

# 安信尊享添益债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信尊享添益债券
基金主代码	005678
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 14 日
报告期末基金份额总额	44,762,261.88 份
投资目标	本基金在控制组合净值波动率的前提下,力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面,本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,确定资产在非信用类固定收益类证券和信用类固定收益类证券之间的配置比例。债券投资方面,灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略和可转换债券投资策略等,在合理管理并控制组合风险的前提下,最大化组合收益。资产支持证券投资方面,本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。此外,在国债期货的投资上,基金管理人将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。
业绩比较基准	中债总指数(全价)收益率
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信尊享添益债券 A	安信尊享添益债券 C
下属分级基金的交易代码	005678	007099
报告期末下属分级基金的份额总额	12,887,370.90 份	31,874,890.98 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	安信尊享添益债券 A	安信尊享添益债券 C
1. 本期已实现收益	85,005.05	136,383.39
2. 本期利润	21,186.45	-13,479.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0016	-0.0005
4. 期末基金资产净值	15,509,440.56	37,669,162.55
5. 期末基金份额净值	1.2035	1.1818

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 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

安信尊享添益债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	0.09%	-0.03%	0.07%	0.10%	0.02%
过去六个月	1.52%	0.09%	0.99%	0.07%	0.53%	0.02%
过去一年	3.35%	0.10%	0.45%	0.08%	2.90%	0.02%
过去三年	4.83%	0.13%	4.40%	0.08%	0.43%	0.05%
过去五年	16.99%	0.11%	7.33%	0.10%	9.66%	0.01%
自基金合同生效起至今	20.35%	0.11%	10.15%	0.10%	10.20%	0.01%

安信尊享添益债券 C

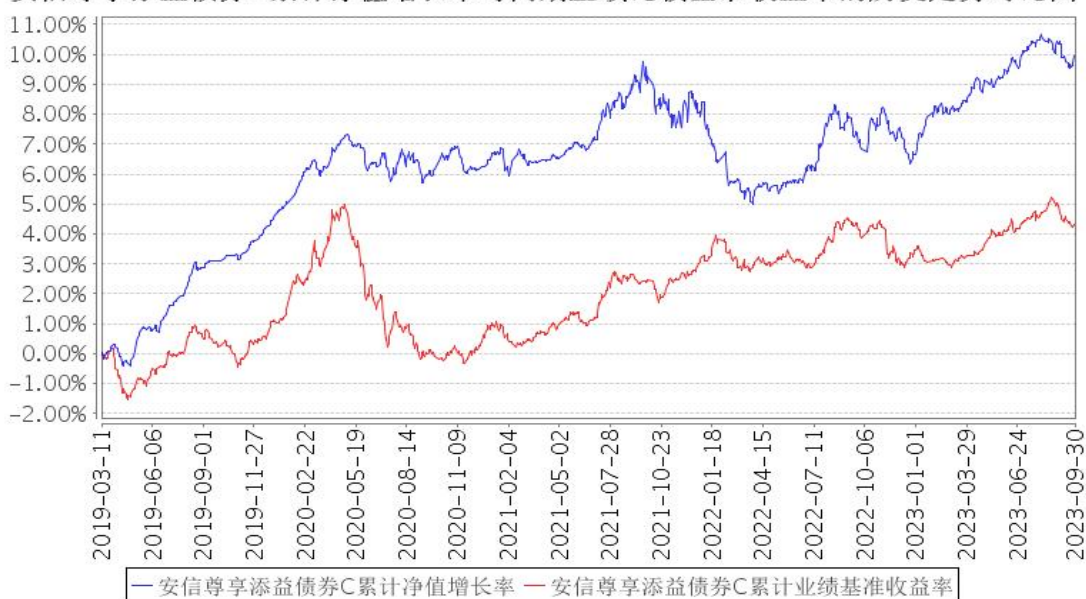
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.03%	0.09%	-0.03%	0.07%	0.00%	0.02%
过去六个月	1.31%	0.09%	0.99%	0.07%	0.32%	0.02%
过去一年	2.93%	0.10%	0.45%	0.08%	2.48%	0.02%
过去三年	3.57%	0.13%	4.40%	0.08%	-0.83%	0.05%
自基金合同生效起至今	9.96%	0.11%	4.32%	0.10%	5.64%	0.01%

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

安信尊享添益债券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



安信尊享添益债券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 2018 年 3 月 14 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 2019 年 3 月 9 日《关于安信尊享添益债券型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 3 月 9 日起，本基金增加 C 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	-	7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。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

				<p>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、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。</p>
--	--	--	--	--

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

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2023 年 3 季度的市场表现，股票市场表现仍然相对较弱，而债券呈现小幅回调格局。股票方面，沪深 300 回报率录得-3.98%，中证 500 回报率录得-5.13%。制约股票市场回报的因素是多方面的，但三季度美国加息预期重新上升无疑是一个重要因素。三季度以来，在持续超预期的就业数据和持续上涨的油价推动下，美国经济“no landing”的可能性逐渐被市场认可，全球市场呈现出实际利率冲击的特征：美国中长期国债在实际利率推动下持续走高，美元指数持续走强，资金由新兴市场流出，股票估值承受一定压力。从国内经济视角来看，三季度以来国内经济持续温和复苏的态势延续。在多管齐下的稳增长政策下，我国经济仍然呈现稳中向好的格局，通胀读数企稳回升，PMI 读数重回荣枯线之上，旅游和消费数据也呈现逐步修复的态势，外需数据边际企稳改善。前期投资者所担忧的房地产和地方政府债务问题已经逐步得到解决。

债券市场方面，2023 年 3 季度债券市场小幅回调，10 年国债收益率由最低 2.53 回调至 2.68，反映了债券投资者整体对国内经济企稳回升有所预期。此外，9 月以来隔夜回购利率持续维持在相对较高位置，对长端国债也形成了一定的压制。货币政策方面，虽然隔夜回购利率仍然相对较高，但央行通过降准等操作为国债发行和实体经济融资持续形成支持，有助于增强市场主体信心，体现了央行稳健的货币政策精准有力逆周期调控的作用。

纯债方面，组合适度配置了中长期的利率债，并且在利率债上进行了波段操作。可转债方面，组合仍然致力于寻找低价且公司成长性和其溢价率相匹配的转债标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信尊享添益债券 A 基金份额净值为 1.2035 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.07%；安信尊享添益债券 C 基金份额净值为 1.1818 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.03%；同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	65,238,338.60	97.65

	其中：债券	65,238,338.60	97.65
	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	1,165,878.31	1.75
8	其他资产	402,438.99	0.60
9	合计	66,806,655.90	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	45,177,422.38	84.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,127,583.56	13.40
	其中：政策性金融债	7,127,583.56	13.40
4	企业债券	2,354,557.25	4.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,578,775.41	19.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	65,238,338.60	122.68

## 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	019693	22 国债 28	230,000	23,415,543.84	44.03
2	230006	23 付息国债 06	100,000	10,227,355.19	19.23



3	019678	22 国债 13	65,000	6,538,695.48	12.30
4	230016	23 付息国债 16	50,000	4,995,827.87	9.39
5	018009	国开 1803	32,000	3,821,347.07	7.19

## 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，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	15,298.67
2	应收证券清算款	386,880.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	259.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	402,438.99

### 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	118018	瑞科转债	574,077.02	1.08
2	118009	华锐转债	473,156.59	0.89
3	110082	宏发转债	412,464.29	0.78
4	128137	洁美转债	398,986.26	0.75
5	127071	天箭转债	393,013.54	0.74
6	110080	东湖转债	382,282.52	0.72
7	110087	天业转债	370,535.70	0.70
8	110081	闻泰转债	370,463.02	0.70
9	113549	白电转债	356,589.96	0.67
10	127056	中特转债	333,491.41	0.63
11	113064	东材转债	317,303.41	0.60
12	128135	洽洽转债	315,814.73	0.59
13	113591	胜达转债	302,018.67	0.57
14	110086	精工转债	299,935.04	0.56
15	128109	楚江转债	283,973.27	0.53
16	110076	华海转债	269,243.67	0.51
17	118007	山石转债	262,239.83	0.49
18	128134	鸿路转债	223,474.44	0.42
19	118004	博瑞转债	221,554.03	0.42
20	123127	耐普转债	217,562.56	0.41
21	113602	景 20 转债	195,319.89	0.37
22	118023	广大转债	190,227.80	0.36
23	110067	华安转债	176,237.84	0.33
24	113609	永安转债	162,465.48	0.31
25	118032	建龙转债	157,060.55	0.30

26	127051	博杰转债	145,999.87	0.27
27	128105	长集转债	144,086.01	0.27
28	113639	华正转债	135,915.10	0.26
29	113640	苏利转债	133,942.22	0.25
30	118030	睿创转债	129,330.74	0.24
31	127072	博实转债	125,486.88	0.24
32	118027	宏图转债	124,599.15	0.23
33	127078	优彩转债	123,085.12	0.23
34	113650	博 22 转债	116,284.49	0.22
35	128076	金轮转债	105,605.81	0.20
36	113636	甬金转债	97,178.20	0.18
37	110060	天路转债	82,896.74	0.16
38	110062	烽火转债	61,768.08	0.12
39	123179	立高转债	58,038.38	0.11
40	113656	嘉诚转债	57,588.15	0.11
41	118033	华特转债	17,533.26	0.03
42	113046	金田转债	2,168.77	0.00

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信尊享添益债券 A	安信尊享添益债券 C
报告期期初基金份额总额	14,506,553.38	28,973,558.57
报告期期间基金总申购份额	909,062.75	11,062,792.71
减：报告期期间基金总赎回份额	2,528,245.23	8,161,460.30
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	12,887,370.90	31,874,890.98

## § 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	20230701-20230930	21,348,383.10		-1,848,383.10	19,500,000.00	43.56

#### 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。

### 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尊享添益债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信尊享添益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信尊享添益债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信尊享添益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 10 月 24 日