

# 安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告

2025 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：2025 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 2025 年 4 月 18 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 2025 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 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  |                 |
| 报告期末基金份额总额  | 603,561,293.92 份   |                 |
| 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。 |                 |
| 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 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 | 518,775,050.20 份 | 84,786,243.72 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（2025 年 1 月 1 日-2025 年 3 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 |
| 1. 本期已实现收益      | 830,825.35                          | 1,438,141.66    |
| 2. 本期利润         | 413,200.36                          | 276,194.46      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0049                              | 0.0033          |
| 4. 期末基金资产净值     | 546,427,425.92                      | 89,084,343.12   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0533                              | 1.0507          |

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 90 天滚动持有债券 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      | 0.43%  | 0.09%     | -0.88%     | 0.09%         | 1.31% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 2.59%  | 0.08%     | 0.97%      | 0.09%         | 1.62% | -0.01% |
| 过去一年       | 4.23%  | 0.07%     | 2.18%      | 0.08%         | 2.05% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.33%  | 0.07%     | 3.22%      | 0.08%         | 2.11% | -0.01% |

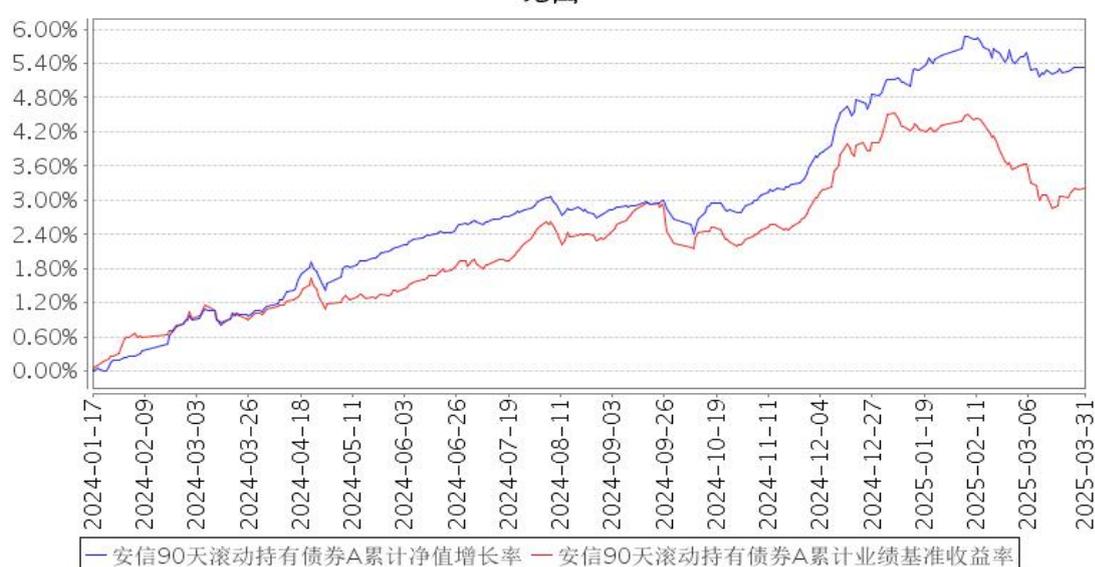
安信 90 天滚动持有债券 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

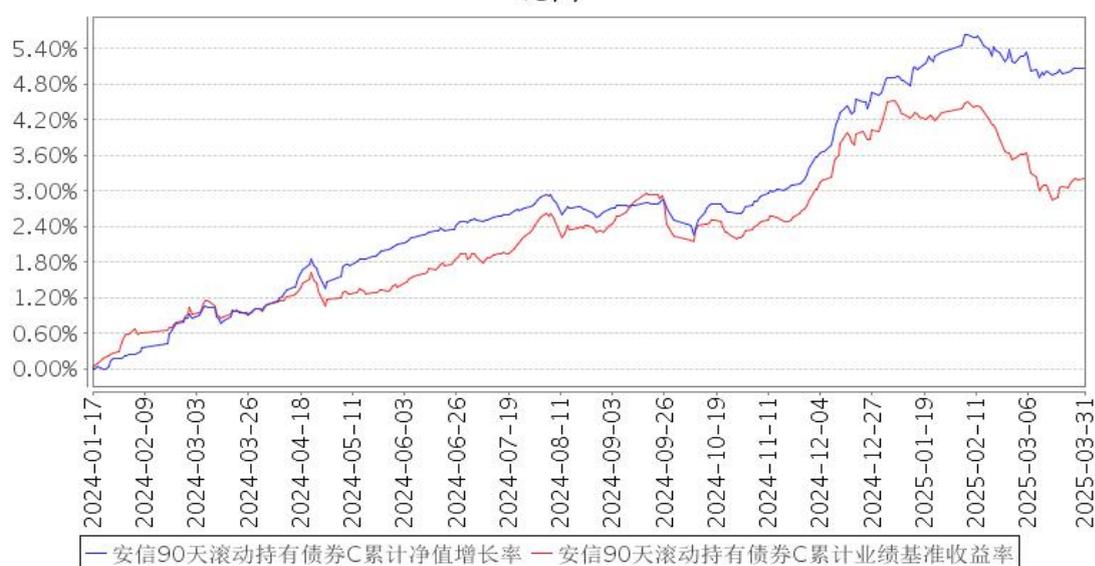
|            |       |       |        |       |       |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.38% | 0.09% | -0.88% | 0.09% | 1.26% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 2.49% | 0.08% | 0.97%  | 0.09% | 1.52% | -0.01% |
| 过去一年       | 4.01% | 0.07% | 2.18%  | 0.08% | 1.83% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.07% | 0.07% | 3.22%  | 0.08% | 1.85% | -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90天滚动持有债券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90天滚动持有债券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2024年1月17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。

## § 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 1 月 17 日 | -    | 18 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

2025 年一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，期间多数宏观指标符合市场预期。美联储暂缓降息态度转鹰、央行“择机降准降息”，人民币汇率年初承压、随着央行稳汇率有所缓解，中美利差先走阔后收敛。海外方面，一季度美国经济保持韧性，但增长动能呈现边际放缓的迹象，特朗普关税政策的反复可能引发再通胀，市场对美国滞涨风险的担忧升温；欧洲经济受到德国及欧盟财政转向的提振，正在从俄乌冲突造成的衰退中恢复，“美强欧弱”格局有望被打破。美元指数显著走弱，美债收益率呈现震荡下行。

国内方面，基本面呈现弱修复，制造业 PMI 连续 2 个月保持在扩张区间，供需两端复苏动能在政策发力下均有所提升、但价格指数持续走弱，反映了现阶段经济内生动能仍待改善。具体来看，投资同比增速较上季度小幅回升，其中制造业投资小幅回落但在外需支撑下仍保持高速增长；基建投资受财政发力靠前和地方债化债工作加速推进的影响增速显著提升；房地产投资同比降幅较上季度略有收窄。消费方面，社零同比增速小幅回升，其中餐饮收入同比增速有明显上升，消费结构上仍呈现服务消费强于商品消费。出口增速有所下行，主要受“抢出口”透支需求、关税扰动和高基数的影响，未来在美国加征关税的影响下不确定性加大。新增社融连续同比多增、结构上主要受政府债发行的支撑，信贷数据实现“开门红”后有所转弱，表明现阶段实体部门融资需求虽有所修复、但仍整体偏弱，居民部门购房和消费意愿仍有待提升。通胀数据持续低位，CPI 受食品项拖累由正转负，PPI 同比连续 29 个月为负。政策方面，两会延续了政治局会议和中央经济工作会议对货币政策的基调。一季度央行未开展降准降息操作，并连续 3 个月未开展国债买卖操作，通过买断式逆回购累计投放 3.9 万亿元。3 月央行公告将 MLF 改为固定数量、利率招标、多重价位中标的方式，标志着 MLF 的政策利率属性退出历史舞台。

债券市场一季度在资金面持续紧张和风险偏好抬升的双重影响下经历显著调整、波动较上季

度加大，收益率曲线呈现平坦化上行，信用利差经历先走阔后收窄、分化显著，短期限信用债与国债的利差大幅收窄、长期信用债与国债的利差小幅走阔。转债市场一季度延续强势表现，中证转债指数上涨 3.48%，小盘转债表现好于大盘转债，股性转债表现好于债性转债。

报告期内，本基金主要配置中高等级信用债和利率债，较上季度降低利率债和可转债的持仓比例、增加信用债和同业存单的持仓比例，降低组合久期并消除了杠杆，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 90 天滚动持有债券 A 基金份额净值为 1.0533 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；安信 90 天滚动持有债券 C 基金份额净值为 1.0507 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.38%；同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

#### 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            | 581,740,720.23 | 89.79        |
|    | 其中：债券             | 581,740,720.23 | 89.79        |
|    | 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          | 29,002,958.90  | 4.48         |
|    | 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      | 874,449.31     | 0.13         |
| 8  | 其他资产              | 36,278,344.02  | 5.60         |
| 9  | 合计                | 647,896,472.46 | 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

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      | 41,589,199.86  | 6.54         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 205,760,538.07 | 32.38        |
|    | 其中：政策性金融债 | 131,617,866.24 | 20.71        |
| 4  | 企业债券      | 44,207,338.97  | 6.96         |
| 5  | 企业短期融资券   | 168,048,876.00 | 26.44        |
| 6  | 中期票据      | 61,724,487.70  | 9.71         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 15,605,852.40  | 2.46         |
| 8  | 同业存单      | 44,804,427.23  | 7.05         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 581,740,720.23 | 91.54        |

### 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  | 230302    | 23 进出 02         | 300,000 | 30,647,013.70 | 4.82         |
| 2  | 230202    | 23 国开 02         | 300,000 | 30,386,301.37 | 4.78         |
| 3  | 180206    | 18 国开 06         | 290,000 | 30,373,741.92 | 4.78         |
| 4  | 250214    | 25 国开 14         | 300,000 | 30,045,675.00 | 4.73         |
| 5  | 112509088 | 25 浦发银行<br>CD088 | 300,000 | 29,868,373.70 | 4.70         |

### 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。

### 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 23 国开 02(代码: 230202 CY)、18 国开 06(代码: 180206 CY)、25 国开 14(代码: 250214 CY)、23 长沙农商小微债 01 代码: 2321002 CY)、24 国君 C4(代码: 242017 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. 长沙农村商业银行股份有限公司

2024 年 10 月 12 日，长沙农村商业银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国人民银行湖南省分行罚款。

#### 3. 国泰君安证券股份有限公司

2024 年 10 月 11 日，国泰君安证券股份有限公司因未依法履行职责被全国中小企业股份转让系统有限责任公司要求提交书面承诺。

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   | 5,467.04      |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,859,919.39  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 31,412,957.59 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 36,278,344.02 |

### 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  | 110059 | 浦发转债    | 3,266,067.12 | 0.51         |
| 2  | 113056 | 重银转债    | 735,634.72   | 0.12         |
| 3  | 113632 | 鹤 21 转债 | 643,010.90   | 0.10         |
| 4  | 123169 | 正海转债    | 636,580.26   | 0.10         |
| 5  | 127052 | 西子转债    | 627,541.45   | 0.10         |
| 6  | 113065 | 齐鲁转债    | 583,640.88   | 0.09         |
| 7  | 113042 | 上银转债    | 551,353.60   | 0.09         |
| 8  | 127050 | 麒麟转债    | 519,638.60   | 0.08         |
| 9  | 113663 | 新化转债    | 479,460.84   | 0.08         |
| 10 | 110093 | 神马转债    | 440,181.08   | 0.07         |
| 11 | 113052 | 兴业转债    | 420,956.38   | 0.07         |
| 12 | 113058 | 友发转债    | 402,352.50   | 0.06         |
| 13 | 123187 | 超达转债    | 371,307.57   | 0.06         |
| 14 | 113050 | 南银转债    | 346,918.91   | 0.05         |
| 15 | 123061 | 航新转债    | 287,495.10   | 0.05         |
| 16 | 113677 | 华懋转债    | 282,683.70   | 0.04         |
| 17 | 123178 | 花园转债    | 282,225.88   | 0.04         |
| 18 | 113676 | 荣 23 转债 | 277,220.95   | 0.04         |
| 19 | 113045 | 环旭转债    | 246,290.15   | 0.04         |
| 20 | 123120 | 隆华转债    | 240,961.47   | 0.04         |
| 21 | 113069 | 博 23 转债 | 226,111.34   | 0.04         |
| 22 | 123244 | 松原转债    | 213,963.40   | 0.03         |
| 23 | 113641 | 华友转债    | 199,191.70   | 0.03         |
| 24 | 111007 | 永和转债    | 183,360.32   | 0.03         |
| 25 | 118004 | 博瑞转债    | 182,918.48   | 0.03         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 26 | 123147 | 中辰转债    | 179,423.81 | 0.03 |
| 27 | 123217 | 富仕转债    | 176,771.40 | 0.03 |
| 28 | 111016 | 神通转债    | 173,877.83 | 0.03 |
| 29 | 128129 | 青农转债    | 143,078.74 | 0.02 |
| 30 | 123145 | 药石转债    | 142,596.56 | 0.02 |
| 31 | 123211 | 阳谷转债    | 138,131.78 | 0.02 |
| 32 | 110079 | 杭银转债    | 127,461.84 | 0.02 |
| 33 | 128131 | 崇达转 2   | 121,042.46 | 0.02 |
| 34 | 111020 | 合顺转债    | 106,384.72 | 0.02 |
| 35 | 123243 | 严牌转债    | 105,006.05 | 0.02 |
| 36 | 123063 | 大禹转债    | 95,382.60  | 0.02 |
| 37 | 118041 | 星球转债    | 94,426.90  | 0.01 |
| 38 | 113666 | 爱玛转债    | 90,419.77  | 0.01 |
| 39 | 113068 | 金铜转债    | 89,749.91  | 0.01 |
| 40 | 127103 | 东南转债    | 87,878.47  | 0.01 |
| 41 | 123239 | 锋工转债    | 77,901.56  | 0.01 |
| 42 | 113037 | 紫银转债    | 74,809.97  | 0.01 |
| 43 | 128141 | 旺能转债    | 70,958.29  | 0.01 |
| 44 | 118028 | 会通转债    | 70,767.12  | 0.01 |
| 45 | 113675 | 新 23 转债 | 70,420.85  | 0.01 |
| 46 | 128144 | 利民转债    | 70,363.04  | 0.01 |
| 47 | 128105 | 长集转债    | 69,476.41  | 0.01 |
| 48 | 127053 | 豪美转债    | 68,872.48  | 0.01 |
| 49 | 118037 | 上声转债    | 58,403.81  | 0.01 |
| 50 | 113033 | 利群转债    | 41,732.30  | 0.01 |
| 51 | 127043 | 川恒转债    | 34,874.51  | 0.01 |
| 52 | 127101 | 豪鹏转债    | 28,234.71  | 0.00 |
| 53 | 127105 | 龙星转债    | 24,400.35  | 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 90 天滚动持有债券 A | 安信 90 天滚动持有债券 C |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 31,634,499.19   | 93,875,597.35   |
| 报告期期间基金总申购份额 | 487,506,455.81  | 22,394,810.13   |

|                           |                |               |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 365,904.80     | 31,484,163.76 |
| 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               | 518,775,050.20 | 84,786,243.72 |

## § 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(%) |
| 个人    | 1              | 20250101-20250310       | 30,017,500.00 | -    | -          | 30,017,500.00 | 4.97    |

#### 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 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。

### 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 4 月 21 日