

安信聚利增强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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	183,038,241.94 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。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	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	24,181,161.72 份	0.00 份	158,857,080.22 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	434,394.91	-	1,505,086.45
2. 本期利润	312,709.38	-	840,336.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0392	-	0.0283
4. 期末基金资产净值	28,530,840.36	-	185,273,587.47
5. 期末基金份额净值	1.1799	1.1799	1.1663

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、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	3.46%	0.53%	1.85%	0.34%	1.61%	0.19%
过去六个月	6.53%	0.50%	5.45%	0.31%	1.08%	0.19%
过去一年	13.11%	0.44%	7.62%	0.25%	5.49%	0.19%
过去三年	5.78%	0.37%	2.02%	0.23%	3.76%	0.14%
过去五年	11.64%	0.38%	8.46%	0.24%	3.18%	0.14%
自基金合同 生效起至今	17.99%	0.36%	10.98%	0.24%	7.01%	0.12%

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	3.46%	0.53%	1.85%	0.34%	1.61%	0.19%
过去六个月	6.53%	0.50%	5.45%	0.31%	1.08%	0.19%
过去一年	13.11%	0.44%	7.62%	0.25%	5.49%	0.19%
过去三年	5.78%	0.37%	2.02%	0.23%	3.76%	0.14%
自基金合同 生效起至今	9.31%	0.40%	5.89%	0.23%	3.42%	0.17%

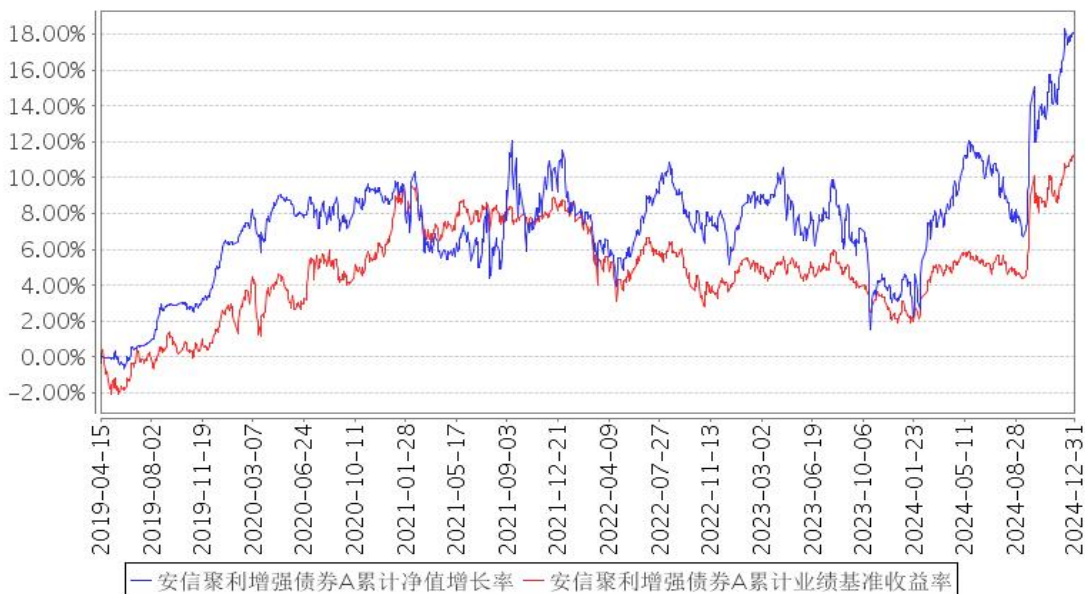
安信聚利增强债券 C

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	3.41%	0.53%	1.85%	0.34%	1.56%	0.19%
过去六个月	6.41%	0.50%	5.45%	0.31%	0.96%	0.19%
过去一年	12.88%	0.44%	7.62%	0.25%	5.26%	0.19%
过去三年	5.14%	0.37%	2.02%	0.23%	3.12%	0.14%
过去五年	10.51%	0.38%	8.46%	0.24%	2.05%	0.14%
自基金合同 生效起至今	16.63%	0.36%	10.98%	0.24%	5.65%	0.12%

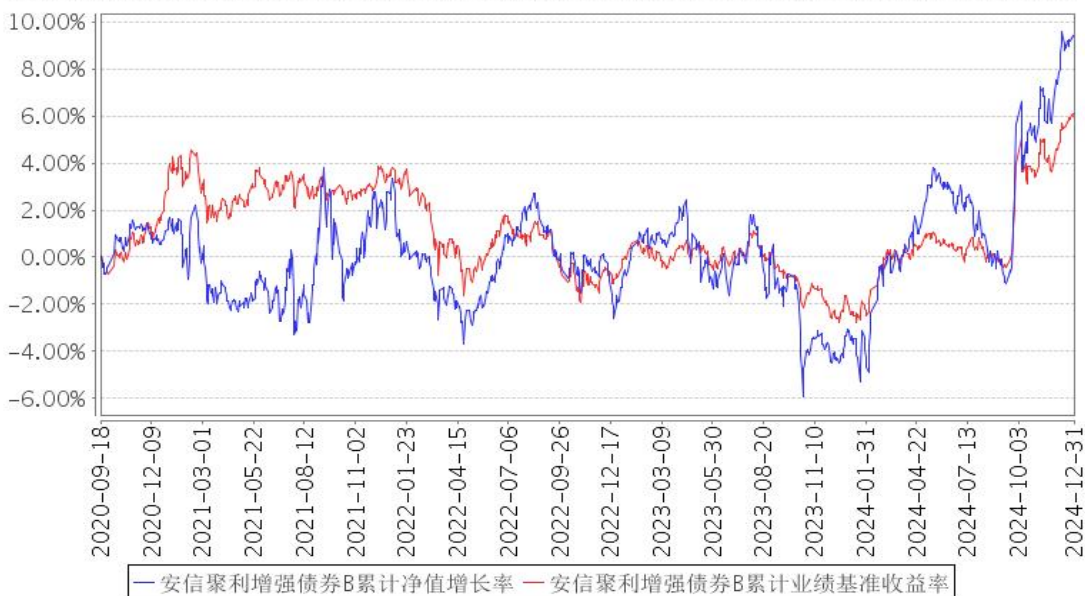
注：报告期内无 B 类份额时，份额净值增长率数据参照 A 类份额计算。

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

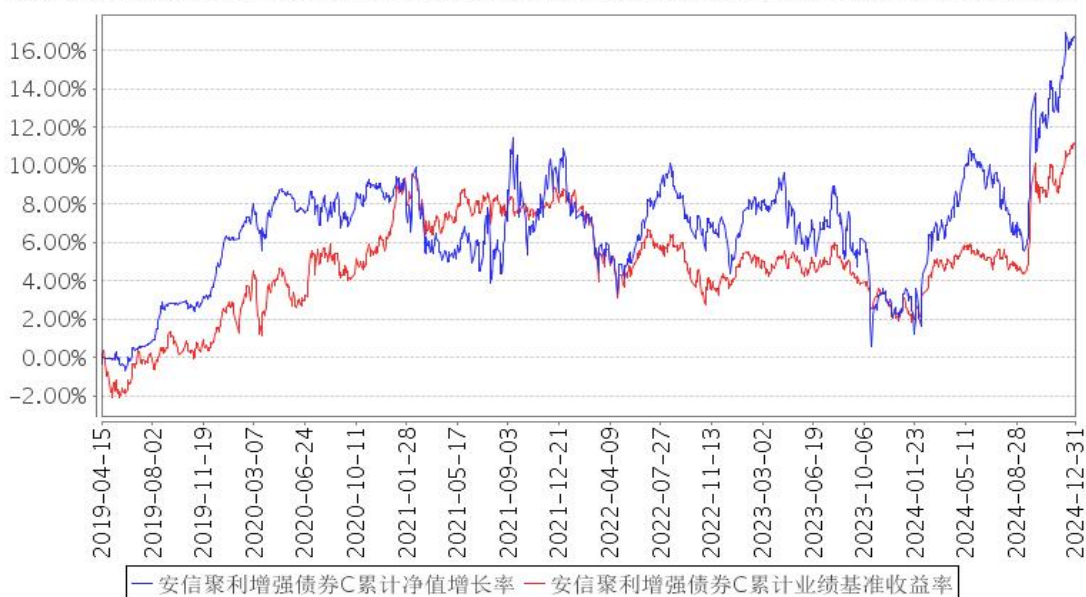
安信聚利增强债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	-	8 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、安信楚盈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	2024 年 2 月 1 日	-	9 年	柴迪伊女士，理学硕士，曾任安信基金管理有限责任公司运营部交易员、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责任公司固定

					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、安信新价值灵活配置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、安信尊享添利率债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

回顾四季度市场表现，上证指数保持平稳，小幅上涨 0.46%，市场情绪显著回暖。中证转债指数在四季度以来上涨 5.55%，表现相对较好。债券市场方面，10 年国债收益率在四季度下行 55bp，

录得 1.66%，显示出市场对流动性宽松政策的积极反应。

从宏观经济来看，在财政与货币政策协同发力，一系列增量政策工具逐步落地的背景下，全年 GDP 增长目标有望顺利实现。具体而言，四季度以来全社会的经济预期有所修复，权益市场成交量明显修复，市场信心也有所回升。从经济层面来看，虽然市场参与者普遍对于未来的贸易冲突有所担忧，但我们对此仍持乐观态度。第一，我国供应链完善，供应链效率极高，是全球制造业最优质的供给，贸易冲突所导致的成本抬升未必是我国企业承担。第二，和 2018 年的贸易冲突的突然性不同，此次贸易冲突对于很多企业来说有所预期，所以企业层面有所准备。从国内政策而言，我们认为适度宽松的货币政策取向对于提振资本市场信心有比较明显的作用，利率未来可能仍将维持适度偏低的位置，低利率环境对于股票市场的估值有所支撑。

投资策略方面，我们增加了偏成长方向的配置，而降低了周期类资产的配置。原因是未来推动我国经济的重要抓手可能是科技突破带来的全要素生产率提升。我们减配了转债，因为在这一价格水平下，转债的性价比有所下降，可能导致组合有更大的回撤风险。我们增加了纯债的配置，在货币政策取向发生改变之前，我们认为纯债都是值得配置的品种。

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 1.1799 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.46%；安信聚利增强债券 B 基金份额净值为 1.1799 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.46%；安信聚利增强债券 C 基金份额净值为 1.1663 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.41%；同期业绩比较基准收益率为 1.85%。

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 10 月 10 日至 2024 年 12 月 25 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	6,940,400.97	3.02
	其中：股票	6,940,400.97	3.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,146,250.71	17.89
	其中：债券	41,146,250.71	17.89
	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	49,997,652.61	21.74
	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	90,117,082.50	39.18
8	其他资产	41,799,683.78	18.17
9	合计	230,001,070.57	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	-	-
B	采矿业	679,350.00	0.32
C	制造业	3,355,757.32	1.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	366,830.00	0.17
E	建筑业	390,000.00	0.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	119,416.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	282,891.65	0.13
J	金融业	1,131,960.00	0.53
K	房地产业	259,532.00	0.12
L	租赁和商务服务业	90,472.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	264,192.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,940,400.97	3.25

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	002078	太阳纸业	65,700	976,959.00	0.46

2	601398	工商银行	112,300	777,116.00	0.36
3	600309	万华化学	6,600	470,910.00	0.22
4	601899	紫金矿业	30,600	462,672.00	0.22
5	601668	中国建筑	65,000	390,000.00	0.18
6	601988	中国银行	64,400	354,844.00	0.17
7	603259	药明康德	4,800	264,192.00	0.12
8	601155	新城控股	21,700	259,532.00	0.12
9	000598	兴蓉环境	32,600	247,434.00	0.12
10	600873	梅花生物	24,300	243,729.00	0.11

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	18,467,200.88	8.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	22,679,049.83	10.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,146,250.71	19.24

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	019749	24 国债 15	113,000	11,387,706.57	5.33
2	113042	上银转债	28,460	3,416,700.19	1.60
3	019742	24 特国 01	28,000	3,178,160.33	1.49
4	113052	兴业转债	23,120	2,609,240.85	1.22
5	113037	紫银转债	20,890	2,321,090.76	1.09

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上银转债（代码：113042 SH）、兴业转债（代码：113052 SH）、华海转债（代码：110076 SH）、G 三峡 EB2（代码：132026 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. 上海银行股份有限公司

2024 年 6 月 7 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款。

2. 兴业银行股份有限公司

2024 年 1 月 22 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2024 年 7 月 25 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局福建监管局罚款。

2024 年 10 月 31 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

3. 浙江华海药业股份有限公司

2024 年 4 月 19 日，浙江华海药业股份有限公司因违规使用募集资金被中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函。

4. 中国长江三峡集团有限公司

2024 年 4 月 30 日，中国长江三峡集团有限公司因涉嫌违反法律法规、噪声污染防治、违反夜间施工作业制度被安徽省六安市裕安区生态环境分局责令改正。

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	10,385.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,789,298.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	41,799,683.78

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	113042	上银转债	3,416,700.19	1.60
2	113052	兴业转债	2,609,240.85	1.22
3	113037	紫银转债	2,321,090.76	1.09
4	110076	华海转债	1,989,722.97	0.93
5	132026	G 三峡 EB2	1,617,322.85	0.76
6	128125	华阳转债	884,968.25	0.41
7	118032	建龙转债	807,263.98	0.38
8	110082	宏发转债	722,090.87	0.34
9	113054	绿动转债	695,627.71	0.33
10	113623	凤 21 转债	666,405.62	0.31
11	128129	青农转债	452,038.34	0.21
12	123200	海泰转债	337,421.42	0.16
13	127105	龙星转债	239,446.30	0.11
14	113653	永 22 转债	237,349.32	0.11
15	118018	瑞科转债	230,940.35	0.11

16	111016	神通转债	228,163.93	0.11
17	118025	奕瑞转债	216,846.69	0.10
18	123233	凯盛转债	214,107.92	0.10
19	128074	游族转债	209,147.69	0.10
20	113064	东材转债	198,109.48	0.09
21	127016	鲁泰转债	190,096.90	0.09
22	128127	文科转债	182,109.05	0.09
23	127104	姚记转债	182,080.27	0.09
24	123197	光力转债	163,785.25	0.08
25	118035	国力转债	148,278.85	0.07
26	123132	回盛转债	138,990.10	0.07
27	118015	芯海转债	135,855.15	0.06
28	110086	精工转债	131,240.36	0.06
29	127078	优彩转债	131,053.72	0.06
30	128121	宏川转债	123,628.21	0.06
31	123109	昌红转债	121,029.23	0.06
32	123210	信服转债	116,746.40	0.05
33	118007	山石转债	115,246.28	0.05
34	113056	重银转债	112,064.34	0.05
35	123113	仙乐转债	111,944.18	0.05
36	127017	万青转债	110,249.33	0.05
37	110089	兴发转债	107,189.49	0.05
38	127042	嘉美转债	106,718.78	0.05
39	123117	健帆转债	100,021.88	0.05
40	123090	三诺转债	96,042.12	0.04
41	127091	科数转债	91,836.60	0.04
42	111018	华康转债	88,027.86	0.04
43	123104	卫宁转债	87,598.77	0.04
44	113639	华正转债	87,520.30	0.04
45	123236	家联转债	84,582.71	0.04
46	118005	天奈转债	84,366.48	0.04
47	127038	国微转债	81,132.78	0.04
48	118010	洁特转债	80,457.19	0.04
49	123215	铭利转债	79,733.84	0.04
50	111007	永和转债	63,377.46	0.03
51	123193	海能转债	61,197.52	0.03
52	113654	永 02 转债	55,539.38	0.03
53	123171	共同转债	55,334.87	0.03
54	127098	欧晶转债	53,931.66	0.03
55	113640	苏利转债	51,983.61	0.02
56	113655	欧 22 转债	49,287.29	0.02
57	128101	联创转债	48,719.22	0.02

58	113545	金能转债	47,513.97	0.02
59	128081	海亮转债	46,288.99	0.02
60	128071	合兴转债	46,253.97	0.02
61	128105	长集转债	42,625.88	0.02
62	128128	齐翔转 2	41,798.89	0.02
63	123199	山河转债	41,674.49	0.02
64	113657	再 22 转债	41,114.17	0.02
65	118000	嘉元转债	38,001.51	0.02
66	118040	宏微转债	33,075.60	0.02
67	123071	天能转债	21,499.36	0.01
68	127044	蒙娜转债	12,985.64	0.01
69	118036	力合转债	10,442.24	0.00
70	113649	丰山转债	7,551.74	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	14,475,760.04	-	37,545,117.09
报告期期间基金总申购份额	18,983,600.53	-	157,545,662.40
减：报告期期间基金总赎回份额	9,278,198.85	-	36,233,699.27
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	24,181,161.72	-	158,857,080.22

§ 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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	23,599,608.16
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	-	-	23,599,608.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-	12.89

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	2024-10-30	23,599,608.16	26,500,000.00	-
合计			23,599,608.16	26,500,000.00	

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 (%)
机构	1	20241030-20241230	-	23,599,608.16	-	23,599,608.16	12.89
	2	20241001-20241029	23,571,331.07	25,698,132.60	23,571,331.07	25,698,132.60	14.04
	3	20241227-20241227	-	16,964,119.09	-	16,964,119.09	9.27

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

2025 年 1 月 20 日