

# 安信聚利增强债券型证券投资基金

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信聚利增强债券
基金主代码	006839
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 15 日
报告期末基金份额总额	47,347,485.61 份
投资目标	本基金在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金所定义的增强是指在积极的债券配置基础上，进行适当的股票投资以增强基金获利能力，动态调节债券和股票的配置比例，采用类 CPPI 策略控制回撤，力争超越本基金的业绩比较基准中债总指数（全价）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。债券配置方面，通过上下结合的宏观和微观研究，动态调整债券资产的久期、信用等级配比，采取多种灵活的策略（主要包括骑乘策略、回购策略等），进行积极的债券配置，力争超越中债总指数（全价）收益率。股票配置方面，将以成份股在基准指数中的基准权重为基础，进行超配或低配，并通过深入研究基本面精选个股，同时在有效控制风险及交易成本最低化的基础上建立投资组合，力求超越沪深 300 指数收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*80%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C
下属分级基金的交易代码	006839	010053	006840
报告期末下属分级基金的份额总额	8,344,426.57 份	0.00 份	39,003,059.04 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）		
	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C
1. 本期已实现收益	85,924.93	-	133,786.65
2. 本期利润	313,464.27	-	755,969.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0349	-	0.0309
4. 期末基金资产净值	9,120,537.22	-	42,292,676.08
5. 期末基金份额净值	1.0930	1.0930	1.0843

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后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、根据基金管理人 2020 年 9 月 18 日《关于安信聚利增强债券型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 9 月 18 日起，本基金增加 B 类份额。截至本报告期末，无 B 类份额，B 类份额净值参考 A 类份额净值披露。

#### 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

安信聚利增强债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.15%	0.21%	0.82%	0.16%	2.33%	0.05%
过去六个月	1.79%	0.25%	0.95%	0.21%	0.84%	0.04%
过去一年	3.00%	0.26%	-0.31%	0.22%	3.31%	0.04%
过去三年	2.52%	0.37%	2.45%	0.24%	0.07%	0.13%

自基金合同 生效起至今	9.30%	0.33%	4.96%	0.25%	4.34%	0.08%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

安信聚利增强债券 B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	3.15%	0.21%	0.82%	0.16%	2.33%	0.05%
过去六个月	1.79%	0.25%	0.95%	0.21%	0.84%	0.04%
过去一年	3.00%	0.26%	-0.31%	0.22%	3.31%	0.04%
自基金合同 生效起至今	1.26%	0.38%	0.15%	0.24%	1.11%	0.14%

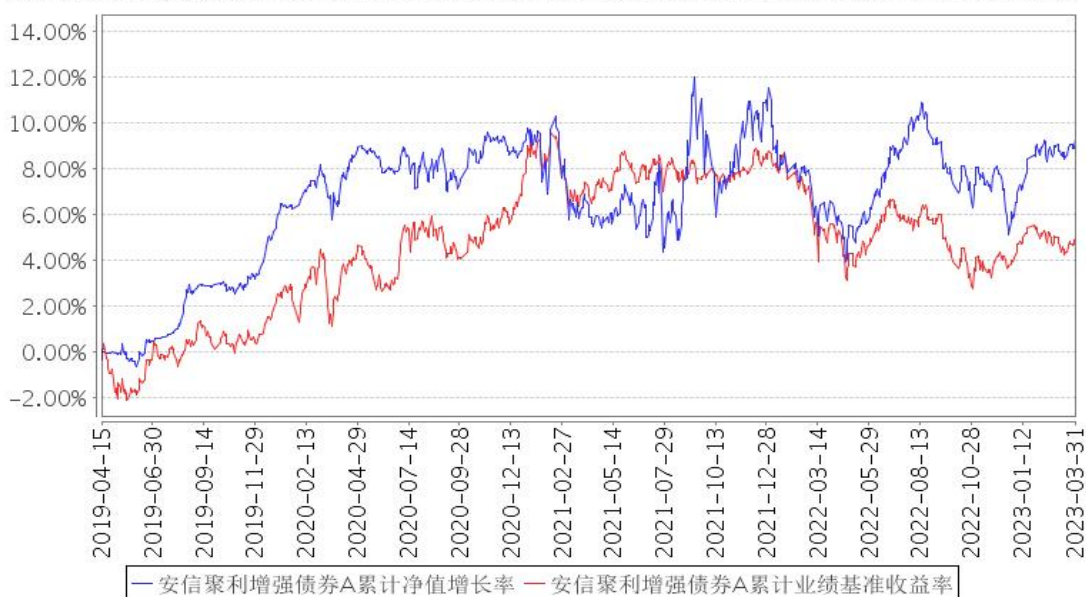
安信聚利增强债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	3.10%	0.20%	0.82%	0.16%	2.28%	0.04%
过去六个月	1.69%	0.25%	0.95%	0.21%	0.74%	0.04%
过去一年	2.79%	0.26%	-0.31%	0.22%	3.10%	0.04%
过去三年	1.90%	0.37%	2.45%	0.24%	-0.55%	0.13%
自基金合同 生效起至今	8.43%	0.33%	4.96%	0.25%	3.47%	0.08%

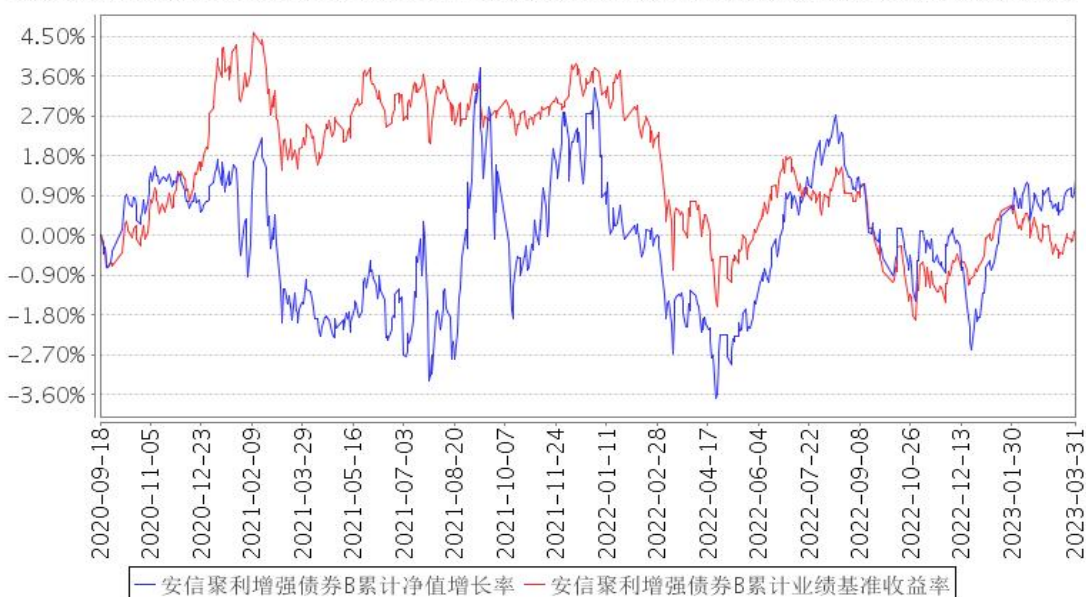
注：报告期内无 B 类份额时，份额净值增长率数据参照 A 类份额计算。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

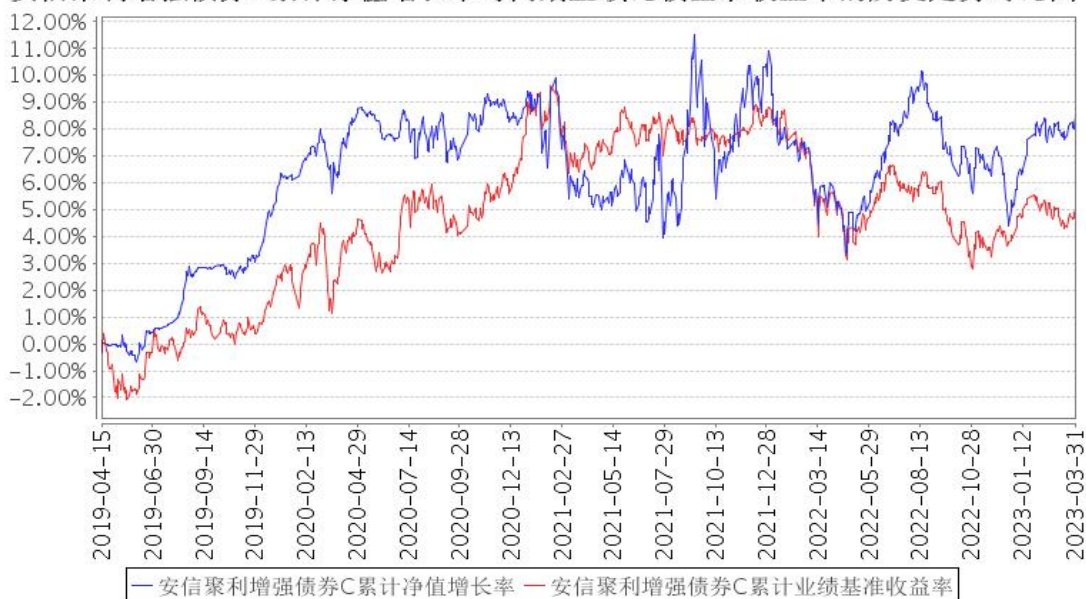
安信聚利增强债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信聚利增强债券B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



安信聚利增强债券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、本基金合同生效日为 2019 年 4 月 15 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。

3、根据基金管理人 2020 年 9 月 18 日《关于安信聚利增强债券型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 9 月 18 日起，本基金增加 B 类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁冰哲	本基金的基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	6 年	梁冰哲先生，理学硕士。曾任德勤华永会计师事务所审计部审计员，安信基金管理有限责任公司固定收益研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信永泰定期开放债券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、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金的基金经理助理；安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任安信新价值灵活配置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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经

					理。
王涛	本基金的基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	20 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。曾任安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利率债债券型证券投资基金、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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信聚利增强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的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理	2022 年 10 月 10 日	-	10 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理，现任安信基金管理有限公司量化投资部基金经理。曾任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理；安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的基金经理。现任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）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信聚利增强债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内宏观经济基本面处于复苏过程。制造业 PMI 连续三月位于荣枯线以上，新房二手房销售数据大幅好于去年同期，服务消费亦逐渐向正常化复苏，基建投资托底经济。同时从 1-2 月金融数据上看，信贷“开门红”完成情况较好，政府债券提前发力，为经济修复提供有力支撑。3 月初全国两会发布 2023 年 GDP 增速 5% 目标后，我们认为伴随着经济修复斜率陡峭形态趋缓。海外市场，美元的货币政策预期在通胀预期下经历反复，硅谷银行事件出现后美联储激进的加息预期消退，美债收益率下行。

债券市场一季度的表现整体来看基于经济基本面的修复而利率上行，走势呈现先上后下的窄幅区间波动行情。具体来看，1-2 月因银行大量信贷投放、春节走款、地方债发行提速等消耗银



行体系超储，央行通过大额公开市场操作逆回购、MLF 净投放维护银行体系流动性合理充裕，但货币市场利率中枢仍显著提升，经济修复叠加流动性紧张使债券收益率持续上行。央行期间“降准”一次提供流动性支持。一季度 10 年国债收益率从年初 2.83% 上行至 2.90% 随后下行至 2.85%；1 年期国债收益率从年初 2.09% 上行至 2.3% 随后下行至 2.23 附近。

权益市场总体上涨，上证指数上涨 5.94%，但市场在一季度经济恢复的预期中有所反复。具体看年初在“强预期”下录得一定涨幅，顺周期行业取得一定收益，但经济修复的斜率略低于预期后市场回调，热点转向计算机、电子等偏成长行业。

本基金操作方面，报告期内组合增加了 3 年及 7 年国债。可转债方面，组合维持中等偏高的整体转债仓位，但持仓主要以低价位、正股弹性优异的转债为主，转债组合保持行业和个券的分散配置。权益方面，采用量化投资方法，基于对股票和上市公司相关数据的深度挖掘，使用机器学习等量化方法构建股票组合。在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，力争实现基金财产的长期稳健增值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信聚利增强债券 A 基金份额净值为 1.0930 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.15%；安信聚利增强债券 B 基金份额净值为 1.0930 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.15%；安信聚利增强债券 C 基金份额净值为 1.0843 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.10%；同期业绩比较基准收益率为 0.82%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 3 月 6 日。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,149,518.49	18.59
	其中：股票	10,149,518.49	18.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,387,500.37	79.48
	其中：债券	43,387,500.37	79.48
	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	397,209.90	0.73
8	其他资产	656,393.07	1.20
9	合计	54,590,621.83	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	366,576.00	0.71
B	采矿业	200,532.00	0.39
C	制造业	7,477,611.83	14.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	210,901.00	0.41
E	建筑业	43,296.00	0.08
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	261,606.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	228,738.00	0.44
J	金融业	856,780.00	1.67
K	房地产业	127,450.00	0.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	244,787.66	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	73,336.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,904.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,149,518.49	19.74

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	100	182,000.00	0.35

2	601318	中国平安	3,900	177,840.00	0.35
3	002714	牧原股份	3,500	171,500.00	0.33
4	300750	宁德时代	400	162,420.00	0.32
5	300498	温氏股份	7,900	161,713.00	0.31
6	000001	平安银行	11,700	146,601.00	0.29
7	002475	立讯精密	4,200	127,302.00	0.25
8	600150	中国船舶	5,000	117,000.00	0.23
9	688639	华恒生物	682	115,469.42	0.22
10	000988	华工科技	4,400	111,804.00	0.22

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	25,605,759.10	49.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,179,778.74	2.29
	其中：政策性金融债	1,179,778.74	2.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,601,962.53	32.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,387,500.37	84.39

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	105,000	10,528,194.66	20.48
2	019679	22 国债 14	60,000	6,074,950.68	11.82
3	230006	23 附息国债 06	50,000	4,993,177.60	9.71
4	230001	23 附息国债 01	20,000	2,005,570.41	3.90
5	019696	23 国债 03	20,000	2,003,865.75	3.90

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

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。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,962.91
2	应收证券清算款	647,281.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	148.96
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	656,393.07

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127024	盈峰转债	874,828.44	1.70
2	118018	瑞科转债	805,691.39	1.57
3	110062	烽火转债	775,229.20	1.51
4	127066	科利转债	733,233.10	1.43
5	118004	博瑞转债	694,408.66	1.35
6	123109	昌红转债	691,480.00	1.34
7	127036	三花转债	524,393.88	1.02
8	127016	鲁泰转债	516,274.82	1.00
9	113639	华正转债	508,936.12	0.99
10	113062	常银转债	506,077.46	0.98
11	128136	立讯转债	477,463.28	0.93
12	127053	豪美转债	429,598.10	0.84
13	128137	洁美转债	407,713.24	0.79
14	113052	兴业转债	375,007.16	0.73
15	132018	G 三峡 EB1	355,085.21	0.69
16	128109	楚江转债	310,424.89	0.60
17	123119	康泰转 2	298,881.93	0.58
18	110076	华海转债	259,269.12	0.50
19	113549	白电转债	259,093.90	0.50
20	113647	禾丰转债	258,402.26	0.50
21	113530	大丰转债	257,592.85	0.50
22	113046	金田转债	255,810.08	0.50
23	113654	永 02 转债	251,695.61	0.49
24	113055	成银转债	250,510.70	0.49
25	113516	苏农转债	249,904.37	0.49
26	127032	苏行转债	248,316.36	0.48
27	127051	博杰转债	238,881.85	0.46
28	127044	蒙娜转债	236,899.72	0.46
29	113561	正裕转债	231,548.10	0.45
30	123131	奥飞转债	213,291.39	0.41
31	113030	东风转债	205,530.56	0.40
32	118007	山石转债	181,096.08	0.35
33	128074	游族转债	156,461.05	0.30
34	127038	国微转债	155,873.78	0.30
35	110060	天路转债	147,873.08	0.29
36	110081	闻泰转债	130,649.52	0.25
37	113594	淳中转债	107,412.52	0.21
38	123104	卫宁转债	104,244.96	0.20
39	128121	宏川转债	102,812.38	0.20
40	123099	普利转债	101,913.42	0.20

41	127071	天箭转债	101,021.80	0.20
42	113636	甬金转债	95,975.56	0.19
43	113588	润达转债	92,528.30	0.18
44	113609	永安转债	82,511.36	0.16
45	110045	海澜转债	81,597.63	0.16
46	113047	旗滨转债	77,288.82	0.15
47	123114	三角转债	77,161.83	0.15
48	113656	嘉诚转债	77,021.60	0.15
49	127070	大中转债	75,573.57	0.15
50	123154	火星转债	52,823.23	0.10
51	128042	凯中转债	51,494.60	0.10
52	127063	贵轮转债	50,922.48	0.10
53	123077	汉得转债	36,075.68	0.07
54	127064	杭氧转债	16,418.49	0.03
55	113648	巨星转债	10,659.12	0.02

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信聚利增强债券 A	安信聚利 增强债券 B	安信聚利增强债券 C
报告期期初基金份额总额	9,990,618.77	-	26,201,109.01
报告期期间基金总申购份额	20,564.15	-	24,030,472.66
减：报告期期间基金总赎回份额	1,666,756.35	-	11,228,522.63
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	8,344,426.57	-	39,003,059.04

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230101-20230331	13,776,052.39	-	-	13,776,052.39	29.10
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信聚利增强债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信聚利增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信聚利增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信聚利增强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。

### 9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2023 年 4 月 21 日