

安信臻享三个月定期开放债券型证券投资
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示 | 1 |
| 1.2 目录 | 2 |
| § 2 基金简介 | 4 |
| 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 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 33 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 34 |
| 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 | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 34 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 34 |
| 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 | 35 |
| 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 | 35 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 35 |
| 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 | 35 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 35 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 35 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 37 |
| 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 | 37 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 37 |
| § 10 重大事件揭示 | 38 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 38 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 38 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 38 |
| 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 | 38 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 39 |
| 10.8 其他重大事件 | 39 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 40 |
| 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 | 40 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 41 |
| § 12 备查文件目录 | 41 |
| 12.1 备查文件目录 | 41 |
| 12.2 存放地点 | 41 |
| 12.3 查阅方式 | 41 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 安信臻享三个月定开债券 |
| 基金主代码 | 016108 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 11 月 25 日 |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 408,549,140.67 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | （一）封闭期投资策略本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。（二）开放期投资策略开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率×95%+一年期定期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期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 | 平安银行股份有限公司 |
| 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 | 95511-3 |
| 传真 | 0755-82799292 | 0755-82080387 |
| 注册地址 | 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 29 楼 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 |

| | | |
|-------|--|-------------------------------|
| 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 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码 | 518026 | 518001 |
| 法定代表人 | 刘入领 | 谢永林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 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 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 11,606,758.14 |
| 本期利润 | 10,039,647.38 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0213 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.08% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.05% |
| 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 | 13,210,727.17 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0323 |
| 期末基金资产净值 | 422,737,755.46 |
| 期末基金份额净值 | 1.0347 |
| 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 | 5.53% |

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。

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

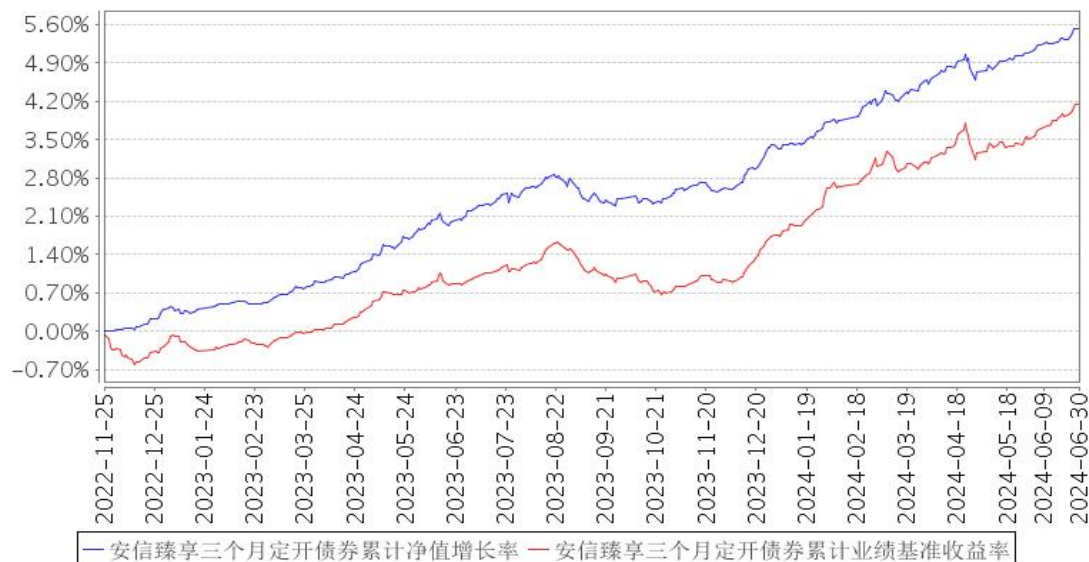
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.43% | 0.03% | 0.63% | 0.03% | -0.20% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.91% | 0.06% | 1.02% | 0.07% | -0.11% | -0.01% |
| 过去六个月 | 2.05% | 0.05% | 2.34% | 0.06% | -0.29% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.26% | 0.05% | 3.18% | 0.05% | 0.08% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.53% | 0.04% | 4.14% | 0.05% | 1.39% | -0.01% |

注：根据《安信臻享三个月定期开放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×95%+一年期定期存款利率（税后）×5%。中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性。开放期内，本基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，因此一年期定期存款利率（税后）作为该部分资产所对应的权重。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 95%、5%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

安信臻享三个月定开债券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、本基金合同生效日为 2022 年 11 月 25 日。

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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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 | | |
| 王涛 | 本基金的基金经理 | 2022 年 11 月 25 日 | - | 21 年 | 王涛先生，经济学硕士，CFA、FRM。历任中国工商银行股份有限公司深圳分行资金运营部交易员、招商银行股份有限公司金融市场部交易员、东莞证券有限责任公司深圳分公司投资经理、融通基金管理有限公司基金经理、安信基金管理有限公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期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、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 柴迪伊 | 本基金的基金经理助理 | 2023 年 8 月 9 日 | - | 8 年 | 柴迪伊女士，理学硕士，曾任安信基金管理有限公司运营部交易员、固定收益研究部研究员、固定收益部基金经理助理，现任安信基金管理有限公司固定收益部基金经理。现任安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；安信聚利增强债券型证券投资基 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型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遵规守信情况的说明

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，经济基本面总体呈现出渐进复苏态势，经济结构有所分化，工业生产与对外贸易表现较好，但居民收入信心与消费意愿仍相对低迷，居民消费、房地产等内需板块延续偏弱格局。政策层面，一季度央行下调存款准备金率 0.5%，明确了支持性的货币政策取向，但在二季度对长端国债收益率的运行区间与下行节奏有所警示。“517 房地产新政”对于短期释放潜在购房

需求存在一定的正面影响，但实质政策效果及其持续性仍待数据验证。债券市场方面，上半年流动性环境整体充裕，债券收益率震荡下行，信用利差持续压缩。各个关键期限的国债收益率均有明显下行，但在央行警示利率风险的时点有所波动。1 年、10 年与 30 年国债分别下行 54bp、35bp 与 40bp 至 1.54%、2.21%与 2.43%。

报告期内，组合在开放期降低了组合杠杆与久期，保障平稳运行。封闭期内积极交易，灵活调整久期与杠杆水平，根据曲线形态与品种利差动态调整资产结构，先后增配 10 年、5 年国债与高等级信用债，对区间收益有所增厚。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0347 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

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，经济复苏的方向依然明确，但新旧动能转换期间，新动能仍待培育，旧困难尚待解决。后续一段时间，我们重点关注社融“挤水分”之后，真实融资需求的企稳、居民收入预期与消费意愿的改善。政策方面，持续观察货币政策的空间、广义财政的力度以及地产政策的落实效果。对应到资产表现，短期内经济基本面与市场风险偏好均未发生明显变化，广义基金的规模扩张仍对债券相对有利，但在信用利差已大幅压缩的情况下，利率债与高评级信用债的性价比更为明显。组合预计保持中性久期，寻找短期确定性更强的个券标的。

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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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：安信臻享三个月定期开放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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,186,977.49 | 1,435,800.77 |
| 结算备付金 | | 4,553,611.60 | 2,093,457.94 |
| 存出保证金 | | 390,941.44 | 448,155.36 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 591,012,813.44 | 908,765,397.82 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 591,012,813.44 | 908,765,397.82 |
| 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 | - | -1,646.56 |
| 应收清算款 | | - | 55,702,654.72 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 597,144,343.97 | 968,443,820.05 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | 174,085,089.65 | 161,028,729.88 |
| 应付清算款 | | 18,632.81 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 101,303.42 | 205,014.93 |
| 应付托管费 | | 16,883.89 | 34,169.12 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 416.01 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 184,262.73 | 366,021.20 |
| 负债合计 | | 174,406,588.51 | 161,633,935.13 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 408,549,140.67 | 795,761,497.76 |

| | | | |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 14,188,614.79 | 11,048,387.16 |
| 净资产合计 | | 422,737,755.46 | 806,809,884.92 |
| 负债和净资产总计 | | 597,144,343.97 | 968,443,820.05 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0347 元，基金份额总额 408,549,140.67 份。

6.2 利润表

会计主体：安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 11,790,564.42 | 17,267,586.90 |
| 1. 利息收入 | | 559,405.80 | 586,677.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 75,616.25 | 158,701.05 |
| 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 | | 483,789.55 | 427,976.90 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 12,798,269.38 | 15,555,830.90 |
| 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 | 12,798,269.38 | 15,555,830.90 |
| 资产支持证券投资 | 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 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 | -1,567,110.76 | 1,125,078.05 |
| 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 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 减：二、营业总支出 | | 1,750,917.04 | 2,863,097.44 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 726,072.34 | 1,458,604.76 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 121,012.08 | 243,100.80 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 795,680.45 | 1,051,052.03 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 795,680.45 | 1,051,052.03 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 44.57 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 108,107.60 | 110,339.85 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 10,039,647.38 | 14,404,489.46 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 10,039,647.38 | 14,404,489.46 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 10,039,647.38 | 14,404,489.46 |

6.3 净资产变动表

会计主体：安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 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 | 795,761,497.76 | - | 11,048,387.16 | 806,809,884.92 |
| 二、本期期初净资产 | 795,761,497.76 | - | 11,048,387.16 | 806,809,884.92 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -387,212,357.09 | - | 3,140,227.63 | -384,072,129.46 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 10,039,647.38 | 10,039,647.38 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -387,212,357.09 | - | -6,899,419.75 | -394,111,776.84 |
| 其中：1. 基金申购款 | 398,415,366.88 | - | 11,683,519.99 | 410,098,886.87 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 2. 基金赎回款 | -785,627,723.97 | - | -18,582,939.74 | -804,210,663.71 |
| (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 | 408,549,140.67 | - | 14,188,614.79 | 422,737,755.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 | 1,358,004,598.07 | - | 5,613,116.62 | 1,363,617,714.69 |
| 二、本期期初净资产 | 1,358,004,598.07 | - | 5,613,116.62 | 1,363,617,714.69 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -711,810,573.11 | - | 2,166,377.34 | -709,644,195.77 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 14,404,489.46 | 14,404,489.46 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | -711,810,573.11 | - | -4,426,371.91 | -716,236,945.02 |
| 其中：1. 基金申购款 | 248,193,315.78 | - | 1,806,688.20 | 250,000,003.98 |
| 2. 基金赎回款 | -960,003,888.89 | - | -6,233,060.11 | -966,236,949.00 |
| (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) | - | - | -7,811,740.21 | -7,811,740.21 |
| 四、本期期末净资产 | 646,194,024.96 | - | 7,779,493.96 | 653,973,518.92 |

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

安信臻享三个月定期开放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”）2022 年 5 月 6 日下发的证监许可[2022]932 号文“关于准予安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复”准予注册，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《安信臻享三个月定期开放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、定期开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2022 年 11 月 4 日至 2022 年 11 月 24 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2022）验字第 60962175_H14 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 1,358,004,598.07 份，其中认购资金利息折合 4,200.03 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，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信臻享三个月定期开放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、央行票据、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、政府支持债券）、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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个交易日、开放期及开放期结束后 10 个交易日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款

等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率 \times 95%+一年期定期存款利率（税后） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,186,977.49 |
| 等于：本金 | 1,184,547.00 |
| 加：应计利息 | 2,430.49 |
| 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 | 1,186,977.49 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 249,552,213.92 | 1,626,480.76 | 251,389,838.06 | 211,143.38 |
| | 银行间市场 | 337,905,378.27 | 1,279,235.38 | 339,622,975.38 | 438,361.73 |
| | 合计 | 587,457,592.19 | 2,905,716.14 | 591,012,813.44 | 649,505.11 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 587,457,592.19 | 2,905,716.14 | 591,012,813.44 | 649,505.11 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

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 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 | 85,455.13 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 85,455.13 |
| 应付利息 | - |
| 应付信息披露费 | 59,672.34 |
| 应付审计费 | 29,835.26 |
| 应付银行间账户维护费 | 9,300.00 |
| 合计 | 184,262.73 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 795,761,497.76 | 795,761,497.76 |
| 本期申购 | 398,415,366.88 | 398,415,366.88 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -785,627,723.97 | -785,627,723.97 |
| 本期末 | 408,549,140.67 | 408,549,140.67 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 6,659,048.71 | 4,389,338.45 | 11,048,387.16 |
| 本期期初 | 6,659,048.71 | 4,389,338.45 | 11,048,387.16 |
| 本期利润 | 11,606,758.14 | -1,567,110.76 | 10,039,647.38 |
| 本期基金份额交易产生的变 | -5,055,079.68 | -1,844,340.07 | -6,899,419.75 |

| | | | |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 10,706,834.55 | 976,685.44 | 11,683,519.99 |
| 基金赎回款 | -15,761,914.23 | -2,821,025.51 | -18,582,939.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 13,210,727.17 | 977,887.62 | 14,188,614.79 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|-----------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 55,263.13 |
| 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 | | 16,914.76 |
| 其他 | | 3,438.36 |
| 合计 | | 75,616.25 |

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 | |
|------------------------------|----------------------|---------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 债券投资收益——利息收入 | | 5,560,007.58 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | | 7,238,261.80 |
| 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 | | 12,798,269.38 |

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 | |
|------------------------|----------------------|------------------|
| | 2024年1月1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 | | 3,745,812,369.67 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | | 3,715,156,116.25 |

| | |
|----------|---------------|
| 减：应计利息总额 | 23,258,297.62 |
| 减：交易费用 | 159,694.00 |
| 买卖债券差价收入 | 7,238,261.80 |

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

本基金于本期无衍生工具收益。

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 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -1,567,110.76 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | -1,567,110.76 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 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 | -1,567,110.76 |

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行间账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 108,107.60 |

6.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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、基金销售机构 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 726,072.34 | 1,458,604.76 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 43,703.66 | 113,370.02 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 682,368.68 | 1,345,234.74 |

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基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 121,012.08 | 243,100.80 |

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月 30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日 |
|-----------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 基金合同生效日（2022年11月25日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 29,334,115.58 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 29,334,115.58 | - |
| 报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 7.18% | - |

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|-------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） |
| 平安银行 | - | - | 288,599,881.68 | 36.27 |

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 平安银行 | 1,186,977.49 | 55,263.13 | 5,095,867.76 | 121,621.37 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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 66,073,573.97 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 |
|--------|------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 200404 | 20 农发 04 | 2024 年 7 月 1 日 | 104.92 | 200,000 | 20,983,643.84 |
| 220303 | 22 进出 03 | 2024 年 7 月 1 日 | 100.99 | 134,000 | 13,532,373.64 |
| 240008 | 24 付息国债 08 | 2024 年 7 月 1 日 | 100.84 | 400,000 | 40,336,986.30 |
| 合计 | | | | 734,000 | 74,853,003.78 |

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 108,011,515.68 元，于 2024 年 7 月 2 日、2024 年 7 月 10 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 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 58.35%（2023 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 68,786,523.72 | - |
| 合计 | 68,786,523.72 | - |

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 112,738,366.57 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 409,487,923.15 | 908,765,397.82 |
| 合计 | 522,226,289.72 | 908,765,397.82 |

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。货币资金、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。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 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 | 1,186,977.49 | - | - | - | 1,186,977.49 |
| 结算备付金 | 4,553,611.60 | - | - | - | 4,553,611.60 |
| 存出保证金 | 390,941.44 | - | - | - | 390,941.44 |
| 交易性金融资产 | 169,539,290.85 | 400,489,878.75 | 20,983,643.84 | - | 591,012,813.44 |
| 资产总计 | 175,670,821.38 | 400,489,878.75 | 20,983,643.84 | - | 597,144,343.97 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 101,303.42 | 101,303.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 16,883.89 | 16,883.89 |
| 应付清算款 | - | - | - | 18,632.81 | 18,632.81 |
| 卖出回购金融资产款 | 174,085,089.65 | - | - | - | 174,085,089.65 |
| 应交税费 | - | - | - | 416.01 | 416.01 |
| 其他负债 | - | - | - | 184,262.73 | 184,262.73 |
| 负债总计 | 174,085,089.65 | - | - | 321,498.86 | 174,406,588.51 |
| 利率敏感度缺口 | 1,585,731.73 | 400,489,878.75 | 20,983,643.84 | -321,498.86 | 422,737,755.46 |
| 上年度末 2023年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 1,435,800.77 | - | - | - | 1,435,800.77 |
| 结算备付金 | 2,093,457.94 | - | - | - | 2,093,457.94 |
| 存出保证金 | 448,155.36 | - | - | - | 448,155.36 |
| 交易性金融资产 | 380,970,391.05 | 497,515,809.51 | 30,279,197.26 | - | 908,765,397.82 |
| 买入返售金融资产 | -1,646.56 | - | - | - | -1,646.56 |
| 应收清算款 | - | - | - | 55,702,654.72 | 55,702,654.72 |
| 资产总计 | 384,946,158.56 | 497,515,809.51 | 30,279,197.26 | 55,702,654.72 | 968,443,820.05 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 205,014.93 | 205,014.93 |
| 应付托管费 | - | - | - | 34,169.12 | 34,169.12 |
| 卖出回购金融资产款 | 161,028,729.88 | - | - | - | 161,028,729.88 |
| 其他负债 | - | - | - | 366,021.20 | 366,021.20 |
| 负债总计 | 161,028,729.88 | - | - | 605,205.25 | 161,633,935.13 |
| 利率敏感度缺口 | 223,917,428.68 | 497,515,809.51 | 30,279,197.26 | 55,097,449.47 | 806,809,884.92 |

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） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 1. 市场利率下降25个基点 | 3,476,427.21 | 4,808,091.96 |
| 2. 市场利率上升25个基点 | -3,439,063.71 | -4,752,035.16 | |

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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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(2023年12月31日：同)。

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 591,012,813.44 | 908,765,397.82 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 591,012,813.44 | 908,765,397.82 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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 | 591,012,813.44 | 98.97 |
| | 其中：债券 | 591,012,813.44 | 98.97 |
| | 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 | 5,740,589.09 | 0.96 |
| 8 | 其他各项资产 | 390,941.44 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 597,144,343.97 | 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初基金资产净值 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初基金资产净值 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 | 202,172,962.43 | 47.82 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 254,898,183.18 | 60.30 |
| | 其中：政策性金融债 | 142,159,816.61 | 33.63 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 65,155,144.11 | 15.41 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 68,786,523.72 | 16.27 |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|--------|
| 10 | 合计 | 591,012,813.44 | 139.81 |
|----|----|----------------|--------|

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 | 019739 | 24 国债 08 | 700,000 | 70,575,726.03 | 16.69 |
| 2 | 220303 | 22 进出 03 | 500,000 | 50,493,931.51 | 11.94 |
| 3 | 240302 | 24 进出 02 | 500,000 | 50,471,301.37 | 11.94 |
| 4 | 240008 | 24 附息国债 08 | 500,000 | 50,421,232.88 | 11.93 |
| 5 | 019706 | 23 国债 13 | 500,000 | 50,258,835.62 | 11.89 |

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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 CD220（代码：112415220 CY）、22 东证 04（代码：138727 SH）、22 中金 G1（代码：138664 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. 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. 东方证券股份有限公司

2024 年 2 月 2 日，东方证券股份有限公司因公司治理类问题被国家金融监督管理总局上海监管局出具警示函。

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。

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 | 390,941.44 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 390,941.44 |

7.11.4 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。

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

| 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 (%) |
| 232 | 1,760,987.68 | 408,462,796.05 | 99.98 | 86,344.62 | 0.02 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 137.69 | 0.00 |

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 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2022 年 11 月 25 日) 基金份额总额 | 1,358,004,598.07 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 795,761,497.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 398,415,366.88 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 785,627,723.97 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 408,549,140.67 |

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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安永华明会计师事务所（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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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 (%) | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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 (%) |
| 长江证券 | 3,298,950,519.92 | 100.00 | 2,192,054,000.00 | 100.00 | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告 | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 1 月 3 日 |
| 2 | 安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告 | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 1 月 9 日 |
| 3 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 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 1 月 19 日 |
| 4 | 安信基金管理有限责任公司关于安信 | 中国证券报 | 2024 年 1 月 31 日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| | 臻享三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告 | | |
| 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 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年年度报告提示性公告 | 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报 | 2024 年 3 月 28 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 |
| 10 | 安信基金管理有限责任公司关于安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告 | 中国证券报 | 2024 年 6 月 8 日 |
| 11 | 安信基金管理有限责任公司关于安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金提前结束开放期的公告 | 中国证券报 | 2024 年 6 月 20 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

| 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 | 20240222-20240311 | 99,373,944.15 | - | 99,373,944.15 | - | - |
| | 2 | 20240101-20240305 | 200,000,000.00 | - | 200,000,000.00 | - | - |
| | 3 | 20240101-20240221 | 288,599,881.68 | - | 288,599,881.68 | - | - |
| | 4 | 20240613-20240630 | - | 290,725,845.53 | - | 290,725,845.53 | 71.16 |

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流

动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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臻享三个月定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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