

# 安信招信一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：2024 年 1 月 19 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 2024 年 1 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 安信招信一年持有混合   |
| 基金主代码      | 012161   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2021 年 5 月 20 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 322,661,336.98 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | 资产配置策略方面，本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的配置比例。股票投资策略方面，本基金以基本面分析为基础，采用“自下而上”的分析方法，主要从公司的盈利能力、自由现金流状况、估值水平、行业地位等角度，综合评价个股的投资价值，选择低估值、安全边际较高的个股进行投资。债券投资策略方面，本基金通过对国内外宏观经济态势、未来市场利率趋势、收益率曲线变化趋势及市场信用环境变化方向等因素进行综合分析，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构建和调整固定收益证券投资组合。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。投资的原则是控制投资风险、稳健增值。资产支持证券投资策略方面，本基金将综合运用类别 |

|                 |  |                     |
|-----------------|--|---------------------|
|                 | 资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。存托凭证投资策略方面，本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。                   |                     |
| 业绩比较基准          | 中债综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%（经汇率调整）+人民币活期存款利率（税后）*5%  |                     |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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     | 安信招信一年持有混合 A   | 安信招信一年持有混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 012161   | 012162              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 193, 103, 445. 54 份  | 129, 557, 891. 44 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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |                   |
|-----------------|---------------------------------------|-------------------|
|                 | 安信招信一年持有混合 A                          | 安信招信一年持有混合 C      |
| 1. 本期已实现收益      | -709, 668. 14                         | -564, 490. 96     |
| 2. 本期利润         | -3, 387, 661. 79                      | -2, 333, 264. 52  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0167                              | -0. 0173          |
| 4. 期末基金资产净值     | 187, 371, 435. 96                     | 124, 728, 070. 99 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 9703                               | 0. 9627           |

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

安信招信一年持有混合 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      | -1.63% | 0.17%     | -0.34%     | 0.13%         | -1.29% | 0.04% |
| 过去六个月      | -0.95% | 0.17%     | -0.97%     | 0.13%         | 0.02%  | 0.04% |
| 过去一年       | 1.19%  | 0.20%     | -0.05%     | 0.13%         | 1.24%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.97% | 0.27%     | -2.31%     | 0.16%         | -0.66% | 0.11% |

安信招信一年持有混合 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      | -1.71% | 0.17%     | -0.34%     | 0.13%         | -1.37% | 0.04% |
| 过去六个月      | -1.10% | 0.17%     | -0.97%     | 0.13%         | -0.13% | 0.04% |
| 过去一年       | 0.89%  | 0.20%     | -0.05%     | 0.13%         | 0.94%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.73% | 0.27%     | -2.31%     | 0.16%         | -1.42% | 0.11% |

#### 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

安信招信一年持有混合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



安信招信一年持有混合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 2021 年 5 月 20 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 |        |                                      |
| 袁玮 | 本基金的基金经 | 2022年8月30日  | -    | 13年    | 袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基 |

|    |                   |                 |                  |      |   |
|----|-------------------|-----------------|------------------|------|---|
|    | 理，价值投资部副总经理       |                 |                  |      | 金管理有限责任公司研究部研究员、权益投资部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司价值投资部副总经理。现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航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、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。   |
| 张睿 | 本基金的基金经理，固定收益部总经理 | 2022 年 5 月 20 日 | -                | 16 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。现任安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信浩浩盈 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、安信稳健启航一年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。 |
| 任凭 | 本基金的基金经理          | 2021 年 6 月 1 日  | 2023 年 10 月 17 日 | 15 年 | 任凭女士，硕士研究生。曾任职于招商基金管理有限公司，2011 年加入安信基金管理有限责任公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。现任安信活期宝货币市场基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

2023 年四季度国内经济修复的动能边际放缓，宏观指标呈现结构分化，同时外部压力有所缓解，人民币汇率底部回升。

海外方面，美国经济仍具韧性但已显现降温迹象，通胀压力持续放缓，美联储 12 月议息会议如期暂停加息，鸽派言论下市场定价本轮加息周期结束，四季度美元指数持续下行、美债收益率自高点大幅回落。国内方面，PMI 连续 3 个月位于荣枯线下方，结构上呈现生产端扩张放缓、需求端走弱，除了受季节性因素影响，也反映了经济内生动能仍待改善。具体看，投资同比增速放缓，制造业投资在政策影响下维持中高速增长，基建投资平稳增长、受地方化债和土地出让收入收缩的制约动能有所放缓，房地产投资疲弱、同比增速降幅扩大，政策效果仍待显现；出口同比增速在低基数下转正，外需阶段性改善的持续性需要进一步验证；消费持续修复，社零复合增速环比放缓。融资端，社融在政府债的支撑下同比增速持续回升，信贷数据不及预期，呈现总量改善、结构不佳。通胀数据维持低位，CPI、PPI 同比降幅扩大。货币政策方面，在人民币贬值压力

较大的阶段，央行持续传递稳定汇率的决心，四季度共开展 16890 亿 MLF 的净投放，为市场释放了中长期流动性。中央经济工作会议将“稳中求进、以进促稳、先立后破”作为宏观政策基调，提及货币政策要“灵活适度，精准有效”、“强化宏观政策逆周期和跨周期调节”。四季度债券收益率先上后下，收益率曲线整体呈现平坦化下行，长端信用债收益率下行幅度大于利率债，短端信用债收益率下行幅度小于利率债，信用利差较三季度末有所分化，短期信用债与利率债的利差走阔、长期信用债与利率债的利差收窄。

报告期内，本基金主要配置中高等级信用债和利率债获取票息收益，通过维持中高水平的杠杆比例，取得较为稳定的套息收益。相较三季度末维持了股票和可转债资产的持仓比例，增加了债券仓位。期间通过利率债和信用债做波段交易增厚组合收益。同时在债券市场调整的过程中逐步增加了债券组合久期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信招信一年持有混合 A 基金份额净值为 0.9703 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.63%；安信招信一年持有混合 C 基金份额净值为 0.9627 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.71%；同期业绩比较基准收益率为-0.34%。

#### 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              | 55,575,629.95  | 16.93        |
|    | 其中：股票             | 55,575,629.95  | 16.93        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 251,812,174.55 | 76.71        |
|    | 其中：债券             | 251,812,174.55 | 76.71        |
|    | 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      | 20,850,576.43  | 6.35         |
| 8  | 其他资产              | 8,252.21       | 0.00         |
| 9  | 合计                | 328,246,633.14 | 100.00       |



注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 17,521,351.23 元，占净值比例 5.61%。

## 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              | 2,013,796.00  | 0.65         |
| C  | 制造业              | 13,537,950.80 | 4.34         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,482,442.00  | 1.12         |
| E  | 建筑业              | 5,849,441.00  | 1.87         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,134,072.00  | 0.36         |
| J  | 金融业              | 5,869,866.92  | 1.88         |
| K  | 房地产业             | 6,166,710.00  | 1.98         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| 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               | 38,054,278.72 | 12.19        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 能源       | 945,414.02   | 0.30         |
| 原材料      | -            | -            |
| 工业       | 2,851,045.15 | 0.91         |
| 非日常生活消费品 | -            | -            |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 医疗保健     | -            | -            |
| 金融       | 5,192,323.28 | 1.66         |
| 信息技术     | -            | -            |
| 通讯业务     | 3,300,127.00 | 1.06         |
| 公用事业     | -            | -            |

|     |               |      |
|-----|---------------|------|
| 房地产 | 5,232,441.78  | 1.68 |
| 合计  | 17,521,351.23 | 5.61 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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  | 688169 | 石头科技   | 23,784    | 6,729,682.80 | 2.16         |
| 2  | 600048 | 保利发展   | 622,900   | 6,166,710.00 | 1.98         |
| 3  | 601668 | 中国建筑   | 1,216,100 | 5,849,441.00 | 1.87         |
| 4  | 600919 | 江苏银行   | 638,868   | 4,274,026.92 | 1.37         |
| 5  | 00941  | 中国移动   | 42,000    | 2,466,368.35 | 0.79         |
| 5  | 600941 | 中国移动   | 11,400    | 1,134,072.00 | 0.36         |
| 6  | 00939  | 建设银行   | 735,000   | 3,097,233.41 | 0.99         |
| 7  | 01109  | 华润置地   | 118,000   | 2,994,150.88 | 0.96         |
| 8  | 01186  | 中国铁建   | 679,500   | 2,851,045.15 | 0.91         |
| 9  | 601985 | 中国核电   | 374,700   | 2,810,250.00 | 0.90         |
| 10 | 00688  | 中国海外发展 | 179,500   | 2,238,290.90 | 0.72         |

### 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      | 906,484.19     | 0.29         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 63,320,577.31  | 20.29        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,400,590.16  | 6.54         |
| 4  | 企业债券      | 21,123,968.22  | 6.77         |
| 5  | 企业短期融资券   | 82,699,204.37  | 26.50        |
| 6  | 中期票据      | 53,197,135.52  | 17.04        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 30,564,804.94  | 9.79         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 251,812,174.55 | 80.68        |

### 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  | 210207    | 21 国开 07       | 200,000 | 20,400,590.16 | 6.54         |
| 2  | 240426    | 23 京城 04       | 200,000 | 20,103,727.12 | 6.44         |
| 3  | 012382891 | 23 青岛经开 SCP002 | 185,000 | 18,715,267.21 | 6.00         |
| 4  | 2328026   | 23 华夏银行 06     | 175,000 | 17,569,873.77 | 5.63         |
| 5  | 101900795 | 19 闽投 MTN003   | 100,000 | 10,313,039.34 | 3.30         |

## 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股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动<br>(元) | 风险指标说明      |
|-------------------|----|----------|---------|---------------|-------------|
| -                 | -  | -        | -       | -             | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |               | -           |
| 国债期货投资本期收益（元）     |    |          |         |               | -774,376.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |               | -           |

### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 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 21 首钢 MTN001（代码：102100798 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. 首钢集团有限公司

2023 年 8 月-12 月，首钢集团有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市浦东新区税务局第二十一税务所、国家税务总局上海市宝山区税务局第十五税务所责令改正。

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。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 8,152.21 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 100.00   |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 8,252.21 |

#### 5.11.4 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  | 113052 | 兴业转债    | 6,020,899.45 | 1.93         |
| 2  | 110059 | 浦发转债    | 5,921,623.97 | 1.90         |
| 3  | 123107 | 温氏转债    | 4,177,117.40 | 1.34         |
| 4  | 110085 | 通 22 转债 | 3,252,679.73 | 1.04         |
| 5  | 113056 | 重银转债    | 2,250,577.70 | 0.72         |
| 6  | 127045 | 牧原转债    | 1,077,508.74 | 0.35         |
| 7  | 128081 | 海亮转债    | 852,262.27   | 0.27         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 8  | 128136 | 立讯转债     | 769,327.81 | 0.25 |
| 9  | 110048 | 福能转债     | 756,497.95 | 0.24 |
| 10 | 113055 | 成银转债     | 727,487.05 | 0.23 |
| 11 | 113633 | 科沃转债     | 722,820.96 | 0.23 |
| 12 | 127049 | 希望转 2    | 626,551.23 | 0.20 |
| 13 | 110075 | 南航转债     | 600,033.84 | 0.19 |
| 14 | 113033 | 利群转债     | 562,378.33 | 0.18 |
| 15 | 128048 | 张行转债     | 540,995.89 | 0.17 |
| 16 | 110045 | 海澜转债     | 364,855.73 | 0.12 |
| 17 | 132026 | G 三峡 EB2 | 342,920.71 | 0.11 |
| 18 | 127017 | 万青转债     | 222,013.97 | 0.07 |
| 19 | 127061 | 美锦转债     | 147,651.66 | 0.05 |
| 20 | 128141 | 旺能转债     | 61,389.66  | 0.02 |
| 21 | 113046 | 金田转债     | 53,194.86  | 0.02 |

### 5.11.5 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。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 安信招信一年持有混合 A   | 安信招信一年持有混合 C   |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 212,658,039.91 | 144,736,592.82 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 5,034.38       | 8,284.45       |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 19,559,628.75  | 15,186,985.83  |
| 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               | 193,103,445.54 | 129,557,891.44 |

## § 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

无。

### 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招信一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信招信一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信招信一年持有期混合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

2024 年 1 月 19 日