

安信民安回报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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	安信民安回报一年持有混合
基金主代码	012701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 7 日
报告期末基金份额总额	1,183,001,751.26 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，本基金的资产配置策略以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资策略方面，本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方法，在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间、行业竞争格局的背景下，结合估值水平，注重安全边际，选择内在价值被低估的股票构建投资组合。债券投资策略方面，本基金将采取自上而下的投资策略，通过对国内外宏观经济态势及其引致的财政货币政策变化、收益率曲线变化、未来市场利率趋势及市场信用环境变化等因素的综合深入分析，从而确定债券的配置数量与结构。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，本基金将通过对宏观经济形势、提前偿还率、资产池结构、资产池质量以及资产池资产所属行业景气度等因素的研究，预测资产池未来的现金流特征，并通过详查标的证券的发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。	
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经汇率调整后）×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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012701	012702
报告期末下属分级基金的份额总额	269,903,401.96 份	913,098,349.30 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）	
	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	-703,554.84	-2,407,288.82
2. 本期利润	-7,132,687.04	-25,260,404.22
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0258	-0.0266
4. 期末基金资产净值	288,069,352.60	974,344,823.32
5. 期末基金份额净值	1.0673	1.0671

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

安信民安回报一年持有混合 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	-2.31%	0.29%	-0.27%	0.14%	-2.04%	0.15%
过去六个月	-0.66%	0.34%	-0.94%	0.14%	0.28%	0.20%
过去一年	0.23%	0.34%	0.03%	0.14%	0.20%	0.20%
自基金合同生效起至今	6.73%	0.38%	-2.21%	0.17%	8.94%	0.21%

安信民安回报一年持有混合 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	-2.31%	0.29%	-0.27%	0.14%	-2.04%	0.15%
过去六个月	-0.66%	0.34%	-0.94%	0.14%	0.28%	0.20%
过去一年	0.23%	0.34%	0.03%	0.14%	0.20%	0.20%
自基金合同生效起至今	6.71%	0.38%	-2.21%	0.17%	8.92%	0.21%

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

安信民安回报一年持有混合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



安信民安回报一年持有混合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 9 月 7 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		
张翼飞	本基金的基金经	2021 年 9 月 7 日	-	12 年	张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部财务主管，上海

	理，公司 副总经理			市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部总经理、公司总经理助理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。现任安信永鑫增强债券型证券投资基金的基金经理助理；安信稳健增值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、安信民稳增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、安信稳健聚申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、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信恒鑫增强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

报告期内，权益市场有所下跌，我们权益的总仓位大致稳定，但对持仓的地产股、煤炭股等板块做了个券层面的结构性调整，少量介入了部分新能源、制造业标的。

期间，中证转债指数显著下行，我们在转债市场的相对低位，抓住机会增仓，以转债为工具，以兼具防守性的方式，介入了一些新能源、TMT、制造业、食品饮料家电等板块的标的。

纯债部分，在经济基本面表现不及预期以及“地方政府化债”的政策背景下，宽财政力度有所加强，地方政府债券发行提速，市场流动性的波动性有所加大。受经济基本面及债券市场供需关系的影响，四季度债券市场收益率整体以下行为主，短端收益率先上后下，信用债表现优于利率债。我们继续沿用之前低杠杆、中短久期、高评级的策略，以利率债、高等级金融债为主要投资标的，致力于获取安全稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信民安回报一年持有混合 A 基金份额净值为 1.0673 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.31%；安信民安回报一年持有混合 C 基金份额净值为 1.0671 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.31%；同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

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	371,381,346.10	26.57
	其中：股票	371,381,346.10	26.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,015,864,781.51	72.67
	其中：债券	1,015,864,781.51	72.67
	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	999,712.33	0.07

	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	6,603,999.40	0.47
8	其他资产	3,057,294.48	0.22
9	合计	1,397,907,133.82	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 186,485,440.53 元，占净值比例 14.77%。

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	46,106,171.00	3.65
C	制造业	54,561,299.17	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	11,844.00	0.00
J	金融业	75,972,510.00	6.02
K	房地产业	8,207,100.00	0.65
L	租赁和商务服务业	36,981.40	0.00
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	184,895,905.57	14.65

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	55,541,444.45	4.40
原材料	36,384,742.05	2.88
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	18,452,089.15	1.46

医疗保健	-	-
金融	8,008,719.25	0.63
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	68,098,445.63	5.39
合计	186,485,440.53	14.77

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	00883	中国海洋石油	3,679,000	43,341,783.94	3.43
1	600938	中国海油	344,300	7,219,971.00	0.57
2	00688	中国海外发展	3,950,000	49,254,869.44	3.90
3	600036	招商银行	1,598,000	44,456,360.00	3.52
4	00914	海螺水泥	1,473,000	24,080,911.56	1.91
4	600585	海螺水泥	786,000	17,732,160.00	1.40
5	000333	美的集团	629,800	34,405,974.00	2.73
6	601318	中国平安	550,000	22,165,000.00	1.76
6	02318	中国平安	250,000	8,008,719.25	0.63
7	02202	万科企业	2,880,000	18,843,576.19	1.49
8	01088	中国神华	450,000	10,908,623.25	0.86
8	601088	中国神华	244,000	7,649,400.00	0.61
9	00288	万洲国际	4,040,000	18,452,089.15	1.46
10	601225	陕西煤业	624,000	13,035,360.00	1.03

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	691,960,957.12	54.81
	其中：政策性金融债	268,830,188.70	21.29
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）	264,164,534.94	20.93
8	同业存单	59,739,289.45	4.73
9	其他	-	-
10	合计	1,015,864,781.51	80.47

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	092218005	22 农发清发 05	700,000	70,268,371.58	5.57
2	149558	21 国信 06	600,000	61,854,535.89	4.90
3	113052	兴业转债	601,300	61,279,059.59	4.85
4	112320233	23 广发银行 CD233	600,000	59,739,289.45	4.73
5	180401	18 农发 01	500,000	53,794,958.90	4.26

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 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。

5.11 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 国信 06（代码：149558 SZ）、兴业转债（代码：113052 SH）、23 广发银行 CD233（代码：112320233 CY）、招商银行（代码：600036 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. 国信证券股份有限公司

2023 年 2 月 7 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证券交易所警示。

2023 年 4 月 6 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会浙江监管局监管警示。

2023 年 9 月 6 日，国信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会责令改正。

2. 兴业银行股份有限公司

2023 年 1 月 18 日，兴业银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则被中国银行间市场交易商协会警告。

2023 年 5 月 8 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会福建监管局责令改正。

2023 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. 广发银行股份有限公司

2023 年 8 月 18 日，广发银行股份有限公司因信息披露类、市场监管类被国家金融监督管理总局处以罚款。

2023 年 12 月 27 日，广发银行股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市税务局第三税务分局采取行政监管措施。

4. 招商银行股份有限公司

2023 年 1 月 18 日，招商银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则被中国银行间市场交易商协会警告。

2023 年 11 月 27 日，招商银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局深圳市分局罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 15 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款。

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。

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	98,325.64
2	应收证券清算款	2,955,002.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,965.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,057,294.48

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	61,279,059.59	4.85
2	113044	大秦转债	18,380,300.16	1.46
3	113050	南银转债	11,109,505.64	0.88
4	113056	重银转债	10,150,105.42	0.80
5	113065	齐鲁转债	10,084,062.62	0.80
6	110085	通 22 转债	9,364,464.93	0.74
7	113037	紫银转债	9,298,002.85	0.74
8	110079	杭银转债	9,264,672.75	0.73
9	113053	隆 22 转债	7,520,271.65	0.60
10	118031	天 23 转债	6,027,179.85	0.48
11	113059	福莱转债	5,114,081.54	0.41
12	128129	青农转债	4,611,322.88	0.37

13	110081	闻泰转债	3,121,676.84	0.25
14	118034	晶能转债	3,105,038.93	0.25
15	113661	福 22 转债	3,001,514.59	0.24
16	127056	中特转债	2,805,676.37	0.22
17	113048	晶科转债	2,753,381.41	0.22
18	110089	兴发转债	2,561,657.33	0.20
19	113655	欧 22 转债	2,513,112.08	0.20
20	127044	蒙娜转债	2,425,472.57	0.19
21	128108	蓝帆转债	2,301,901.03	0.18
22	127027	能化转债	1,978,800.85	0.16
23	110076	华海转债	1,956,203.04	0.15
24	113641	华友转债	1,788,681.04	0.14
25	110092	三房转债	1,779,850.65	0.14
26	111010	立昂转债	1,626,450.52	0.13
27	110087	天业转债	1,624,426.68	0.13
28	113640	苏利转债	1,609,958.13	0.13
29	118013	道通转债	1,580,819.38	0.13
30	127066	科利转债	1,543,397.93	0.12
31	113650	博 22 转债	1,536,528.00	0.12
32	110082	宏发转债	1,531,055.14	0.12
33	113666	爱玛转债	1,512,978.90	0.12
34	127024	盈峰转债	1,411,350.81	0.11
35	127025	冀东转债	1,399,324.72	0.11
36	113644	艾迪转债	1,393,393.55	0.11
37	113633	科沃转债	1,373,359.82	0.11
38	118005	天奈转债	1,364,201.04	0.11
39	110086	精工转债	1,333,958.21	0.11
40	113658	密卫转债	1,258,911.53	0.10
41	123132	回盛转债	1,208,888.79	0.10
42	123128	首华转债	1,202,803.27	0.10
43	123178	花园转债	1,201,442.77	0.10
44	127046	百润转债	1,130,624.32	0.09
45	128135	洽洽转债	1,100,234.24	0.09
46	113653	永 22 转债	1,069,567.56	0.08
47	123165	回天转债	1,007,513.70	0.08
48	127068	顺博转债	990,157.57	0.08
49	113046	金田转债	984,104.97	0.08
50	123115	捷捷转债	972,201.78	0.08
51	118032	建龙转债	883,944.67	0.07
52	113670	金 23 转债	857,513.94	0.07
53	113605	大参转债	844,280.20	0.07
54	113668	鹿山转债	833,107.45	0.07

55	123144	裕兴转债	795,550.30	0.06
56	123133	佩蒂转债	770,406.42	0.06
57	123179	立高转债	761,820.49	0.06
58	113659	莱克转债	755,093.19	0.06
59	123151	康医转债	753,515.76	0.06
60	113636	甬金转债	715,437.58	0.06
61	128131	崇达转 2	696,492.31	0.06
62	113627	太平转债	683,143.15	0.05
63	123182	广联转债	673,635.05	0.05
64	113047	旗滨转债	660,969.30	0.05
65	132020	19 蓝星 EB	652,166.30	0.05
66	123117	健帆转债	638,404.68	0.05
67	127041	弘亚转债	614,730.48	0.05
68	118026	利元转债	610,519.98	0.05
69	127060	湘佳转债	597,789.30	0.05
70	127085	韵达转债	582,785.59	0.05
71	123122	富瀚转债	579,631.23	0.05
72	127074	麦米转 2	578,143.82	0.05
73	128116	瑞达转债	568,878.93	0.05
74	127031	洋丰转债	557,440.41	0.04
75	123145	药石转债	541,911.75	0.04
76	123091	长海转债	540,141.97	0.04
77	123193	海能转债	538,028.59	0.04
78	127042	嘉美转债	493,274.36	0.04
79	123154	火星转债	483,764.79	0.04
80	128144	利民转债	474,942.75	0.04
81	123121	帝尔转债	452,695.12	0.04
82	123175	百畅转债	443,984.58	0.04
83	113066	平煤转债	427,737.95	0.03
84	127016	鲁泰转债	421,853.98	0.03
85	123162	东杰转债	406,976.28	0.03
86	123120	隆华转债	406,625.56	0.03
87	123082	北陆转债	402,406.49	0.03
88	123076	强力转债	401,594.79	0.03
89	111009	盛泰转债	387,176.79	0.03
90	113584	家悦转债	380,850.26	0.03
91	123168	惠云转债	315,853.99	0.03
92	118014	高测转债	253,847.02	0.02
93	123149	通裕转债	253,716.17	0.02
94	123183	海顺转债	234,333.61	0.02
95	128063	未来转债	217,469.72	0.02
96	113647	禾丰转债	215,219.31	0.02

97	127055	精装转债	207,653.42	0.02
98	118011	银微转债	191,468.84	0.02
99	123170	南电转债	182,861.04	0.01
100	113657	再 22 转债	174,916.28	0.01
101	118029	富淼转债	139,018.63	0.01
102	113649	丰山转债	120,177.11	0.01
103	128097	奥佳转债	119,849.82	0.01
104	111014	李子转债	119,369.35	0.01
105	123101	拓斯转债	79,149.67	0.01
106	123169	正海转债	72,263.60	0.01
107	113638	台 21 转债	65,187.68	0.01
108	123191	智尚转债	59,564.23	0.00
109	113609	永安转债	40,274.68	0.00
110	113656	嘉诚转债	33,089.55	0.00
111	113051	节能转债	19,346.87	0.00
112	127081	中旗转债	15,329.59	0.00

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	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	288,731,184.64	1,060,037,779.89
报告期期间基金总申购份额	2,808,337.90	4,372,371.04
减：报告期期间基金总赎回份额	21,636,120.58	151,311,801.63
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	269,903,401.96	913,098,349.30

§ 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民安回报一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信民安回报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