

安信民安回报一年持有期混合型证券投资  
基金  
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 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 7 月 18 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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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	645,734,478.57 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，并通过详查标的的证券的发行条款，预测提前偿还率变化对标的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	147,169,366.97 份	498,565,111.60 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 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	4,702,497.48	15,343,096.64
2. 本期利润	10,094,382.94	32,575,101.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0555	0.0553
4. 期末基金资产净值	166,705,108.26	564,607,769.17
5. 期末基金份额净值	1.1327	1.1325

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	4.43%	0.35%	1.10%	0.11%	3.33%	0.24%
过去六个月	6.13%	0.37%	2.48%	0.14%	3.65%	0.23%
过去一年	5.43%	0.35%	1.52%	0.14%	3.91%	0.21%
自基金合同生效起至今	13.27%	0.38%	0.21%	0.17%	13.06%	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	4.43%	0.35%	1.10%	0.11%	3.33%	0.24%
过去六个月	6.13%	0.37%	2.48%	0.14%	3.65%	0.23%
过去一年	5.43%	0.35%	1.52%	0.14%	3.91%	0.21%
自基金合同生效起至今	13.25%	0.38%	0.21%	0.17%	13.04%	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	本基金的基金经理，公司首席投资官（CIO）	2021年9月7日	-	13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、公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司首席投资官（混合资产 CIO）。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，权益市场先上后下，沪深 300 总体下跌 2.14%，恒生指数则上涨 7.12%。期间，我们根据市场行情变化，做了相对积极的应对。我们持续持有较多港股，受益于港股的行情，获取了一定的收益。A 股上，我们适当增配了白酒、钢铁等板块。

报告期内，中证转债指数上涨 0.75%，但振幅达到 5.52%，部分资质较差的中小盘转债和以光伏为代表的新能源转债，都发生了较大的价格波动。期间，我们根据对流动性、期权价值和制度变化层面的考量，积极的管理了可转债的仓位，在可转债资产上，也获得了一定的收益。

在纯债部分，我们的主要策略是尽可能的降低信用风险和利率风险，获取相对确定的收益。因此我们主要持有了利率债、高等级金融债等低风险资产，维持了相对低的久期，并运用国债期货工具对利率风险做了对冲。

#### 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 1.1327 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.43%；安信民安回报一年持有混合 C 基金份额净值为 1.1325 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.43%；同期业绩比较基准收益率为 1.10%。

#### 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	215,809,183.17	28.09
	其中：股票	215,809,183.17	28.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	527,973,895.29	68.71
	其中：债券	527,973,895.29	68.71
	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	2,000,000.00	0.26
	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	7,473,393.59	0.97
8	其他资产	15,099,789.25	1.97
9	合计	768,356,261.30	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 98,096,761.94 元，占净值比例 13.41%。

#### 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	43,247,848.00	5.91
C	制造业	28,721,387.39	3.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	527,360.00	0.07
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	41,112.72	0.01
J	金融业	42,593,350.00	5.82
K	房地产业	2,578,944.00	0.35
L	租赁和商务服务业	2,419.12	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	117,712,421.23	16.10

### 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	28,533,205.02	3.90
原材料	28,651,836.25	3.92
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	8,420,659.48	1.15
医疗保健	-	-
金融	3,166,269.46	0.43
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	29,324,791.73	4.01
合计	98,096,761.94	13.41

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

### 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	00688	中国海外发展	2,373,000	29,324,791.73	4.01



2	600036	招商银行	827,000	28,275,130.00	3.87
3	00883	中国海洋石油	873,362	17,855,040.68	2.44
3	600938	中国海油	231,000	7,623,000.00	1.04
4	00914	海螺水泥	1,133,100	19,235,333.37	2.63
4	600585	海螺水泥	240,500	5,673,395.00	0.78
5	000333	美的集团	216,200	13,944,900.00	1.91
6	601318	中国平安	260,100	10,757,736.00	1.47
6	02318	中国平安	98,000	3,166,269.46	0.43
7	601699	潞安环能	691,700	12,540,521.00	1.71
8	000983	山西焦煤	1,047,900	10,803,849.00	1.48
9	03668	兖煤澳大利亚	342,600	10,678,164.34	1.46
10	600546	山煤国际	676,700	9,893,354.00	1.35

#### 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	3,143,230.53	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	407,106,449.22	55.67
	其中：政策性金融债	109,955,449.46	15.04
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）	117,724,215.54	16.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	527,973,895.29	72.20

#### 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	149558	21 国信 06	600,000	63,234,871.23	8.65
2	2228037	22 交通银行小微债 01	600,000	60,506,630.14	8.27
3	200204	20 国开 04	550,000	57,917,088.80	7.92
4	180401	18 农发 01	500,000	52,038,360.66	7.12
5	2420013	24 北京银行 01	500,000	50,786,627.40	6.94

#### 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(元)	风险指标说明
T2409	10 年期国债 2409	-145	-152,772,000.00	-1,450,925.12	-
公允价值变动总额合计(元)					-1,450,925.12
国债期货投资本期收益(元)					-837,693.45
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-1,035,238.67

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金运用国债期货工具调节组合的期限结构以及久期水平。报告期内，产品择机通过国债期货交易，管理产品的利率风险，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 国信 06（代码：149558 SZ）、22 交通银行小微债 01（代码：2228037 CY）、24 北京银行 01（代码：2420013 CY）、22 招证 G2（代码：185393 SH）、24 光大银行债 01（代码：212480005 CY）、兴业转债（代码：113052 SH）、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 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。

2024 年 1 月 4 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 4 月 19 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深圳监管局出具警示函。

2024 年 5 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广东监管局出具警示函。

2024 年 5 月 10 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出具警示函。

2024 年 6 月 9 日，国信证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局北京市西城区税务局第六税务所责令改正。

#### 2. 交通银行股份有限公司

2024 年 6 月 21 日，交通银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

#### 3. 北京银行股份有限公司

2024 年 2 月 6 日，北京银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局北京监管局罚款。

#### 4. 招商证券股份有限公司

2023 年 9 月 11 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 2 月 2 日，招商证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会安徽监管局出具警示函。

2024 年 2 月 9 日，招商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深圳监管局责令合规检查与报告。

2024 年 4 月 30 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所通报批评。

5. 中国光大银行股份有限公司

2024 年 5 月 23 日，中国光大银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

6. 兴业银行股份有限公司

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。

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

7. 招商银行股份有限公司

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。

2024 年 6 月 28 日，招商银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

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	3,161,101.81
2	应收证券清算款	9,046,300.98
3	应收股利	2,801,686.29
4	应收利息	-
5	应收申购款	90,700.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,099,789.25

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	28,281,606.20	3.87
2	110085	通 22 转债	8,227,616.00	1.13

3	113053	隆 22 转债	6,492,690.23	0.89
4	110079	杭银转债	4,871,750.17	0.67
5	127089	晶澳转债	4,118,135.74	0.56
6	113056	重银转债	4,044,442.75	0.55
7	113037	紫银转债	3,861,778.74	0.53
8	118034	晶能转债	3,321,138.65	0.45
9	113050	南银转债	3,130,285.57	0.43
10	113059	福莱转债	2,350,933.33	0.32
11	127040	国泰转债	2,313,172.99	0.32
12	128129	青农转债	2,295,807.49	0.31
13	118024	冠宇转债	1,670,030.00	0.23
14	110093	神马转债	1,661,977.28	0.23
15	113048	晶科转债	1,611,341.78	0.22
16	113062	常银转债	1,548,993.66	0.21
17	113661	福 22 转债	1,425,161.22	0.19
18	110081	闻泰转债	1,422,117.24	0.19
19	127024	盈峰转债	1,380,361.52	0.19
20	113044	大秦转债	1,354,184.98	0.19
21	123149	通裕转债	1,295,626.13	0.18
22	113655	欧 22 转债	1,109,279.58	0.15
23	118042	奥维转债	1,016,857.72	0.14
24	113666	爱玛转债	1,011,194.23	0.14
25	110076	华海转债	992,625.28	0.14
26	127044	蒙娜转债	959,507.76	0.13
27	127032	苏行转债	933,973.39	0.13
28	110082	宏发转债	899,339.38	0.12
29	113605	大参转债	850,279.27	0.12
30	123215	铭利转债	822,996.58	0.11
31	123082	北陆转债	805,071.32	0.11
32	123169	正海转债	784,286.37	0.11
33	123179	立高转债	760,380.64	0.10
34	111010	立昂转债	742,602.13	0.10
35	113644	艾迪转债	739,615.73	0.10
36	113650	博 22 转债	673,667.50	0.09
37	123165	回天转债	657,782.37	0.09
38	118005	天奈转债	654,277.71	0.09
39	118032	建龙转债	653,385.42	0.09
40	123115	捷捷转债	652,454.25	0.09
41	123104	卫宁转债	646,221.43	0.09
42	113679	芯能转债	637,338.41	0.09
43	127066	科利转债	613,098.89	0.08
44	123174	精锻转债	603,069.62	0.08

45	113636	甬金转债	599,117.60	0.08
46	113640	苏利转债	563,553.93	0.08
47	123151	康医转债	556,554.00	0.08
48	113641	华友转债	528,643.14	0.07
49	128131	崇达转 2	523,100.79	0.07
50	123210	信服转债	489,005.71	0.07
51	123208	孩王转债	476,541.46	0.07
52	127082	亚科转债	474,430.68	0.06
53	127027	能化转债	454,916.19	0.06
54	113677	华懋转债	452,278.86	0.06
55	123211	阳谷转债	445,226.67	0.06
56	127017	万青转债	433,993.94	0.06
57	123233	凯盛转债	425,987.67	0.06
58	118013	道通转债	421,406.59	0.06
59	118038	金宏转债	401,506.13	0.05
60	113047	旗滨转债	390,360.83	0.05
61	113584	家悦转债	379,143.19	0.05
62	127091	科数转债	365,006.64	0.05
63	123120	隆华转债	351,791.55	0.05
64	128130	景兴转债	340,772.67	0.05
65	110094	众和转债	272,410.23	0.04
66	113676	荣 23 转债	269,320.50	0.04
67	123235	亿田转债	258,954.02	0.04
68	113664	大元转债	249,025.83	0.03
69	127031	洋丰转债	234,004.56	0.03
70	110089	兴发转债	230,377.03	0.03
71	113663	新化转债	230,008.55	0.03
72	113675	新 23 转债	220,272.78	0.03
73	118041	星球转债	195,017.45	0.03
74	123091	长海转债	193,923.76	0.03
75	118028	会通转债	175,220.81	0.02
76	113065	齐鲁转债	157,316.71	0.02
77	127076	中宠转 2	124,628.13	0.02
78	113671	武进转债	107,363.59	0.01
79	113637	华翔转债	103,213.99	0.01
80	113542	好客转债	67,349.17	0.01
81	123119	康泰转 2	47,358.82	0.01
82	127085	韵达转债	41,838.39	0.01
83	113659	莱克转债	40,379.38	0.01
84	123108	乐普转 2	18,061.78	0.00
85	123144	裕兴转债	924.08	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	219,419,318.88	721,121,753.31
报告期期间基金总申购份额	13,248,338.47	45,080,587.99
减：报告期期间基金总赎回份额	85,498,290.38	267,637,229.70
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	147,169,366.97	498,565,111.60

## § 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 7 月 18 日