

# 安信尊享添益债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 20 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 2025 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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	81,261,462.57 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。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则,

	基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定,因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	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	7,908,520.66 份	73,352,941.91 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 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	174,276.04	265,292.27
2. 本期利润	273,707.11	481,712.10
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0301	0.0272
4. 期末基金资产净值	9,876,201.10	89,500,900.46
5. 期末基金份额净值	1.2488	1.2201

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	2.82%	0.09%	2.66%	0.12%	0.16%	-0.03%
过去六个月	3.31%	0.10%	3.12%	0.12%	0.19%	-0.02%
过去一年	3.63%	0.11%	5.43%	0.11%	-1.80%	0.00%
过去三年	5.97%	0.12%	7.39%	0.09%	-1.42%	0.03%

过去五年	10.77%	0.12%	9.67%	0.10%	1.10%	0.02%
自基金合同生效起至今	24.88%	0.11%	17.09%	0.10%	7.79%	0.01%

安信尊享添益债券 C

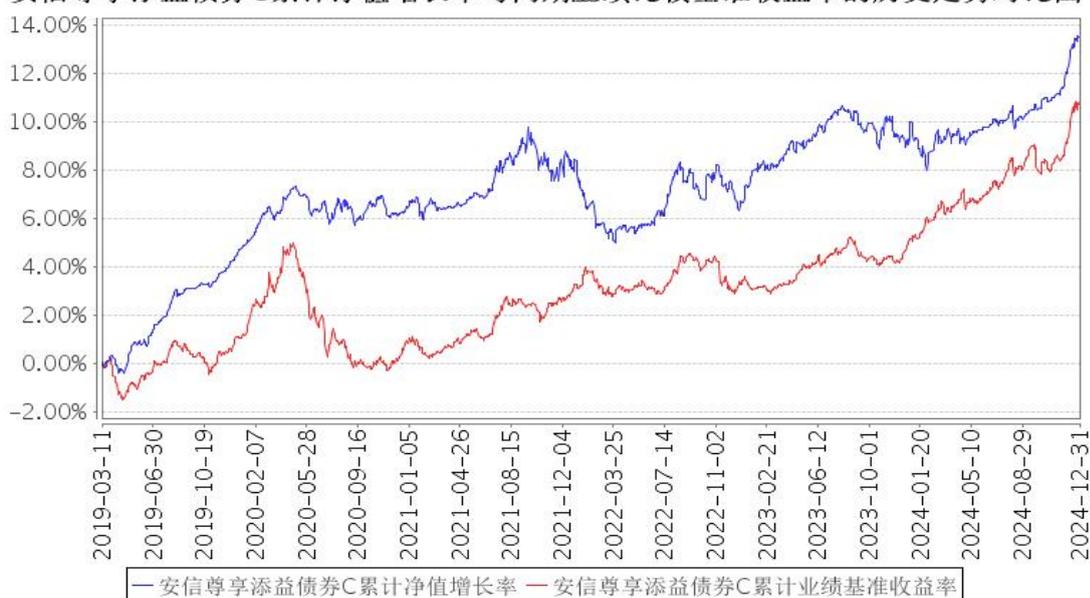
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.71%	0.09%	2.66%	0.12%	0.05%	-0.03%
过去六个月	3.09%	0.10%	3.12%	0.12%	-0.03%	-0.02%
过去一年	3.21%	0.11%	5.43%	0.11%	-2.22%	0.00%
过去三年	4.70%	0.12%	7.39%	0.09%	-2.69%	0.03%
过去五年	8.58%	0.12%	9.67%	0.10%	-1.09%	0.02%
自基金合同生效起至今	13.52%	0.11%	10.89%	0.10%	2.63%	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		
张睿	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2024 年 4 月 25 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。
--	--	--	--	--	----------------------

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

2024 年四季度国内经济总体平稳运行，供需两端呈现边际修复、物价相对低迷，期间多数宏观指标持平或略低于市场预期。海外方面，延续“美强欧弱”格局。美联储连续降息、四季度共调降 50 基点，美国经济保持韧性，服务业需求强劲，就业市场持续回暖，经济软着陆的预期强化；欧元区经济活动较为低迷，制造业持续萎缩，通胀显著回落。国内方面，基本面边际改善，制造业 PMI 连续 3 个月保持在扩张区间，结构上的分化有所弱化，供需两端复苏动能在政策发力下均有所提升、但价格指数走弱，反映了现阶段经济内生动能仍待改善。具体看，投资同比增速延续回落但降幅收窄，其中制造业投资在政策支持和外需支撑下保持高速增长；新增专项债发行推动

基建投资增速进一步回升；房地产投资继续寻底，同比降幅较三季度仍有扩大。四季度消费在双十一和“以旧换新”政策提振下显著修复，餐饮收入同比增速持续回升，消费结构上仍呈现服务消费强于商品消费。出口四季度仍保持韧性，未来随着美国新总统上任，明年存在不确定性。新增社融和人民币贷款数据持续同比少增，政府债发行构成新增社融的最大支撑，信贷需求是主要影响因素；M1 同比降幅收窄，居民中长期贷款连续两个月同比多增反映了房地产政策刺激下市场逐步在修复，同时受化债政策影响、部分城投平台存量贷款被提前偿还或置换，企业贷款数据持续偏弱。通胀数据持续低迷，CPI 环比 2 个月转负，PPI 同比连续 26 个月为负。政策方面，央行四季度开展降息操作，1 年和 5 年期 LPR 分别调降 25bp。11 月召开全国人大常委会审议通过“6+4+2”化债议案，12 月政治局会议定调实施“更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，中央经济工作会议提出“实施更加积极有为的宏观政策，扩大国内需求，推动科技创新和产业创新融合发展，稳住楼市股市”，提及“提高财政赤字率”和“适时降准降息”。

债券市场四季度收益率整体大幅下行，收益率曲线呈现平坦化，部分关键期限利率债收益率突破历史低位，信用利差呈现分化，中短期信用债与国债的利差收窄、长期信用债与利率债的利差走阔。转债市场四季度表现强势，中证转债指数上涨 5.55%，超 9 成转债表现好于正股。

报告期内，本基金主要配置利率债和高等级信用债，本季度降低信用债的持仓比例、增加利率债和同业存单的持仓比例，提升组合久期和杠杆水平，期间通过利率债波段交易增厚组合收益。

#### 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 1.2488 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.82%；安信尊享添益债券 C 基金份额净值为 1.2201 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.71%；同期业绩比较基准收益率为 2.66%。

#### 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 2024 年 11 月 01 日至 2024 年 12 月 24 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,148,760.05	60.62

	其中：债券	67,148,760.05	60.62
	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	29,908,384.11	27.00
	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	1,551,764.98	1.40
8	其他资产	12,163,346.65	10.98
9	合计	110,772,255.79	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	32,050,361.16	32.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,870,779.06	26.03
	其中：政策性金融债	21,784,947.22	21.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,023,460.05	2.04
6	中期票据	1,015,731.23	1.02
7	可转债（可交换债）	4,190,332.61	4.22
8	同业存单	1,998,095.94	2.01
9	其他	-	-
10	合计	67,148,760.05	67.57

## 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	240314	24 进出 14	100,000	10,039,701.37	10.10
2	019748	24 国债 14	59,000	6,087,595.75	6.13

3	240215	24 国开 15	50,000	5,282,391.78	5.32
4	240011	24 付息国债 11	50,000	5,273,100.83	5.31
5	240014	24 付息国债 14	50,000	5,158,979.45	5.19

### 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，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

报告期内本基金投资的前十名证券除 24 国开 15（代码：240215 CY）、国开 2005（代码：018014 SH）、23 信投 G7（代码：240162 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. 国家开发银行

2024 年 12 月 27 日，国家开发银行因违规经营被国家金融监督管理总局北京监管局罚款。

## 2. 中信建投证券股份有限公司

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

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

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

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

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

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

2024 年 10 月 18 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管谈话。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,161.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,160,185.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,163,346.65

### 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	123063	大禹转债	140,392.32	0.14

2	127035	濮耐转债	140,279.23	0.14
3	113584	家悦转债	138,235.22	0.14
4	113646	永吉转债	137,898.13	0.14
5	113625	江山转债	136,857.59	0.14
6	113641	华友转债	136,726.78	0.14
7	113632	鹤 21 转债	129,953.82	0.13
8	127103	东南转债	128,548.36	0.13
9	123149	通裕转债	128,377.36	0.13
10	113033	利群转债	128,200.72	0.13
11	111008	沿浦转债	127,559.33	0.13
12	127050	麒麟转债	127,297.79	0.13
13	111016	神通转债	127,019.10	0.13
14	123107	温氏转债	126,886.21	0.13
15	113663	新化转债	126,744.28	0.13
16	123191	智尚转债	126,075.30	0.13
17	123145	药石转债	125,867.13	0.13
18	113685	升 24 转债	125,434.08	0.13
19	113068	金铜转债	124,322.83	0.13
20	123211	阳谷转债	123,428.84	0.12
21	123233	凯盛转债	120,778.82	0.12
22	123228	震裕转债	120,396.32	0.12
23	127032	苏行转债	112,520.63	0.11
24	113050	南银转债	109,137.86	0.11
25	128132	交建转债	108,993.03	0.11
26	113056	重银转债	108,525.47	0.11
27	127053	豪美转债	108,225.25	0.11
28	111007	永和转债	88,972.20	0.09
29	113631	皖天转债	86,888.72	0.09
30	123120	隆华转债	84,871.29	0.09
31	123184	天阳转债	67,727.51	0.07
32	113065	齐鲁转债	60,589.64	0.06
33	113069	博 23 转债	59,682.02	0.06
34	118013	道通转债	57,291.50	0.06
35	110079	杭银转债	28,400.06	0.03
36	113681	镇洋转债	28,374.48	0.03
37	128129	青农转债	19,701.43	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	8,186,094.33	10,834,881.52
报告期期间基金总申购份额	16,956,740.54	82,698,401.22
减：报告期期间基金总赎回份额	17,234,314.21	20,180,340.83
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	7,908,520.66	73,352,941.91

## § 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

单位：份

项目	安信尊享添益债券 A	安信尊享添益债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	8,813,900.78
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	8,813,900.78
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	10.85

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	基金转换入	2024-10-24	8,813,900.78	10,500,000.00	-
合计			8,813,900.78	10,500,000.00	

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

## § 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	1	20241024-20241224	-	8,813,900.78	-	8,813,900.78	10.85

构	2	20241001-20241023	8,759,456.72	-	8,759,456.72	-	-
	3	20241025-20241031	-	16,415,497.00	16,415,497.00	-	-
	4	20241101-20241125	-	8,394,191.22	8,394,191.22	-	-
个人	1	20241223-20241224	-	9,842,519.69	-	9,842,519.69	12.11
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

2025 年 1 月 20 日