚动持有债券 A      | 安信 90 天滚动持有债券 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 020391               | 020392           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 32,386,173.16 份      | 207,093,468.24 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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   | 本基金综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、类属配置策略、个券选择策略、信用债投资策略、国债期货投资策略、可转换和可交换债券投资策略等策略。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。            |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%   |
| 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。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人          | 基金托管人                   |
|---------|----------------|-------------------------|
| 名称      | 安信基金管理有限责任公司   | 招商银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名             | 孙晓奇                     |
|         | 联系电话           | 0755-82509999           |
|         | 电子邮箱           | service@essencefund.com |
| 客户服务电话  | 4008-088-088   | 400-61-95555            |
| 传真      | 0755-82799292  | 0755-83195201           |
| 注册地址    | 深圳市福田区福田街道福安社区 | 深圳市深南大道 7088 号招商银       |

|       |  |                      |
|-------|--|----------------------|
|       | 福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼                  | 行大厦                  |
| 办公地址  | 深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 518026                                 | 518040               |
| 法定代表人 | 刘入领                                    | 缪建民                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.essencefund.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所       |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                                |
|--------|--------------|-------------------------------------|
| 注册登记机构 | 安信基金管理有限责任公司 | 深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）-2024 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|--|-----------------|
|               | 安信 90 天滚动持有债券 A                          | 安信 90 天滚动持有债券 C |
| 本期已实现收益       | 781,971.56                               | 6,153,681.19    |
| 本期利润          | 922,251.94                               | 8,194,647.80    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0260                                   | 0.0251          |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.56%                                    | 2.48%           |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.59%                                    | 2.49%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                    |                 |
| 期末可供分配利润      | 727,840.78                               | 4,451,168.93    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0225                                   | 0.0215          |
| 期末基金资产净值      | 33,225,202.33                            | 212,257,894.26  |
| 期末基金份额净值      | 1.0259                                   | 1.0249          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                    |                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 2.59%                                    | 2.49%           |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同生效日为 2024 年 1 月 17 日，截至报告期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 90 天滚动持有债券 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.40%    | 0.02%       | 0.55%      | 0.02%         | -0.15% | 0.00% |
| 过去三个月      | 1.51%    | 0.06%       | 0.92%      | 0.05%         | 0.59%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.59%    | 0.05%       | 1.94%      | 0.05%         | 0.65%  | 0.00% |

安信 90 天滚动持有债券 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.38%    | 0.02%       | 0.55%      | 0.02%         | -0.17% | 0.00% |
| 过去三个月      | 1.46%    | 0.06%       | 0.92%      | 0.05%         | 0.54%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.49%    | 0.05%       | 1.94%      | 0.05%         | 0.55%  | 0.00% |

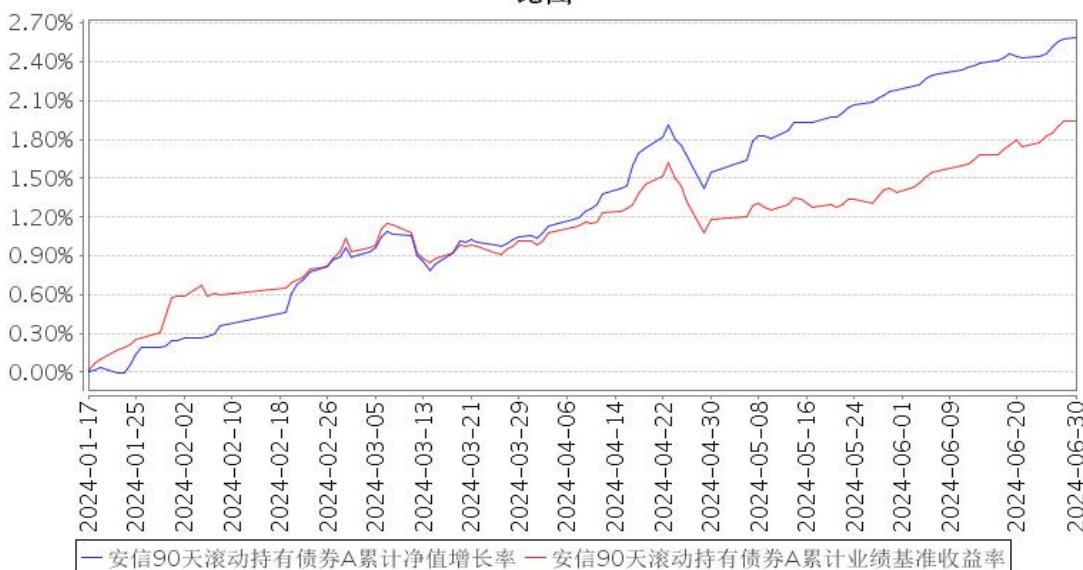
注：根据《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率（税后）\*20%。中债综合全价（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。一年期定期存款利率（税后）为中国人民银行公开发布，具有较强的权威性和市场影响力。根据本基金

的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

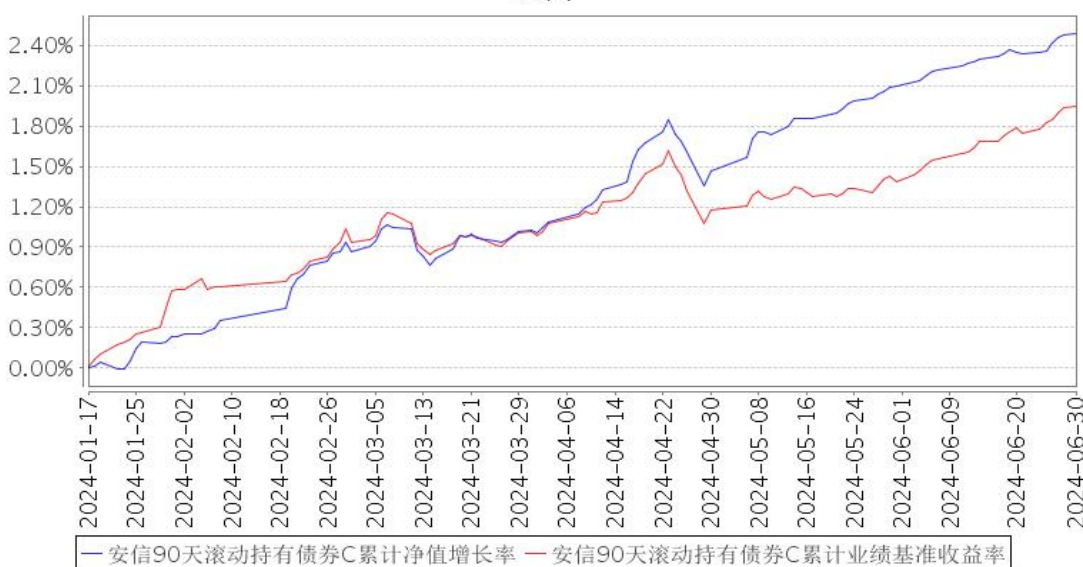
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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90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90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 1 月 17 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，国投证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置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、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报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、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值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、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持

有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债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、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期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、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选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、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务              | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|-----------------|-----------------|------|--------|--|
|    |                 | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 张睿 | 本基金的基金经理，固定收益部总 | 2024 年 1 月 17 日 | -    | 17 年   | 张睿先生，经济学硕士，历任中国农业银行股份有限公司金融市场部产品经理、交易员，中信银行股份有限公司资金资本市场部投资经理，安信基金管理有限责任公 |

|    |            |                 |   |      |  |
|----|------------|-----------------|---|------|--|
|    | 经理         |                 |   |      | 司固定收益部投资经理，暖流资产管理股份有限公司固定收益部总经理，东兴证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理兼固收总监。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、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 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的基金经理。   |
| 宛晴 | 本基金的基金经理助理 | 2024 年 1 月 24 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的基金经理。 |

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”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。

#### 4.1.3 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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年国内经济延续弱修复态势，内生动能呈现结构分化，生产端强于需求端，制造业强于服务业。人民币汇率持续贬值，期间多数宏观指标低于市场预期。海外方面，全球经济较 2023 年有所修复，美国经济韧性和通胀粘性均超市场预期，美联储降息预期延后，欧央行率先开启降息。国内方面，受全球制造业回暖、外需修复先于内需的影响，上半年我国出口增速超预期，制造业投资保持高速增长，二者对经济的拉动有所上升。基建投资同比增速持续放缓，主要受新增专项债发行进度较慢、房地产低迷和地方财政支出减弱影响；房地产投资继续寻底，二季度多部委推出政策“组合拳”，多地密集跟进“517”新政，但销售未见明显起色，政策效果仍待观察。消费维持温和复苏，结构上呈现服务消费快于商品消费。融资端，上半年社融增量和新增人民币贷款显著回落，总量和结构均偏弱，主要受融资需求不足、金融“挤水分”的影响。

债券方面，上半年受政府债发行节奏偏慢、存款“搬家”推助非银产品规模高增、股市情绪带动风险偏好下降和机构交易行为等多重因素的推动，债券收益率大幅下行，信用利差持续收窄。期间 10 年及以上期限国债突破历史低位，央行屡次发声提示长债风险，并公告将开展国债借入操

作。债券收益率曲线年初以来先经历大幅平坦化下行，之后在央行引导下趋于陡峭化。权益方面，上半年万得全 A 指数下跌 8.01%，股指分化加剧，大盘相对小盘占优，价值相对成长占优。行业方面，以银行、煤炭、公用事业、家用电器、交通运输为代表的高股息行业涨幅居前，其他多数行业上半年收益为负。转债市场上半年经历震荡行情，去年底小幅下跌。随着新“国九条”发布，严监管背景下退市新规再度升级，正股的退市门槛降低。期间年报问询和评级机构密集调降评级加剧了市场情绪恶化，低价转债经历流动性挤兑。上半年高评级、大市值的转债表现显著好于中低评级、中小市值的转债，绝大多数取得正收益。

报告期内，本基金完成了建仓操作，主要配置中高等级信用债和利率债获取票息收益，通过维持中高水平的杠杆比例，取得较为稳定的套息收益。4 月后逐步降低债券组合久期，6 月增加了利率债和同业存单的仓位，提高组合的杠杆水平，期间通过利率债波段交易增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信 90 天滚动持有债券 A 基金份额净值为 1.0259 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.59%；安信 90 天滚动持有债券 C 基金份额净值为 1.0249 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.49%；同期业绩比较基准收益率为 1.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国经济增长的动能或将放缓，美联储仍处于酝酿降息的过程，年内有望迎来首次降息。全球制造业有望继续复苏，支撑全球经济保持景气。国内经济复苏动能有望在政策托底下较上半年边际回升。出口方面，在外需支撑下预计保持韧性、动能较上半年边际走弱；投资方面，预计仍呈现分化，分化程度有望减弱，制造业投资维持较高增长，同时下半年财政进度加快将带动基建投资边际转好，地产投资或延续负增长、随着政策效果逐渐显现降幅有望收敛；消费方面，在刺激需求相关政策的促进下，下半年将保持温和回升。政策方面，预计货币政策整体中性偏宽松，财政政策有望加快落实，地方债发行较上半年提速。下半年债券收益率的中枢可能高于上半年，但持续大幅上行的风险较低。权益市场的悲观情绪有望改善，主要指数预计仍呈现震荡，关注结构性交易机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产

品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 821,688.06                     |
| 结算备付金         |            | 830,250.77                     |
| 存出保证金         |            | 262,022.45                     |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 284,037,427.05                 |
| 其中：股票投资       |            | -                              |
| 基金投资          |            | -                              |
| 债券投资          |            | 284,037,427.05                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                              |
| 贵金属投资         |            | -                              |
| 其他投资          |            | -                              |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              |
| 应收清算款         |            | -                              |
| 应收股利          |            | -                              |
| 应收申购款         |            | 679,005.00                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              |
| 资产总计          |            | 286,630,393.33                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |
| 短期借款          |            | -                              |
| 交易性金融负债       |            | -                              |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              |

|             |         |                |
|-------------|---------|----------------|
| 卖出回购金融资产款   |         | 40,572,668.45  |
| 应付清算款       |         | 400,065.92     |
| 应付赎回款       |         | -              |
| 应付管理人报酬     |         | 39,590.29      |
| 应付托管费       |         | 9,897.58       |
| 应付销售服务费     |         | 34,155.17      |
| 应付投资顾问费     |         | -              |
| 应交税费        |         | 6,840.96       |
| 应付利润        |         | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 84,078.37      |
| 负债合计        |         | 41,147,296.74  |
| <b>净资产：</b> |         |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 239,479,641.40 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 6,003,455.19   |
| 净资产合计       |         | 245,483,096.59 |
| 负债和净资产总计    |         | 286,630,393.33 |

注：1. 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 239,479,641.40 份，其中安信 90 天滚动持有债券 A 基金份额总额 32,386,173.16 份，基金份额净值 1.0259 元；安信 90 天滚动持有债券 C 基金份额总额 207,093,468.24 份，基金份额净值 1.0249 元。

2. 本基金合同生效日为 2024 年 01 月 17 日，无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 10,054,841.72                                   |
| 1. 利息收入           |          | 325,533.85                                      |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.9  | 108,229.84                                      |
| 债券利息收入            |          | -   |
| 资产支持证券利息收入        |          | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | 217,304.01                                      |
| 其他利息收入            |          | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 7,548,060.88                                    |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.10 | -   |
| 基金投资收益            |          | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.11 | 7,548,079.25                                    |
| 资产支持证券投资收益        | 6.4.7.12 | -   |



|                            |            |              |
|----------------------------|------------|--------------|
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.13   | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14   | -18.37       |
| 股利收益                       | 6.4.7.15   | -            |
| 其他投资收益                     |            | -            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16   | 2,181,246.99 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17   | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 937,941.98   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 331,059.90   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 82,765.00    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 298,611.50   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 136,282.29   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 136,282.29   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.18   | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 4,396.91     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 84,826.38    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 9,116,899.74 |
| 减：所得税费用                    |            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 9,116,899.74 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 9,116,899.74 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |        |               |                 |
|----------------------|---|--------|---------------|-----------------|
|                      | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产            | -   | -      | -             | -               |
| 二、本期期初净资产            | 476,661,434.30                                  | -      | -             | 476,661,434.30  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -237,181,792.90                                 | -      | 6,003,455.19  | -231,178,337.71 |
| （一）、综合收益总额           | -   | -      | 9,116,899.74  | 9,116,899.74    |
| （二）、本期基              | -237,181,792.90                                 | -      | -3,113,444.55 | -240,295,237.45 |

|  |                 |   |               |                 |
|--|-----------------|---|---------------|-----------------|
| 基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）            |                 |   |               |                 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 52,120,772.39   | - | 920,775.21    | 53,041,547.60   |
| 2. 基金赎回款                                 | -289,302,565.29 | - | -4,034,219.76 | -293,336,785.05 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -               | - | -             | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 239,479,641.40  | - | 6,003,455.19  | 245,483,096.59  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 刘入领      | 廖维坤       | 苗杨      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2781 号《关于准予安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,549,138.66 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0008 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 476,661,434.30 份，其中认购资金利息折合 112,295.64 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日或基金份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 90 天（即第一个运作期到期日，

如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止，以此类推。在每份基金份额的每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。在每份基金份额的每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该基金份额将自该运作期到期日下一日起自动进入下一个运作期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因可转换债券转股、可交换债券换股所形成的股票。因上述原因持有的股票等资产，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）起至 2024 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合

企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生

的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的



指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 821,688.06             |
| 等于：本金          | 821,629.35             |
| 加：应计利息         | 58.71                  |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 821,688.06             |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |                |              |                |              |
|---------------|------------------------|----------------|--------------|----------------|--------------|
|               | 成本                     | 应计利息           | 公允价值         | 公允价值变动         |              |
| 股票            | -                      | -              | -            | -              |              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -            | -              |              |
| 债券            | 交易所市场                  | 86,153,440.59  | 987,863.11   | 88,061,229.61  | 919,925.91   |
|               | 银行间市场                  | 193,065,128.92 | 1,497,647.44 | 195,976,197.44 | 1,413,421.08 |
|               | 合计                     | 279,218,569.51 | 2,485,510.55 | 284,037,427.05 | 2,333,346.99 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -            | -              |              |

|    |                |              |                |              |
|----|----------------|--------------|----------------|--------------|
| 基金 | -              | -            | -              | -            |
| 其他 | -              | -            | -              | -            |
| 合计 | 279,218,569.51 | 2,485,510.55 | 284,037,427.05 | 2,333,346.99 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2024年6月30日 |      |    | 备注 |
|-----------|-------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额       | 公允价值 |    |    |
|           |                   | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -6,420,300.00     | -    | -  | -  |
| 其中：国债期货投资 | -6,420,300.00     | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 合计        | -6,420,300.00     | -    | -  | -  |

注：衍生金融资产项下的国债期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称             | 持仓量（买/卖） | 合约市值          | 公允价值变动      |
|------------|----------------|----------|---------------|-------------|
| TL2409     | 30年期国债<br>2409 | -5.00    | -5,480,000.00 | -135,900.00 |
| TL2412     | 30年期国债<br>2412 | -1.00    | -1,092,400.00 | -16,200.00  |
| 合计         |                |          |               | -152,100.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |                |          |               | -152,100.00 |
| 净额         |                |          |               | -           |

注：（1）衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 13,120.99         |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 13,120.99         |
| 应付利息        | -                 |
| 应付信息披露费     | 52,172.14         |
| 应付审计费       | 9,485.24          |
| 应付银行间账户维护费  | 9,300.00          |
| 合计          | 84,078.37         |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信 90 天滚动持有债券 A

| 项目            | 本期<br>2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |               |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                              | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 37,993,342.85                        | 37,993,342.85 |
| 本期申购          | 1,143,960.07                         | 1,143,960.07  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,751,129.76                        | -6,751,129.76 |
| 本期末           | 32,386,173.16                        | 32,386,173.16 |

##### 安信 90 天滚动持有债券 C

| 项目      | 本期<br>2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |                |
|---------|--------------------------------------|----------------|
|         | 基金份额（份）                              | 账面金额           |
| 基金合同生效日 | 438,668,091.45                       | 438,668,091.45 |
| 本期申购    | 50,976,812.32                        | 50,976,812.32  |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -282,551,435.53 | -282,551,435.53 |
| 本期末           | 207,093,468.24  | 207,093,468.24  |

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信 90 天滚动持有债券 A

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|------------|------------|
| 基金合同生效日        | -          | -          | -          |
| 本期期初           | -          | -          | -          |
| 本期利润           | 781,971.56 | 140,280.38 | 922,251.94 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -54,130.78 | -29,091.99 | -83,222.77 |
| 其中：基金申购款       | 10,360.88  | 3,635.72   | 13,996.60  |
| 基金赎回款          | -64,491.66 | -32,727.71 | -97,219.37 |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -          |
| 本期末            | 727,840.78 | 111,188.39 | 839,029.17 |

安信 90 天滚动持有债券 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -             | -             |
| 本期期初           | -             | -             | -             |
| 本期利润           | 6,153,681.19  | 2,040,966.61  | 8,194,647.80  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,702,512.26 | -1,327,709.52 | -3,030,221.78 |
| 其中：基金申购款       | 868,503.00    | 38,275.61     | 906,778.61    |
| 基金赎回款          | -2,571,015.26 | -1,365,985.13 | -3,937,000.39 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 4,451,168.93  | 713,257.09    | 5,164,426.02  |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期  |
|-----------|---|
|           | 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 21,216.99                                 |
| 定期存款利息收入  | -   |
| 其他存款利息收入  | -   |
| 结算备付金利息收入 | 86,852.25                                 |
| 其他        | 160.60                                    |
| 合计        | 108,229.84                                |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金于本期无股票投资收益。

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,601,842.38                         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,946,236.87                         |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                                    |
| 合计                           | 7,548,079.25                         |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 632,789,291.10                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 624,061,204.98                       |
| 减：应计利息总额               | 4,761,312.09                         |
| 减：交易费用                 | 20,537.16                            |
| 买卖债券差价收入               | 3,946,236.87                         |

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|----------|--------------------------------------|
| 国债期货投资收益 | -18.37                               |

### 6.4.7.15 股利收益

本基金于本期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产             | 2,333,346.99                                    |
| 股票投资                   | -   |
| 债券投资                   | 2,333,346.99                                    |
| 资产支持证券投资               | -   |
| 基金投资                   | -   |
| 贵金属投资                  | -   |
| 其他                     | -   |
| 2. 衍生工具                | -152,100.00                                     |
| 权证投资                   | -   |
| 期货投资                   | -152,100.00                                     |
| 3. 其他                  | -   |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -   |
| 合计                     | 2,181,246.99                                    |

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金于本期无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------|---|
| 审计费用     | 9,485.24  |
| 信息披露费    | 52,172.14                                       |
| 证券出借违约金  | -   |
| 银行汇划费用   | 8,869.00  |
| 银行间账户维护费 | 13,900.00                                       |
| 其他       | 400.00  |
| 合计       | 84,826.38                                       |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系         |
|----------------------|-----------------|
| 安信基金管理有限责任公司（“安信基金”） | 基金管理人、注册登记机构    |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）   | 基金托管人、基金销售机构    |
| 国投证券股份有限公司（“国投证券”）   | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 五矿资本控股有限公司           | 基金管理人的股东        |
| 中广核财务有限责任公司          | 基金管理人的股东        |
| 佛山市顺德区新碧贸易有限公司       | 基金管理人的股东        |
| 安信乾盛财富管理（深圳）有限公司     | 基金管理人的子公司       |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 331,059.90                                      |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 164,973.74                                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 166,086.16                                      |



注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期  |
|----------------|---|
|                | 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 82,765.00                                 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期  |                 |            |
|----------------|---|-----------------|------------|
|                | 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |                 |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |                 |            |
|                | 安信 90 天滚动持有债券 A                           | 安信 90 天滚动持有债券 C | 合计         |
| 国投证券           | -   | 7.92            | 7.92       |
| 招商银行           | -   | 298,457.95      | 298,457.95 |
| 合计             | -   | 298,465.87      | 298,465.87 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |           |
|-------|---|-----------|
|       | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 招商银行  | 821,688.06                                      | 21,216.99 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,572,668.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称       | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|--------|------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 230027 | 23 付息国债 27 | 2024 年 7 月 1 日 | 102.33 | 107,000 | 10,948,973.80 |
| 240006 | 24 付息国债 06 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.71 | 160,000 | 16,273,946.30 |
| 240205 | 24 国开 05   | 2024 年 7 月 1 日 | 103.94 | 160,000 | 16,630,002.19 |
| 合计     |            |                |        | 427,000 | 43,852,922.29 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制

在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 82.17%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | -                      |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | 39,806,379.18          |
| 合计     | 39,806,379.18          |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | -                      |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | 19,719,010.26          |
| 合计     | 19,719,010.26          |

注：1. 同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| AAA    | 100,610,153.55         |
| AAA 以下 | 12,195,295.57          |
| 未评级    | 111,706,588.49         |
| 合计     | 224,512,037.61         |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基

金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息        | 合计             |
|------------------------|---------------|----------------|---------------|------------|----------------|
| 资产                     |               |                |               |            |                |
| 货币资金                   | 821,688.06    | -              | -             | -          | 821,688.06     |
| 结算备付金                  | 830,250.77    | -              | -             | -          | 830,250.77     |
| 存出保证金                  | 262,022.45    | -              | -             | -          | 262,022.45     |
| 交易性金融资产                | 78,451,965.01 | 152,041,844.97 | 53,543,617.07 | -          | 284,037,427.05 |
| 应收申购款                  | -             | -              | -             | 679,005.00 | 679,005.00     |
| 资产总计                   | 80,365,926.29 | 152,041,844.97 | 53,543,617.07 | 679,005.00 | 286,630,393.33 |
| 负债                     |               |                |               |            |                |
| 应付管理人报酬                | -             | -              | -             | 39,590.29  | 39,590.29      |
| 应付托管费                  | -             | -              | -             | 9,897.58   | 9,897.58       |
| 应付清算款                  | -             | -              | -             | 400,065.92 | 400,065.92     |
| 卖出回购金融资产款              | 40,572,668.45 | -              | -             | -          | 40,572,668.45  |
| 应付销售服务费                | -             | -              | -             | 34,155.17  | 34,155.17      |
| 应交税费                   | -             | -              | -             | 6,840.96   | 6,840.96       |
| 其他负债                   | -             | -              | -             | 84,078.37  | 84,078.37      |
| 负债总计                   | 40,572,668.45 | -              | -             | 574,628.29 | 41,147,296.74  |
| 利率敏感度缺口                | 39,793,257.84 | 152,041,844.97 | 53,543,617.07 | 104,376.71 | 245,483,096.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末（2024 年 6 月 30 日）        |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 2,037,699.48                |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -2,005,501.07               |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 8,370,432.01           |
| 第二层次          | 275,666,995.04         |
| 第三层次          | -                      |
| 合计            | 284,037,427.05         |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。



#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 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            | 284,037,427.05 | 99.10         |
|    | 其中：债券             | 284,037,427.05 | 99.10         |
|    | 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      | 1,651,938.83   | 0.58          |
| 8  | 其他各项资产            | 941,027.45     | 0.33          |
| 9  | 合计                | 286,630,393.33 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 49,473,959.51  | 20.15         |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 101,581,637.86 | 41.38         |
|    | 其中：政策性金融债 | 32,854,144.43  | 13.38         |
| 4  | 企业债券      | 22,497,190.77  | 9.16          |
| 5  | 企业短期融资券   | 36,359,451.23  | 14.81         |
| 6  | 中期票据      | 46,035,745.41  | 18.75         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 8,370,432.01   | 3.41          |
| 8  | 同业存单      | 19,719,010.26  | 8.03          |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 284,037,427.05 | 115.71        |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 112415252 | 24 民生银行 CD252 | 200,000 | 19,719,010.26 | 8.03          |
| 2  | 240205    | 24 国开 05      | 160,000 | 16,630,002.19 | 6.77          |
| 3  | 240006    | 24 付息国债 06    | 160,000 | 16,273,946.30 | 6.63          |
| 4  | 042480195 | 24 包钢集 CP002  | 150,000 | 15,143,502.74 | 6.17          |
| 5  | 230027    | 23 付息国债 27    | 140,000 | 14,325,760.11 | 5.84          |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本期通过国债期货对持仓的长久期债券进行套期保值，符合既定的投资策略和投资目标。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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 民生银行 CD252（代码：112415252 CY）、24 包钢集 CP002（代码：042480195 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 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. 包头钢铁(集团)有限责任公司

2023 年 9 月 14 日，包头钢铁(集团)有限责任公司因未依法履行职责被包头市水务局罚款。

2023 年 11 月-12 月，包头钢铁(集团)有限责任公司因大气污染防治类、超标排放污染物被包头市生态环境局昆都仑区分局罚款。

2023 年 12 月 19 日，包头钢铁(集团)有限责任公司因未依法履行职责被包头市水务局罚款。

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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 262,022.45 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 679,005.00 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 941,027.45 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|--------------|---------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债    | 2,205,507.40 | 0.90          |
| 2  | 113052 | 兴业转债    | 1,731,482.74 | 0.71          |
| 3  | 113053 | 隆 22 转债 | 1,256,616.90 | 0.51          |
| 4  | 113042 | 上银转债    | 1,148,102.42 | 0.47          |
| 5  | 127024 | 盈峰转债    | 1,066,657.53 | 0.43          |
| 6  | 113048 | 晶科转债    | 378,027.40   | 0.15          |
| 7  | 123204 | 金丹转债    | 58,252.37    | 0.02          |
| 8  | 127032 | 苏行转债    | 37,710.90    | 0.02          |
| 9  | 127035 | 濮耐转债    | 37,325.01    | 0.02          |
| 10 | 113549 | 白电转债    | 35,879.85    | 0.01          |
| 11 | 113068 | 金铜转债    | 33,206.45    | 0.01          |
| 12 | 123208 | 孩王转债    | 32,491.46    | 0.01          |
| 13 | 127074 | 麦米转 2   | 32,374.63    | 0.01          |
| 14 | 113602 | 景 20 转债 | 27,622.49    | 0.01          |
| 15 | 110068 | 龙净转债    | 26,818.12    | 0.01          |
| 16 | 113669 | 景 23 转债 | 26,465.29    | 0.01          |
| 17 | 113674 | 华设转债    | 25,715.37    | 0.01          |
| 18 | 127086 | 恒邦转债    | 24,837.33    | 0.01          |
| 19 | 113658 | 密卫转债    | 24,365.12    | 0.01          |
| 20 | 113065 | 齐鲁转债    | 22,799.52    | 0.01          |
| 21 | 113056 | 重银转债    | 21,691.84    | 0.01          |
| 22 | 118034 | 晶能转债    | 19,524.62    | 0.01          |
| 23 | 113640 | 苏利转债    | 17,553.32    | 0.01          |
| 24 | 110083 | 苏租转债    | 16,960.51    | 0.01          |
| 25 | 127014 | 北方转债    | 14,629.63    | 0.01          |
| 26 | 127027 | 能化转债    | 12,850.74    | 0.01          |
| 27 | 113060 | 浙 22 转债 | 12,510.24    | 0.01          |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 28 | 123217 | 富仕转债 | 11,830.50 | 0.00 |
| 29 | 113679 | 芯能转债 | 10,622.31 | 0.00 |

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别            | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构         |            |                |            |
|-----------------|-----------|------------|---------------|------------|----------------|------------|
|                 |           |            | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|                 |           |            | 持有份额          | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 安信 90 天滚动持有债券 A | 51        | 635,023.00 | 0.00          | 0.00       | 32,386,173.16  | 100.00     |
| 安信 90 天滚动持有债券 C | 522       | 396,730.78 | 11,129,744.14 | 5.37       | 195,963,724.10 | 94.63      |
| 合计              | 561       | 426,879.93 | 11,129,744.14 | 4.65       | 228,349,897.26 | 95.35      |

注：机构/个人投资者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，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别            | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|-----------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 安信 90 天滚动持有债券 A | 9,987.52   | 0.03         |
|                  | 安信 90 天滚动持有债券 C | 4,938.54   | 0.00         |
|                  | 合计              | 14,926.06  | 0.01         |

注：管理人的从业人员持有基金占基金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，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别            | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 安信 90 天滚动持有债券 A | 0                 |
|                                | 安信 90 天滚动持有债券 C | 0                 |
|                                | 合计              | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 安信 90 天滚动持有债券 A | 0                 |
|                                | 安信 90 天滚动持有债券 C | 0                 |
|                                | 合计              | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 安信 90 天滚动持有债券 A | 安信 90 天滚动持有债券 C |
|--------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2024 年 1 月 17 日）基金份额总额 | 37,993,342.85   | 438,668,091.45  |
| 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额           | 1,143,960.07    | 50,976,812.32   |
| 减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额         | 6,751,129.76    | 282,551,435.53  |
| 基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额          | -               | -               |
| 本报告期末基金份额总额                    | 32,386,173.16   | 207,093,468.24  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1                  | 内容                          |
|-----------------------|-----------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人、高级管理人员                  |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 05 月 28 日            |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 深圳证监局                       |
| 受到的具体措施类型             | 责令改正、警示函                    |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 管理人已完成整改                    |
| 其他                    | 无                           |

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 长城证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东方财富 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 证券   |   |   |   |   |   |   |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金管理人制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序规定。基金管理人综合考虑券商的研究能力后，确定证券公司的选择，并与被选择的证券公司签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易           |                  | 债券回购交易           |                    | 权证交易 |                  |
|--------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
|        | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 长城证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 长江证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 东方财富证券 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 东方证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 国海证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 国投证券   | 785,579,611.56 | 100.00           | 1,372,077,000.00 | 100.00             | -    | -                |
| 华泰证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 开源证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 山西证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 浙商证券   | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                   | 法定披露日期          |
|----|---|--------------------------|-----------------|
| 1  | 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同生效公告                  | 证券日报                     | 2024 年 1 月 18 日 |
| 2  | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告 | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 2 月 21 日 |
| 3  | 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告   | 证券日报                     | 2024 年 2 月 26 日 |



|   |   |                          |                 |
|---|---|--------------------------|-----------------|
| 4 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告 | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 3 月 7 日  |
| 5 | 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告                          | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 6 | 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告            | 证券日报                     | 2024 年 4 月 12 日 |
| 7 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告     | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 8 | 安信基金管理有限责任公司住所变更公告                              | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 4 月 23 日 |
| 9 | 安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告                     | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 4 月 26 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信 90 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。

### 12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 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 8 月 29 日