安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金
2024 年年度报告

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

送出日期：2025 年 3 月 28 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 5

3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 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 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 审计报告 16

§7 年度财务报表 18

7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 21

§8 投资组合报告 45

8.1 期末基金资产组合情况 45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
8.3 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 45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
8.6 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 46
8.7 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 46
8.8 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 46
8.9 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 46
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
8.11 投资组合报告附注 47

§9 基金份额持有人信息 49

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
9.3 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 50

§10 开放式基金份额变动 50

§11 重大事件揭示 51

11.1 基金份额持有人大会决议 51
11.2 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 51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
11.4 基金投资策略的改变 51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
11.8 其他重大事件 53

§12 影响投资者决策的其他重要信息 54

12.1 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 54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 54

§13 备查文件目录 55

13.1 备查文件目录 55
13.2 存放地点 55
13.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金	
基金简称	安信 90 天滚动持有债券	
基金主代码	020391	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 17 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	
报告期末基金份额总额	125,510,096.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信 90 天滚动持有债券 A	安信 90 天滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	020391	020392
报告期末下属分级基金的份额总额	31,634,499.19 份	93,875,597.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、类属配置策略、个券选择策略、信用债投资策略、国债期货投资策略、可转换和可交换债券投资策略等策略。在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙晓奇	张姗
	联系电话	0755-82509999	400-61-95555
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4008-088-088	400-61-95555
传真	0755-82799292	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518026	518040
法定代表人	刘入领	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	
	安信 90 天滚动持有债券 A	安信 90 天滚动持有债券 C
本期已实现收益	1,417,661.90	8,901,347.06
本期利润	1,646,954.25	10,435,846.98
加权平均基金份额本期利润	0.0485	0.0444
本期加权平均净值利润率	4.74%	4.36%
本期基金份额净值增长率	4.88%	4.67%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
期末可供分配利润	1,328,635.72	3,746,701.52
期末可供分配基金份额利润	0.0420	0.0399
期末基金资产净值	33,179,246.02	98,263,559.85
期末基金份额净值	1.0488	1.0467
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	
基金份额累计净值增长率	4.88%	4.67%

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。

4、本基金合同生效日为 2024 年 1 月 17 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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 90 天滚动持有债券 A

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
过去三个月	2.15%	0.07%	1.86%	0.08%	0.29%	-0.01%
过去六个月	2.23%	0.06%	2.15%	0.08%	0.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.88%	0.06%	4.13%	0.07%	0.75%	-0.01%

安信 90 天滚动持有债券 C

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
过去三个月	2.10%	0.07%	1.86%	0.08%	0.24%	-0.01%
过去六个月	2.13%	0.06%	2.15%	0.08%	-0.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.67%	0.06%	4.13%	0.07%	0.54%	-0.01%

注：根据《安信 90 天滚动持有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*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。中债综合全价（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。一年期定期存款利率（税后）为中国人民银行公开发布，具有较强的权威性和市场影响力。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。

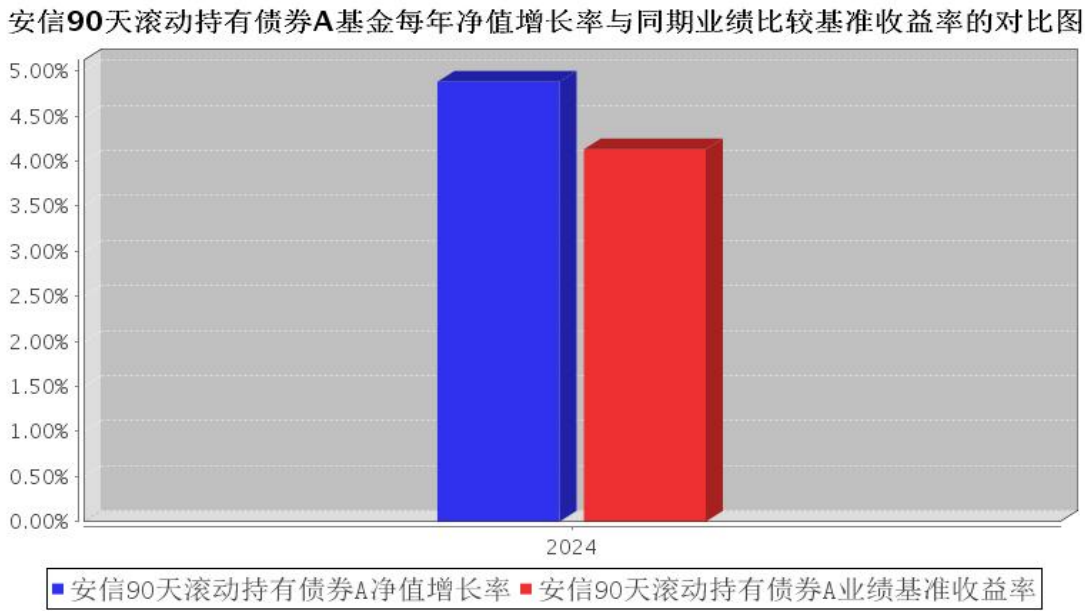
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

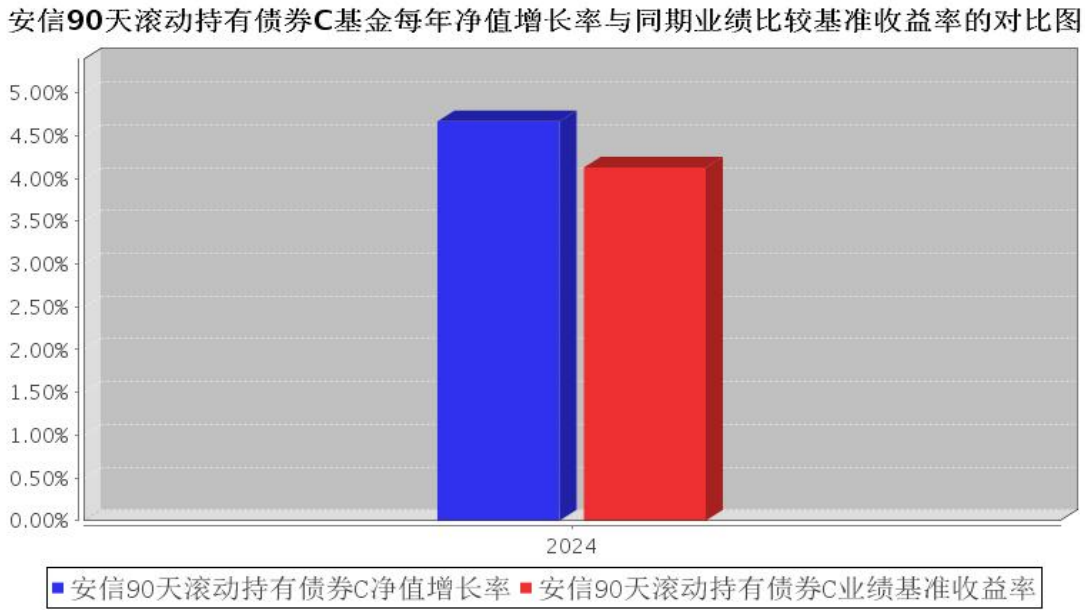
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、本基金基金合同生效日为 2024 年 1 月 17 日，截至本报告末本基金合同生效未满一年。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2024年1月17日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 95 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、安信远见稳进一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金、安信医药创新股票型发起式证券投资基金、安信周期优选股票型发起式证券投资基金。

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		
张睿	本基金的	2024 年 1	-	17 年	张睿先生，经济学硕士，历任中国农业银

	基金经理，固定收益部总经理	月 17 日			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。
宛晴	本基金的基金经理助理	2024 年 1 月 24 日	-	11 年	宛晴女士，工商管理硕士，历任东兴证券股份有限公司资产管理业务总部交易员、交易主管、投资经理助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信新目标灵活配置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、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信鑫安得利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、安信新优选灵活配置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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理；安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信 60 天滚动持有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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 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。

4.3.3 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 年国内经济总体平稳运行，外部环境依旧复杂多变，我国仍处在产业结构转型的过渡期，有效需求不足是现阶段困扰国内经济的核心问题，三季度以来政策刺激力度有所提升。

海外方面，随着全球通胀从高位回落，各主要国家央行陆续放松货币政策，全球经济复苏有所放缓，同时存在一定分化。分区域看，新兴发展国家和发展中国家的经济增速仍高于发达经济体，发达经济体呈现“美强欧弱”格局。美国经济年初以来突显韧性但三季度显现降温迹象，通

胀压力有所放缓，美联储开启降息，缓解了美国市场的流动性压力，经济软着陆预期升温。美元指数全年反复震荡，四季度大幅反弹。国内方面，一季度国内经济稳中有升，制造业投资表现强劲，出口在外需支撑下大幅回升，消费总体景气。二季度以后经济复苏动能呈现放缓态势，主要受新增专项债发行节奏偏慢、房地产低迷、消费和融资需求走弱影响，制造业 PMI 连续 5 个月位于荣枯线以下。伴随“924”新政和政治局会议释放积极信号，四季度经济呈现结构性改善，投资同比降幅收窄，制造业投资和基建投资维持较高增速、地产投资继续寻底，出口保持韧性，消费有明显回升，物价和企业融资需求仍待修复。政策方面，政府针对经济形势采用积极的应对措施，央行年内两次下调存款准备金率，两次下调 LPR 利率，在人民币汇率承压的阶段，央行持续传递稳定汇率的决心；同时 2024 年财政投放的力度加大，全年发行地方政府专项债 4 万亿元和超长期特别国债 1 万亿元，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及“提高财政赤字率”和“适时降准降息”。

2024 年债券市场走势分为四个阶段，第一个阶段年初至 4 月，受风险偏好降温、债券供求失衡、机构行为等因素的影响债券收益率呈单边下行态势，收益率曲线平坦化，超长期国债收益率显著下行突破历史低位，央行提示市场关注利率风险；第二个阶段 4 月底至 8 月初，由于银行手工补息被叫停，“存款搬家”引发资金大量流入非银固收产品，推升了信用债的配置，期间信用债情绪好于利率债，信用利差显著收窄，7 月央行超预期降息后收益率进一步下行；第三个阶段 8 月初至 10 月底，随着央行对市场的调控升级，叠加政府债发行提速和广义基金规模增长放缓，债券交易显著降温，信用债券情绪转弱，在“924”会议后风险偏好大幅升温，引发对债券市场的挤兑，信用债被集中抛售，信用利差走阔；第四个阶段 10 月底至年底，在增量财政政策符合预期、货币政策基调转向适度宽松、年末机构抢跑等多重因素的影响下，债券市场情绪较强，12 月在非银同业存款新规落地后进一步打开收益率下行空间，绝大多数品种收益率创历史新低。2024 年可转债市场经历震荡行情，期间“国九条”落地、部分转债评级调整和多起风险事件，触发市场对转债退市及违约风险的担忧，机构重仓品种经历流动性挤兑，5-9 月转债市场连续调整，9 月末在权益市场回暖后估值显著修复，全年来看高评级、大盘可转债表现较强。

回顾全年操作，本基金主要配置高等级信用债和利率债，上半年完成建仓，三季度逐步降低组合久期和债券的持仓比例，临近 9 月末消除了杠杆，四季度增加了利率债的仓位比例，提升组合久期。报告期间通过利率债和可转债波段交易增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信 90 天滚动持有债券 A 基金份额净值为 1.0488 元，本报告期基金份额净

值增长率为 4.88%；安信 90 天滚动持有债券 C 基金份额净值为 1.0467 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.67%；同期业绩比较基准收益率为 4.13%。

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 2025 年，预计财政政策着力扩大内需，货币政策维持适度宽松，整体利率中枢或较 2024 年略有下行。

宏观经济方面，预计 2025 年一季度受益于财政政策前置支持和“抢出口”效应，国内经济将延续改善，随着美国加征关税对出口的挑战增大，二季度以后经济复苏动能或面临放缓，下半年若地产和消费相关的增量刺激政策加码落地，有望带动内需进一步修复，经济复苏动能提升。政策方面，在国内经济尚未全面复苏时，预计不会看到货币政策的转向，流动性环境整体仍有望维持中性偏宽松状态，伴随降准降息落地，债券收益率的下行空间有望打开，同时货币政策配合财政发力，因此流动性将不会过于宽松。全年来看债券收益率的中枢或将小幅下行，期间伴随政策预期和经济数据的修正，叠加风险偏好的提升，债券市场的波动可能将增大。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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，本基金本报告期未进行利润分配。

4.9 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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“安信 90 天滚动持有债券基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了安信 90 天滚动持有债券基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信 90 天滚动持有债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	安信 90 天滚动持有债券基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括安信 90 天滚动持有债券基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估安信 90 天滚

	动持有债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算安信 90 天滚动持有债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督安信 90 天滚动持有债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信 90 天滚动持有债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信 90 天滚动持有债券基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰　　罗佳
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	360,717.41
结算备付金		692,541.93
存出保证金		3,874.28
交易性金融资产	7.4.7.2	153,904,539.02
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		153,904,539.02
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		625,387.15
应收股利		-
应收申购款		321,250.75
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		155,908,310.54
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		24,101,874.80
应付清算款		-
应付赎回款		154,615.81
应付管理人报酬		22,059.11
应付托管费		5,514.77
应付销售服务费		16,470.58
应付投资顾问费		-
应交税费		4,445.60
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	160,524.00
负债合计		24,465,504.67
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	125,510,096.54
未分配利润	7.4.7.8	5,932,709.33
净资产合计		131,442,805.87
负债和净资产总计		155,908,310.54

注：1、本基金合同生效日为 2024 年 1 月 17 日,本报告期自基金合同生效日 2024 年 1 月 17 日起至 2024 年 12 月 31 日止，无上年度可比期间。

2、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 125,510,096.54 份，其中安信 90 天滚动持有债券 A 基金份额总额 31,634,499.19 份，基金份额净值 1.0488 元；安信 90 天滚动持有债券 C 基金份额总额 93,875,597.35 份，基金份额净值 1.0467 元。

7.2 利润表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		13,636,739.17
1.利息收入		398,053.87
其中：存款利息收入	7.4.7.9	150,060.25
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		247,993.62
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,474,893.03
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	12,002,427.04
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-527,534.01
股利收益	7.4.7.15	-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,763,792.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、营业总支出		1,553,937.94
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	527,915.32
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	7.4.10.2.2	131,978.82
3．销售服务费	7.4.10.2.3	461,545.32
4．投资顾问费		-
5．利息支出		236,768.15
其中：卖出回购金融资产支出		236,768.15
6．信用减值损失	7.4.7.18	-
7．税金及附加		8,196.42
8．其他费用	7.4.7.19	187,533.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,082,801.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,082,801.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		12,082,801.23

7.3 净资产变动表

会计主体：安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	476,661,434.30	-	-	476,661,434.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-351,151,337.76	-	5,932,709.33	-345,218,628.43
（一）、综合收益总额	-	-	12,082,801.23	12,082,801.23
（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）	-351,151,337.76	-	-6,150,091.90	-357,301,429.66
其中：1.基金申购款	101,432,472.43	-	2,242,569.58	103,675,042.01

2.基金赎回款	-452,583,810.19	-	-8,392,661.48	-460,976,471.67
（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	125,510,096.54	-	5,932,709.33	131,442,805.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信 90 天滚动持有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”)证监许可[2023]2781 号《关于准予安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》核准，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 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,549,138.66 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0008 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 476,661,434.30 份，其中认购资金利息折合 112,295.64 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日或基金份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 90 天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止，以此类推。在每份基金份额的每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。在每份基金份额的每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该基金份额将自该运作期到期日下一日起自

动进入下一个运作期。

根据《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》和《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信 90 天滚动持有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、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、国债期货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）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因可转换债券转股、可交换债券换股所形成的股票。因上述原因持有的股票等资产，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。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%，本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国

证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）起至 2024 年 12 月 31 日止期间的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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处

于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3）该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	360,717.41
等于：本金	360,574.18
加：应计利息	143.23
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	360,717.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 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	65,246,480.61	800,271.65	66,861,704.55	814,952.29
	银行间市场	85,156,010.02	937,984.47	87,042,834.47	948,839.98
	合计	150,402,490.63	1,738,256.12	153,904,539.02	1,763,792.27
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		150,402,490.63	1,738,256.12	153,904,539.02	1,763,792.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	16,224.00

其中：交易所市场	-
银行间市场	16,224.00
应付利息	-
应付信息披露费	110,000.00
应付审计费	25,000.00
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	160,524.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信 90 天滚动持有债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	37,993,342.85	37,993,342.85
本期申购	2,808,987.45	2,808,987.45
本期赎回（以“-”号填列）	-9,167,831.11	-9,167,831.11
本期末	31,634,499.19	31,634,499.19

安信 90 天滚动持有债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	438,668,091.45	438,668,091.45
本期申购	98,623,484.98	98,623,484.98
本期赎回（以“-”号填列）	-443,415,979.08	-443,415,979.08
本期末	93,875,597.35	93,875,597.35

注：1、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）。

2、本基金自 2024 年 1 月 2 日至 2024 年 1 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 476,549,138.66 元，折合为 476,549,138.66 份基金份额(其中 A 类基金份额 37,975,254.91 份，C 类基金份额 438,573,883.75 份)。根据《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 112,295.64 元在本基金成立后，折合为 112,295.64 份基金份额(其中 A 类基金份额 18,087.94 份，C 类基金份额 94,207.70 份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》及《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告》的相关规定，本基金于 2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 2 月 27 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、转换转入和定期定额投资业务自 2024 年 2 月 28 日起开始

办理，赎回和转换转出业务自 2024 年 4 月 16 日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信 90 天滚动持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,417,661.90	229,292.35	1,646,954.25
本期基金份额交易产生的变动数	-89,026.18	-13,181.24	-102,207.42
其中：基金申购款	53,515.48	6,937.60	60,453.08
基金赎回款	-142,541.66	-20,118.84	-162,660.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,328,635.72	216,111.11	1,544,746.83

安信 90 天滚动持有债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	8,901,347.06	1,534,499.92	10,435,846.98
本期基金份额交易产生的变动数	-5,154,645.54	-893,238.94	-6,047,884.48
其中：基金申购款	2,071,796.96	110,319.54	2,182,116.50
基金赎回款	-7,226,442.50	-1,003,558.48	-8,230,000.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,746,701.52	641,260.98	4,387,962.50

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	24,731.47
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	125,052.69
其他	276.09
合计	150,060.25

7.4.7.10 股票投资收益

本基金于本期无股票投资收益。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	6,031,225.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,971,201.58
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	12,002,427.04

7.4.7.11.2 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17日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,130,370,207.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,115,570,839.81
减：应计利息总额	8,789,846.33
减：交易费用	38,320.24
买卖债券差价收入	5,971,201.58

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-527,534.01

7.4.7.15 股利收益

本基金于本期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,763,792.27
股票投资	-
债券投资	1,763,792.27
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	1,763,792.27

7.4.7.17 其他收入

本基金于本期无其他收入。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费用	19,633.91
银行间账户维护费	32,500.00
其他	400.00
合计	187,533.91

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	527,915.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	261,407.51
应支付基金管理人的净管理费	266,507.81

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的基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,978.82

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×0.05%/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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信 90 天滚动持有债券 A	安信 90 天滚动持有债券 C	合计
国投证券	-	17.12	17.12
招商银行	-	460,198.55	460,198.55
合计	-	460,215.67	460,215.67

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日			
银行间市场交易的	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	136,250,000.00	10,343.55

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未投资本基金。

7.4.10.6 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 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	360,717.41	24,731.47

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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 24,101,874.80 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
230302	23 进出 02	2025 年 1 月 2 日	101.95	100,000	10,194,726.03
240011	24 附息国债 11	2025 年 1 月 2 日	105.46	54,000	5,694,948.89
240015	24 附息国债 15	2025 年 1 月 2 日	100.78	100,000	10,077,616.44
合计				254,000	25,967,291.36

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无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，无抵押债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于 2024 年 12 月 31 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 48.73%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	18,643,092.60
合计	18,643,092.60

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。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日
AAA	42,569,045.47
AAA 以下	6,033,645.93
未评级	86,658,755.02
合计	135,261,446.42

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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可根据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	360,717.41	-	-	-	360,717.41
结算备付金	692,541.93	-	-	-	692,541.93

存出保证金	3,874.28	-	-	-	3,874.28
交易性金融资产	42,745,133.40	55,814,332.91	55,345,072.71	-	153,904,539.02
应收申购款	-	-	-	321,250.75	321,250.75
应收清算款	-	-	-	625,387.15	625,387.15
资产总计	43,802,267.02	55,814,332.91	55,345,072.71	946,637.90	155,908,310.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	154,615.81	154,615.81
应付管理人报酬	-	-	-	22,059.11	22,059.11
应付托管费	-	-	-	5,514.77	5,514.77
卖出回购金融资产款	24,101,874.80	-	-	-	24,101,874.80
应付销售服务费	-	-	-	16,470.58	16,470.58
应交税费	-	-	-	4,445.60	4,445.60
其他负债	-	-	-	160,524.00	160,524.00
负债总计	24,101,874.80	-	-	363,629.87	24,465,504.67
利率敏感度缺口	19,700,392.22	55,814,332.91	55,345,072.71	583,008.03	131,442,805.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,524,413.49
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,489,957.95

7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	11,071,009.85
第二层次	142,833,529.17
第三层次	-
合计	153,904,539.02

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	153,904,539.02	98.71
	其中：债券	153,904,539.02	98.71
	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	1,053,259.34	0.68
8	其他各项资产	950,512.18	0.61
9	合计	155,908,310.54	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未买入或卖出股票。

8.5 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	69,114,856.12	52.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,434,377.91	31.52
	其中：政策性金融债	20,743,279.01	15.78
4	企业债券	17,424,363.74	13.26
5	企业短期融资券	8,162,371.50	6.21
6	中期票据	6,697,559.90	5.10
7	可转债（可交换债）	11,071,009.85	8.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	153,904,539.02	117.09

8.6 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	240006	24 附息国债 06	100,000	10,594,153.42	8.06
2	148575	24 一创 01	100,000	10,443,296.44	7.95
3	230302	23 进出 02	100,000	10,194,726.03	7.76
4	240015	24 附息国债 15	100,000	10,077,616.44	7.67
5	019748	24 国债 14	90,000	9,286,163.01	7.06

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。基金管理人将以套期保值为目的，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。

8.10.2 本期国债期货投资评价

本期通过国债期货对持仓的长久期债券进行套期保值，符合既定的投资策略和投资目标。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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 国开 15（代码：240215 CY）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。

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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	3,874.28
2	应收清算款	625,387.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	321,250.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	950,512.18

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	2,179,997.26	1.66
2	113042	上银转债	600,263.56	0.46

3	127024	盈峰转债	541,694.11	0.41
4	113056	重银转债	514,316.35	0.39
5	113052	兴业转债	451,425.75	0.34
6	113053	隆 22 转债	424,411.95	0.32
7	128129	青农转债	328,357.15	0.25
8	123107	温氏转债	280,107.30	0.21
9	113069	博 23 转债	230,589.63	0.18
10	123169	正海转债	211,871.28	0.16
11	127045	牧原转债	181,065.36	0.14
12	113663	新化转债	180,514.57	0.14
13	123120	隆华转债	143,141.12	0.11
14	123184	天阳转债	135,455.03	0.10
15	111016	神通转债	129,371.30	0.10
16	123211	阳谷转债	127,543.13	0.10
17	113632	鹤 21 转债	125,049.90	0.10
18	127050	麒麟转债	124,617.83	0.09
19	128130	景兴转债	120,927.36	0.09
20	127043	川恒转债	119,751.16	0.09
21	127103	东南转债	118,264.49	0.09
22	111008	沿浦转债	117,251.51	0.09
23	127052	西子转债	116,900.58	0.09
24	113631	皖天转债	116,277.56	0.09
25	118046	诺泰转债	116,062.97	0.09
26	113685	升 24 转债	116,055.83	0.09
27	127053	豪美转债	115,955.63	0.09
28	128133	奇正转债	115,718.04	0.09
29	113681	镇洋转债	115,680.59	0.09
30	110079	杭银转债	114,891.15	0.09
31	123121	帝尔转债	114,614.27	0.09
32	113033	利群转债	114,464.93	0.09
33	127070	大中转债	114,237.58	0.09
34	128132	交建转债	114,062.47	0.09
35	113651	松霖转债	113,662.25	0.09
36	128144	利民转债	112,224.66	0.09
37	123149	通裕转债	111,888.53	0.09
38	123191	智尚转债	111,386.92	0.08
39	113641	华友转债	103,684.48	0.08
40	127022	恒逸转债	98,633.42	0.08
41	111007	永和转债	97,503.78	0.07
42	127032	苏行转债	96,820.08	0.07
43	113068	金铜转债	93,527.27	0.07
44	123145	药石转债	76,986.69	0.06
45	123063	大禹转债	76,910.57	0.06
46	113625	江山转债	76,687.45	0.06

47	127035	濮耐转债	76,515.95	0.06
48	113584	家悦转债	76,146.52	0.06
49	113646	永吉转债	74,356.84	0.06
50	113549	白电转债	63,348.01	0.05
51	118013	道通转债	49,479.02	0.04
52	123178	花园转债	49,307.95	0.04
53	113050	南银转债	46,773.37	0.04
54	123228	震裕转债	45,148.62	0.03
55	123222	博俊转债	43,263.25	0.03
56	127105	龙星转债	33,578.06	0.03
57	110084	贵燃转债	31,849.07	0.02
58	113679	芯能转债	10,830.34	0.01
59	123183	海顺转债	3,321.34	0.00

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
安信 90 天滚动持有债券 A	172	183,921.51	0.00	0.00	31,634,499.19	100.00
安信 90 天滚动持有债券 C	634	148,068.77	2,440,929.51	2.60	91,434,667.84	97.40
合计	787	159,479.16	2,440,929.51	1.94	123,069,167.03	98.06

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	安信 90 天滚动持有债券 A	11,092.75	0.04
	安信 90 天滚动持有债券 C	108.32	0.00
	合计	11,201.07	0.01

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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	份额级别	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	安信 90 天滚动持有债券 A	0
	安信 90 天滚动持有债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信 90 天滚动持有债券 A	0
	安信 90 天滚动持有债券 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信 90 天滚动持有债券 A	安信 90 天滚动持有债券 C
基金合同生效日（2024 年 1 月 17 日）基金份额总额	37,993,342.85	438,668,091.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,808,987.45	98,623,484.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	9,167,831.11	443,415,979.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,634,499.19	93,875,597.35

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 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、基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金改聘会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）自 2024 年 11 月 11 日起为本基金提供审计服务，本年度应支付审计费为人民币 25,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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(%)	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

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相应的内部管理规定，明确了证券公司提供证券交易及研究服务的准入标准和程序。准入标准主要包括财务状况、经营行为规范、合规风控能力、交易能力及研究服务能力。对于拟新增合作的证券公司，管理人开展尽职调查，并根据调查结果发起内部评估流程，评估通过后签订合作协议。

本基金管理人根据规定于 2024 年 7 月 1 日调整了交易佣金费率，调整后被动股票型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

11.7.2 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	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

		例(%)		比例(%)		
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	876,673,885.25	100.00	1,653,438,000.00	100.00	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券日报	2024 年 1 月 18 日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 2 月 21 日
3	安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报	2024 年 2 月 26 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 3 月 7 日
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 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告	证券日报	2024 年 4 月 12 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旗下 89 只基金 2024 年第 2 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 7 月 18 日

11	安信基金管理有限责任公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 8 月 23 日
12	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年中期报告提示性公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 8 月 29 日
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下 92 只基金 2024 年第 3 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 10 月 24 日
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 11 月 13 日
15	安信基金管理有限责任公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报,证券时报,中国证券报,上海证券报	2024 年 11 月 22 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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（%）
个人	1	20241017-20241231	30,017,500.00	-	-	30,017,500.00	23.92
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。						

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金募集的文件；

2、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；

3、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；

4、《安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》；

5、中国证监会要求的其它文件。

13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 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 3 月 28 日