

安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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

送出日期：2023 年 8 月 29 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。本中期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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	47
7.7 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	47

7.8	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	47
7.9	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	48
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	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	52
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1	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	55
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	56
12.2	存放地点	56
12.3	查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信新趋势混合	
基金主代码	001710	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 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	
报告期末基金份额总额	3,350,457,959.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
下属分级基金的交易代码	001710	001711
报告期末下属分级基金的份额总额	1,320,902,162.45 份	2,029,555,797.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金旨在追求绝对回报，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，因势利导运用多样化的投资策略如资产配置策略、固定收益类投资策略、股票投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略等实现基金资产稳定增值。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）收益率
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，属于中等风险水平的投资品种。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	罗菲菲
	联系电话	0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95568
传真		0755-82799292	010-57093382
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益	北京市西城区复兴门内大街 2 号

	田路 6009 号新世界商务中心 36 层	
邮政编码	518026	100031
法定代表人	刘入领	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
本期已实现收益	32,149,352.62	40,072,788.43
本期利润	36,903,743.27	42,687,314.11
加权平均基金份额本期利润	0.0264	0.0233
本期加权平均净值利润率	2.24%	1.99%
本期基金份额净值增长率	2.15%	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	218,354,346.79	319,660,418.70
期末可供分配基金份额利润	0.1653	0.1575
期末基金资产净值	1,566,947,159.55	2,391,477,673.02
期末基金份额净值	1.186	1.178
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	46.04%	43.98%

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。

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

安信新趋势混合 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
过去一个月	0.51%	0.14%	0.74%	0.43%	-0.23%	-0.29%
过去三个月	0.76%	0.14%	-2.06%	0.41%	2.82%	-0.27%
过去六个月	2.15%	0.14%	0.16%	0.41%	1.99%	-0.27%
过去一年	2.15%	0.17%	-6.52%	0.48%	8.67%	-0.31%
过去三年	17.99%	0.19%	-1.50%	0.59%	19.49%	-0.40%
自基金合同生效起至今	46.04%	0.16%	11.22%	0.59%	34.82%	-0.43%

安信新趋势混合 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
过去一个月	0.51%	0.13%	0.74%	0.43%	-0.23%	-0.30%
过去三个月	0.77%	0.14%	-2.06%	0.41%	2.83%	-0.27%
过去六个月	1.99%	0.15%	0.16%	0.41%	1.83%	-0.26%
过去一年	1.90%	0.17%	-6.52%	0.48%	8.42%	-0.31%
过去三年	17.20%	0.19%	-1.50%	0.59%	18.70%	-0.40%
自基金合同生效起至今	43.98%	0.16%	11.22%	0.59%	32.76%	-0.43%

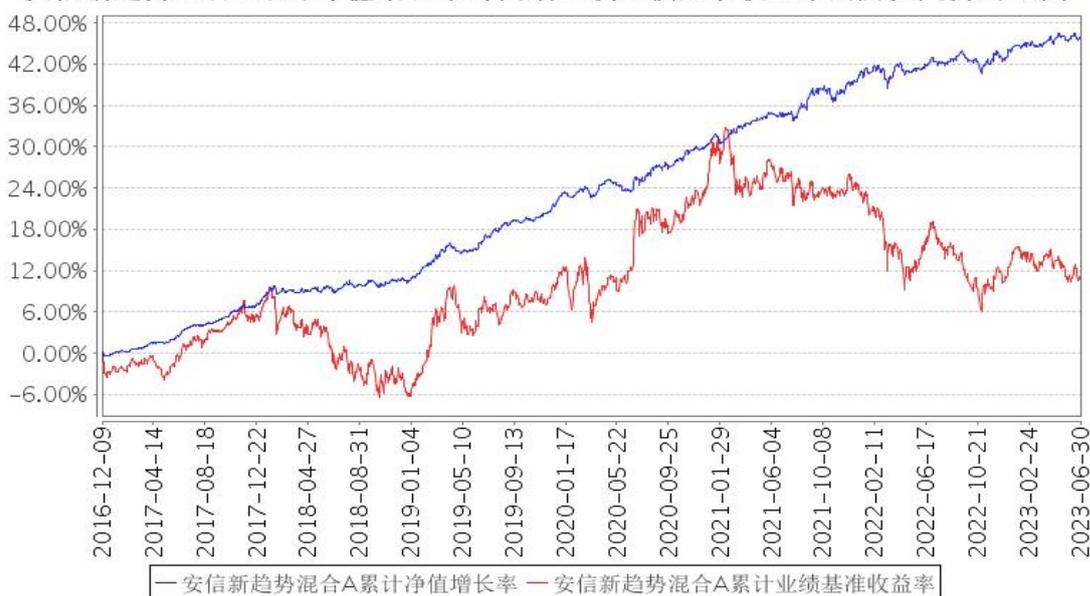
注：根据《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债总指数（全价）收益率。其中沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指

数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。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 50%、50%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

安信新趋势混合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



安信新趋势混合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 2016 年 12 月 09 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，安信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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 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、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、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、安信消费升级一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。

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		
李君	本基金的基金经理，混合资产	2017 年 12 月 26 日	-	18 年	李君先生，管理学硕士。历任光大证券研究所研究部行业分析师，国信证券研究所研究部高级行业分析师，上海泽熙投资管理有限公司投资研究部投资研究员，太和

	投资部 总经理				先机资产管理有限公司投资研究部研究总监，东方睿德（上海）投资管理有限公司股权投资部投资总监，上海东证橡睿投资管理有限公司投资部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部基金经理、混合资产投资部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部总经理。现任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、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信新趋势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、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）的基金经理。
黄琬舒	本基金的 基金经理	2022年3 月9日	2023年4 月4日	8年	黄琬舒女士，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司集中交易部债券交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理、投资经理，混合资产投资部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司 FOF 投资部基金经理。

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。

4.3.2 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 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

上半年，股票市场各宽基指数先涨后跌，这一过程伴随着投资者对经济复苏进度的预期调整。二季度后，投资者的风险偏好进一步降低，并主动调整资产配置，居民储蓄快速增长，风险资产价格表现疲弱。市场调整后，多数股票估值落至过去 5-10 年估值的较低百分位。

指数波动过程中，我们的股票仓位大体稳定，随指数位置和隐含的性价比小幅摆动。股票组合的持仓也较为分散、均衡，因而在市场波动的过程中，基金净值的回撤大体可控。

上半年，部分偏成长性的行业估值显著回落，如新能源、医药等。这部分板块我们去年涉及较少，主要限于估值因素，但今年估值回落后，从长期隐含回报率和短期风险的权衡来看，已有一定吸引力。因而，我们增持了若干认为长期确定性较强的个股。

总的来说，在坚持估值和风险收益比的底线要求的前提下，与年初相比，所持仓组合在风格特征上变得更为均衡。

可转债部分，上半年估值体系整体相对稳定，5 月后，随正股波动及个别转债退市影响，估值小有回落。最近一年多，可转债市场的估值体系表现出较强韧性，多次外部冲击下，可转债估值仍守于历史偏高百分位。这与机构投资者对转债市场的参与深度不断加强有关，也代表了主流投资者对转债的要求回报率有所下降。我们在 5 月后的估值下降过程，转债仓位有所提升，仍以偏债性转债持仓为主。

纯债部分，年初以来，国内经济复苏情况不及市场预期，而流动性环境整体充裕，资金从风险资产向避险资产处聚集。债券市场收益率整体下行，信用利差大幅收窄。本基金纯债部分以利

率债和高等级信用债为主，并适当提升了高等级信用债的配置比例，受益于上半年的债券市场行情，获取了一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新趋势混合 A 基金份额净值为 1.186 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.15%；安信新趋势混合 C 基金份额净值为 1.178 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.99%；同期业绩比较基准收益率为 0.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收方面，当前债券市场收益率水平已逼近前期低点，机构拥挤程度也比较高。下半年稳增长政策有望出台，企业和居民的风险偏好或将回升。我们对后续债券市场的表现持偏谨慎的态度。

权益方面，我们认为 2023 年下半年值得乐观，至少仓位上不宜过于保守。当下市场焦灼于经济复苏程度和政策对冲的博弈，在此情境下，短期行业配置和市场方向判断的复杂度均有提升，相应影响自上而下进行资产配置的容错性，即从胜率角度来预测短期哪类风格或哪些行业能够胜出并不容易。但自下而上思考，大量优质个股的估值水平处于多年低位，低利率环境下，股债隐含回报率差距明显，就风险收益比这个指标看，反而是配置权益资产的较佳时点。虽然估值高低并不代表着短期的股价涨跌，但无疑是长期回报率的重要决定因素。

4.6 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

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。

4.7 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,789,675.04	22,189,096.85
结算备付金		17,069,457.91	25,205,915.91
存出保证金		165,282.68	243,256.32
交易性金融资产	6.4.7.2	4,294,577,028.08	4,661,083,124.12
其中：股票投资		567,873,034.53	620,869,391.58
基金投资		-	-
债券投资		3,726,703,993.55	4,040,213,732.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-5,838.91
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		7,308,524.10	25,187,222.67
应收股利		-	-
应收申购款		20,963,403.82	7,593,143.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,351,873,371.63	4,741,495,920.19
负债和净资产			
	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		380,961,464.98	545,848,883.59
应付清算款		-	19,482,415.01
应付赎回款		9,135,325.08	29,238,995.51
应付管理人报酬		1,974,183.15	2,167,065.34
应付托管费		658,061.04	722,355.12
应付销售服务费		393,912.56	352,409.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,553.73	13,516.58
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	323,038.52	532,608.52
负债合计		393,448,539.06	598,358,249.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,350,457,959.62	3,578,043,009.52
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	607,966,872.95	565,094,661.09
净资产合计		3,958,424,832.57	4,143,137,670.61
负债和净资产总计		4,351,873,371.63	4,741,495,920.19

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,350,457,959.62 份，其中安信新趋势混合 A 基金份额总额 1,320,902,162.45 份，基金份额净值 1.186 元；安信新趋势混合 C 基金份额总额 2,029,555,797.17 份，基金份额净值 1.178 元。

6.2 利润表

会计主体：安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		100,153,513.12	117,857,895.46
1. 利息收入		485,321.98	7,866,690.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	287,823.28	794,220.41
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		197,498.70	7,072,470.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		91,104,786.94	113,737,929.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	25,620,808.65	52,039,799.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	56,415,909.24	52,926,807.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	365,162.88
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-181,033.58
股利收益	6.4.7.15	9,068,069.05	8,587,192.96
以摊余成本计量		-	-

的金融资产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	7,368,916.33	-5,596,471.62
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,194,487.87	1,849,746.68
减：二、营业总支出		20,562,455.74	21,192,049.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,286,098.46	14,234,054.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,762,032.81	4,744,684.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,126,479.05	2,015,521.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,245,663.51	49,551.46
其中：卖出回购金融资产支出		3,245,663.51	49,551.46
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		5,389.10	11,268.38
8. 其他费用	6.4.7.19	136,792.81	136,969.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		79,591,057.38	96,665,846.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		79,591,057.38	96,665,846.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,591,057.38	96,665,846.37

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30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(基金净值)	3,578,043,009.52	-	565,094,661.09	4,143,137,670.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期	-	-	-	-

差错更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初净 资产（基 金净 值）	3,578,043,009.52	-	565,094,661.09	4,143,137,670.61
三、本 期增 减变 动额 （减 少以 “-” 号 填 列）	-227,585,049.90	-	42,872,211.86	-184,712,838.04
（一）、 综合收 益总 额	-	-	79,591,057.38	79,591,057.38
（二）、 本 期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 （净 值减 少以 “-” 号 填 列）	-227,585,049.90	-	-36,718,845.52	-264,303,895.42
其中：1. 基金申 购款	1,741,972,322.85	-	302,810,347.00	2,044,782,669.85
2. 基金 赎回 款	-1,969,557,372.75	-	-339,529,192.52	-2,309,086,565.27
（三）、 本 期向 基金 份额 持有 人分 配利 润产 生的 基金 净值 变动 （净 值减 少以 “-” 号 填 列）	-	-	-	-
（四）、 其 他综 合收 益结 转留 存收 益	-	-	-	-
四、本 期	3,350,457,959.62	-	607,966,872.95	3,958,424,832.57

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
期末净资产（基金净值）				
一、上期期末净资产（基金净值）	3,418,626,958.09	-	457,517,450.19	3,876,144,408.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,418,626,958.09	-	457,517,450.19	3,876,144,408.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	871,429,166.30	-	222,648,871.34	1,094,078,037.64
（一）、综合收益总额	-	-	96,665,846.37	96,665,846.37
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	871,429,166.30	-	125,983,024.97	997,412,191.27
其中：1. 基金申购款	2,307,637,828.00	-	331,786,474.16	2,639,424,302.16
2. 基金赎回款	-1,436,208,661.70	-	-205,803,449.19	-1,642,012,110.89
（三）、本期向基金	-	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	4,290,056,124.39	-	680,166,321.53	4,970,222,445.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金（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”）2015 年 7 月 7 日下发的证监许可[2015]1548 号文“关于准予安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”注册，并根据 2016 年 11 月 8 日机构部函[2016]2713 号文“关于核准安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”的核准，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《安信新趋势灵活配置混合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。本基金募集期间为 2016 年 11 月 23 日至 2016 年 12 月 5 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字 60962175_H70 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,408,124.74 份，其中认购资金利息折合 120,045.17 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，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托

管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和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、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，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、赎回时收取赎回费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新趋势灵活配置混合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，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、资产支持证券、银行存款、回购、其他货币市场工具等固定收益类品种，股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	11,789,675.04
等于：本金	11,785,690.84
加：应计利息	3,984.20
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	11,789,675.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	607,284,443.17	-	567,873,034.53	-39,411,408.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	2,673,248,938.27	30,524,065.46	2,722,142,041.75	18,369,038.02
	银行间市场	990,987,682.68	15,538,551.80	1,004,561,951.80	-1,964,282.68
	合计	3,664,236,620.95	46,062,617.26	3,726,703,993.55	16,404,755.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,271,521,064.12	46,062,617.26	4,294,577,028.08	-23,006,653.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	884.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	203,757.66
其中：交易所市场	198,280.75
银行间市场	5,476.91
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	49,588.57
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	323,038.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信新趋势混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,806,632,510.63	1,806,632,510.63
本期申购	334,833,282.04	334,833,282.04
本期赎回（以“-”号填列）	-820,563,630.22	-820,563,630.22
本期末	1,320,902,162.45	1,320,902,162.45

安信新趋势混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,771,410,498.89	1,771,410,498.89
本期申购	1,407,139,040.81	1,407,139,040.81
本期赎回（以“-”号填列）	-1,148,993,742.53	-1,148,993,742.53
本期末	2,029,555,797.17	2,029,555,797.17

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信新趋势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	256,520,268.93	34,695,505.58	291,215,774.51
本期利润	32,149,352.62	4,754,390.65	36,903,743.27
本期基金份额交易产生的变动数	-70,315,274.76	-11,759,245.92	-82,074,520.68
其中：基金申购款	50,925,963.31	8,647,764.10	59,573,727.41
基金赎回款	-121,241,238.07	-20,407,010.02	-141,648,248.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,354,346.79	27,690,650.31	246,044,997.10

安信新趋势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	240,096,597.00	33,782,289.58	273,878,886.58
本期利润	40,072,788.43	2,614,525.68	42,687,314.11
本期基金份额交易产生的变动数	39,491,033.27	5,864,641.89	45,355,675.16
其中：基金申购款	207,914,735.15	35,321,884.44	243,236,619.59
基金赎回款	-168,423,701.88	-29,457,242.55	-197,880,944.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	319,660,418.70	42,261,457.15	361,921,875.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	73,940.88
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	212,193.20
其他	1,689.20
合计	287,823.28

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	274,318,158.90
减：卖出股票成本总额	248,000,319.67
减：交易费用	697,030.58
买卖股票差价收入	25,620,808.65

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	42,948,437.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,467,471.99
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	56,415,909.24

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,480,191,262.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,453,960,163.08
减：应计利息总额	12,736,423.73
减：交易费用	27,204.00
买卖债券差价收入	13,467,471.99

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,068,069.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,068,069.05

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,368,916.33
股票投资	-8,027,608.81
债券投资	15,396,525.14
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	7,368,916.33

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,152,664.72
基金转换费收入	41,823.15
合计	1,194,487.87

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	9,096.87
银行间账户维护费	18,600.00
合计	136,792.81

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
安信证券	-	-	77,779,139.71	9.52

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	56,102.01	9.48	56,102.01	30.18

注：（1）上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

（2）该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和 market 信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	11,286,098.46
其中：支付销售机构的客户维护费	3,106,164.83	2,409,804.76

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基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,762,032.81	4,744,684.71

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C	合计
安信基金	-	254,531.57	254,531.57
安信证券	-	3,111.25	3,111.25
民生银行	-	13,837.45	13,837.45
合计	-	271,480.27	271,480.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C	合计
安信基金	-	825,914.05	825,914.05
安信证券	-	250.38	250.38
民生银行	-	17,202.61	17,202.61
合计	-	843,367.04	843,367.04

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：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本基金于本期及上年度可比期间均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。

6.4.10.4.2 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

本基金于本期及上年度可比期间均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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	11,789,675.04	73,940.88	53,662,110.93	92,158.78

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁 定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无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，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金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为人民币 380,961,464.98 元，分别于 2023 年 7 月 3 日、2023 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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股票投资、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。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2023 年 6 月 30 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 72.10%（2022 年 12 月 31 日：61.93%）。

6.4.13.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	15,027,513.70
合计	-	15,027,513.70

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。

6.4.13.2.2 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	2,729,877,987.90	2,445,696,762.13
AAA 以下	124,130,205.66	120,291,276.98
未评级	872,695,799.99	1,459,198,179.73
合计	3,726,703,993.55	4,025,186,218.84

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产

负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,789,675.04	-	-	-	11,789,675.04
结算备付金	17,069,457.91	-	-	-	17,069,457.91
存出保证金	165,282.68	-	-	-	165,282.68
交易性金融资产	325,268,860.80	3,373,444,767.67	27,990,365.08	567,873,034.53	4,294,577,028.08
应收申购款	-	-	-	20,963,403.82	20,963,403.82
应收清算款	-	-	-	7,308,524.10	7,308,524.10
资产总计	354,293,276.43	3,373,444,767.67	27,990,365.08	596,144,962.45	4,351,873,371.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,135,325.08	9,135,325.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,974,183.15	1,974,183.15
应付托管费	-	-	-	658,061.04	658,061.04
卖出回购金融资产款	380,961,464.98	-	-	-	380,961,464.98
应付销售服务费	-	-	-	393,912.56	393,912.56
应交税费	-	-	-	2,553.73	2,553.73
其他负债	-	-	-	323,038.52	323,038.52
负债总计	380,961,464.98	-	-	12,487,074.08	393,448,539.06
利率敏感度缺口	-26,668,188.55	3,373,444,767.67	27,990,365.08	583,657,888.37	3,958,424,832.57
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	22,189,096.85	-	-	-	22,189,096.85
结算备付金	25,205,915.91	-	-	-	25,205,915.91
存出保证金	243,256.32	-	-	-	243,256.32
交易性金融资产	503,604,381.97	3,524,910,858.82	11,698,491.75	620,869,391.58	4,661,083,124.12
买入返售金融资产	-5,838.91	-	-	-	-5,838.91
应收申购款	-	-	-	7,593,143.23	7,593,143.23
应收清算款	-	-	-	25,187,222.67	25,187,222.67
资产总计	551,236,812.14	3,524,910,858.82	11,698,491.75	653,649,757.48	4,741,495,920.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,238,995.51	29,238,995.51
应付管理人报酬	-	-	-	2,167,065.34	2,167,065.34
应付托管费	-	-	-	722,355.12	722,355.12
应付清算款	-	-	-	19,482,415.01	19,482,415.01
卖出回购金融资产款	545,848,883.59	-	-	-	545,848,883.59
应付销售服务费	-	-	-	352,409.91	352,409.91
应交税费	-	-	-	13,516.58	13,516.58
其他负债	-	-	-	532,608.52	532,608.52
负债总计	545,848,883.59	-	-	52,509,365.99	598,358,249.58
利率敏感度缺口	5,387,928.55	3,524,910,858.82	11,698,491.75	601,140,391.49	4,143,137,670.61

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。

6.4.13.4.1.2 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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	18,796,600.20	19,007,453.14
	2. 市场利率上升 25 个基点	-18,636,887.99	-18,849,080.06

6.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	567,873,034.53	14.35	620,869,391.58	14.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	567,873,034.53	14.35	620,869,391.58	14.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	1. 沪深 300 指数上	23,383,022.73	26,003,521.03

	升 5%		
	2. 沪深 300 指数下 降 5%	-23,383,022.73	-26,003,521.03

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,526,058,509.99	1,645,300,659.45
第二层次	2,768,065,309.52	3,011,991,381.38
第三层次	453,208.57	3,791,083.29
合计	4,294,577,028.08	4,661,083,124.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	567,873,034.53	13.05
	其中：股票	567,873,034.53	13.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,726,703,993.55	85.63
	其中：债券	3,726,703,993.55	85.63
	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	28,859,132.95	0.66
8	其他各项资产	28,437,210.60	0.65
9	合计	4,351,873,371.63	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	185,232.00	0.00
B	采矿业	48,234,486.00	1.22
C	制造业	298,385,069.96	7.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,975,527.00	0.18
E	建筑业	1,699,134.64	0.04
F	批发和零售业	4,604,182.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	11,696,307.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,552,180.32	0.04
J	金融业	89,135,762.38	2.25
K	房地产业	90,665,491.06	2.29
L	租赁和商务服务业	5,272,983.00	0.13

M	科学研究和技术服务业	2,056,230.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	7,098,416.17	0.18
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	312,033.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	567,873,034.53	14.35

7.2.2 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。

7.3 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

金额单位：人民币元

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	000002	万科 A	3,737,700	52,402,554.00	1.32
2	000333	美的集团	506,175	29,823,831.00	0.75
3	601225	陕西煤业	1,589,400	28,911,186.00	0.73
4	601318	中国平安	609,211	28,267,390.40	0.71
5	600585	海螺水泥	1,135,458	26,955,772.92	0.68
6	601088	中国神华	628,400	19,323,300.00	0.49
7	600036	招商银行	523,600	17,153,136.00	0.43
8	002595	豪迈科技	431,500	15,158,595.00	0.38
9	600663	陆家嘴	1,283,239	12,665,568.93	0.32
10	000001	平安银行	798,400	8,966,032.00	0.23
11	001979	招商蛇口	660,374	8,604,673.22	0.22
12	000069	华侨城 A	1,842,595	8,107,418.00	0.20
13	000651	格力电器	210,598	7,688,932.98	0.19
14	601166	兴业银行	490,900	7,682,585.00	0.19
15	002142	宁波银行	294,686	7,455,555.80	0.19
16	600048	保利发展	553,800	7,216,014.00	0.18
17	002027	分众传媒	774,300	5,272,983.00	0.13
18	600352	浙江龙盛	448,000	4,188,800.00	0.11
19	300750	宁德时代	18,300	4,186,857.00	0.11
20	601688	华泰证券	298,234	4,106,682.18	0.10
21	600887	伊利股份	129,500	3,667,440.00	0.09
22	600276	恒瑞医药	74,700	3,578,130.00	0.09
23	300470	中密控股	70,500	3,258,510.00	0.08
24	002007	华兰生物	140,300	3,144,123.00	0.08
25	600196	复星医药	100,800	3,114,720.00	0.08
26	002500	山西证券	554,300	3,092,994.00	0.08
27	603225	新凤鸣	279,700	3,090,685.00	0.08
28	002475	立讯精密	93,600	3,037,320.00	0.08

29	600967	内蒙一机	293,800	2,967,380.00	0.07
30	002673	西部证券	453,300	2,878,455.00	0.07
31	603501	韦尔股份	29,111	2,854,042.44	0.07
32	603899	晨光股份	63,600	2,839,104.00	0.07
33	600764	中国海防	104,000	2,830,880.00	0.07
34	002242	九阳股份	189,000	2,825,550.00	0.07
35	300003	乐普医疗	123,700	2,796,857.00	0.07
36	603659	璞泰来	72,365	2,765,790.30	0.07
37	000750	国海证券	795,300	2,664,255.00	0.07
38	601311	骆驼股份	285,900	2,653,152.00	0.07
39	002233	塔牌集团	336,600	2,598,552.00	0.07
40	002402	和而泰	152,400	2,587,752.00	0.07
41	002352	顺丰控股	57,000	2,570,130.00	0.06
42	002396	星网锐捷	111,400	2,516,526.00	0.06
43	600567	山鹰国际	1,093,800	2,504,802.00	0.06
44	002008	大族激光	95,300	2,496,860.00	0.06
45	002926	华西证券	299,800	2,491,338.00	0.06
46	600909	华安证券	531,500	2,482,105.00	0.06
47	000895	双汇发展	100,800	2,468,592.00	0.06
48	002841	视源股份	36,700	2,453,028.00	0.06
49	300595	欧普康视	80,900	2,442,371.00	0.06
50	600299	安迪苏	291,600	2,324,052.00	0.06
51	002938	鹏鼎控股	94,600	2,297,834.00	0.06
52	600038	中直股份	57,600	2,293,632.00	0.06
53	300450	先导智能	63,400	2,293,178.00	0.06
54	002508	老板电器	90,600	2,291,274.00	0.06
55	002353	杰瑞股份	91,100	2,289,343.00	0.06
56	603337	杰克股份	120,000	2,284,800.00	0.06
57	000089	深圳机场	325,500	2,262,225.00	0.06
58	002138	顺络电子	94,000	2,247,540.00	0.06
59	600521	华海药业	121,688	2,240,276.08	0.06
60	002831	裕同科技	89,500	2,182,905.00	0.06
61	000401	冀东水泥	295,400	2,177,098.00	0.05
62	002415	海康威视	63,400	2,099,174.00	0.05
63	600201	生物股份	219,500	2,087,445.00	0.05
64	600346	恒力石化	145,400	2,083,582.00	0.05
65	000507	珠海港	375,000	2,073,750.00	0.05
66	002493	荣盛石化	177,700	2,068,428.00	0.05
67	002250	联化科技	197,200	2,062,712.00	0.05
68	603259	药明康德	33,000	2,056,230.00	0.05
69	002752	昇兴股份	428,700	2,036,325.00	0.05
70	600031	三一重工	121,500	2,020,545.00	0.05
71	603111	康尼机电	400,600	1,998,994.00	0.05

72	300207	欣旺达	122,200	1,994,304.00	0.05
73	603228	景旺电子	77,300	1,982,745.00	0.05
74	002916	深南电路	26,300	1,982,231.00	0.05
75	300673	佩蒂股份	139,700	1,955,800.00	0.05
76	603118	共进股份	145,400	1,932,366.00	0.05
77	300146	汤臣倍健	79,200	1,899,216.00	0.05
78	600155	华创云信	304,700	1,895,234.00	0.05
79	002526	山东矿机	755,700	1,889,250.00	0.05
80	300122	智飞生物	41,300	1,825,460.00	0.05
81	603866	桃李面包	180,192	1,823,543.04	0.05
82	002120	韵达股份	190,000	1,816,400.00	0.05
83	603699	纽威股份	120,300	1,790,064.00	0.05
84	300272	开能健康	333,700	1,768,610.00	0.04
85	300172	中电环保	369,100	1,767,989.00	0.04
86	002743	富煌钢构	307,000	1,765,250.00	0.04
87	601002	晋亿实业	352,800	1,749,888.00	0.04
88	600619	海立股份	268,900	1,745,161.00	0.04
89	002522	浙江众成	339,300	1,737,216.00	0.04
90	002361	神剑股份	427,800	1,732,590.00	0.04
91	603797	联泰环保	309,600	1,721,376.00	0.04
92	603980	吉华集团	400,800	1,711,416.00	0.04
93	300726	宏达电子	37,900	1,694,888.00	0.04
94	600133	东湖高新	256,600	1,690,994.00	0.04
95	000096	广聚能源	210,100	1,685,002.00	0.04
96	600612	老凤祥	23,900	1,670,132.00	0.04
97	601588	北辰实业	822,297	1,669,262.91	0.04
98	002391	长青股份	241,100	1,656,357.00	0.04
99	600894	广日股份	219,700	1,654,341.00	0.04
100	603002	宏昌电子	314,400	1,619,160.00	0.04
101	600168	武汉控股	268,500	1,613,685.00	0.04
102	000932	华菱钢铁	336,400	1,604,628.00	0.04
103	002412	汉森制药	242,900	1,595,853.00	0.04
104	600681	百川能源	340,200	1,588,734.00	0.04
105	002479	富春环保	334,300	1,557,838.00	0.04
106	002469	三维化学	244,000	1,500,600.00	0.04
107	002392	北京利尔	413,000	1,495,060.00	0.04
108	002419	天虹股份	253,800	1,484,730.00	0.04
109	601996	丰林集团	602,000	1,480,920.00	0.04
110	601515	东风股份	337,000	1,476,060.00	0.04
111	000717	中南股份	530,500	1,474,790.00	0.04
112	000848	承德露露	165,500	1,464,675.00	0.04
113	600217	中再资环	304,800	1,453,896.00	0.04
114	600693	东百集团	365,000	1,434,450.00	0.04

115	300951	博硕科技	26,150	1,428,574.50	0.04
116	002734	利民股份	151,300	1,394,986.00	0.04
117	002641	公元股份	246,700	1,391,388.00	0.04
118	002582	好想你	174,600	1,363,626.00	0.03
119	000541	佛山照明	238,700	1,362,977.00	0.03
120	300388	节能国祯	201,500	1,352,065.00	0.03
121	000789	万年青	170,600	1,322,150.00	0.03
122	600727	鲁北化工	231,500	1,319,550.00	0.03
123	002947	恒铭达	63,045	1,313,857.80	0.03
124	300790	宇瞳光学	84,600	1,289,304.00	0.03
125	603989	艾华集团	60,800	1,280,448.00	0.03
126	002677	浙江美大	120,600	1,277,154.00	0.03
127	002054	德美化工	182,900	1,276,642.00	0.03
128	002483	润邦股份	219,500	1,273,100.00	0.03
129	002301	齐心集团	176,600	1,269,754.00	0.03
130	600433	冠豪高新	372,000	1,268,520.00	0.03
131	000505	京粮控股	169,300	1,259,592.00	0.03
132	002404	嘉欣丝绸	186,800	1,259,032.00	0.03
133	002228	合兴包装	389,500	1,258,085.00	0.03
134	000900	现代投资	307,300	1,238,419.00	0.03
135	300692	中环环保	166,760	1,219,015.60	0.03
136	300599	雄塑科技	147,296	1,212,246.08	0.03
137	300021	大禹节水	243,200	1,208,704.00	0.03
138	002833	弘亚数控	61,396	1,207,045.36	0.03
139	002457	青龙管业	133,305	1,197,078.90	0.03
140	000949	新乡化纤	372,300	1,195,083.00	0.03
141	300441	鲍斯股份	195,300	1,193,283.00	0.03
142	002562	兄弟科技	279,700	1,191,522.00	0.03
143	002035	华帝股份	167,800	1,191,380.00	0.03
144	603380	易德龙	51,800	1,171,716.00	0.03
145	688098	申联生物	157,804	1,164,593.52	0.03
146	601368	绿城水务	216,800	1,149,040.00	0.03
147	603601	再升科技	265,400	1,133,258.00	0.03
148	002666	德联集团	215,800	1,115,686.00	0.03
149	300529	健帆生物	48,000	1,112,640.00	0.03
150	600073	上海梅林	152,100	1,110,330.00	0.03
151	002367	康力电梯	120,200	1,097,426.00	0.03
152	002376	新北洋	133,800	1,079,766.00	0.03
153	600269	赣粤高速	290,600	1,066,502.00	0.03
154	000544	中原环保	148,500	1,066,230.00	0.03
155	300664	鹏鹞环保	179,400	1,015,404.00	0.03
156	300259	新天科技	245,800	985,658.00	0.02
157	300232	洲明科技	98,200	897,548.00	0.02

158	300231	银信科技	98,400	876,744.00	0.02
159	002029	七匹狼	135,300	859,155.00	0.02
160	000881	中广核技	96,500	794,195.00	0.02
161	600737	中粮糖业	86,400	695,520.00	0.02
162	600033	福建高速	213,700	668,881.00	0.02
163	600831	广电网络	110,900	665,400.00	0.02
164	002763	汇洁股份	74,200	657,412.00	0.02
165	300602	飞荣达	39,000	604,110.00	0.02
166	603589	口子窖	10,300	508,305.00	0.01
167	300715	凯伦股份	23,000	326,140.00	0.01
168	300136	信维通信	16,100	323,288.00	0.01
169	002019	亿帆医药	21,200	309,520.00	0.01
170	002925	盈趣科技	12,500	242,500.00	0.01
171	002632	道明光学	32,100	233,688.00	0.01
172	002672	东江环保	36,800	218,960.00	0.01
173	300133	华策影视	30,500	216,245.00	0.01
174	002124	天邦食品	40,800	185,232.00	0.00
175	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
176	300413	芒果超媒	2,800	95,788.00	0.00
177	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
178	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
179	002695	煌上煌	6,100	65,209.00	0.00
180	603180	金牌厨柜	1,800	60,336.00	0.00
181	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
182	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
183	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
184	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
185	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
186	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
187	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
188	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
189	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
190	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
191	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
192	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000719	中原传媒	13,218,110.64	0.32
2	000002	万科 A	6,725,061.00	0.16

3	600663	陆家嘴	5,470,817.00	0.13
4	601318	中国平安	5,198,229.00	0.13
5	000001	平安银行	4,107,896.00	0.10
6	300750	宁德时代	4,056,244.00	0.10
7	601088	中国神华	3,163,623.00	0.08
8	601225	陕西煤业	3,148,237.00	0.08
9	002926	华西证券	3,066,025.00	0.07
10	600036	招商银行	3,013,550.00	0.07
11	000333	美的集团	2,894,509.00	0.07
12	300595	欧普康视	2,761,478.00	0.07
13	603659	璞泰来	2,661,905.00	0.06
14	603501	韦尔股份	2,645,662.58	0.06
15	002475	立讯精密	2,595,708.00	0.06
16	300450	先导智能	2,591,128.00	0.06
17	002353	杰瑞股份	2,567,464.00	0.06
18	603259	药明康德	2,560,094.00	0.06
19	600521	华海药业	2,527,385.56	0.06
20	300122	智飞生物	2,516,779.00	0.06

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	19,161,112.00	0.46
2	600036	招商银行	16,811,917.00	0.41
3	000719	中原传媒	14,343,801.79	0.35
4	000651	格力电器	11,925,333.00	0.29
5	601225	陕西煤业	7,850,960.00	0.19
6	000002	万 科 A	6,192,313.00	0.15
7	000001	平安银行	5,880,999.00	0.14
8	600048	保利发展	5,782,584.00	0.14
9	601658	邮储银行	5,160,526.00	0.12
10	000581	威孚高科	5,118,326.00	0.12
11	000333	美的集团	5,039,542.30	0.12
12	601138	工业富联	3,894,053.00	0.09
13	002236	大华股份	3,792,886.00	0.09
14	600612	老凤祥	3,771,942.00	0.09
15	688041	海光信息	3,567,290.30	0.09
16	300133	华策影视	3,533,925.00	0.09
17	601166	兴业银行	3,492,164.00	0.08
18	603043	广州酒家	3,437,260.00	0.08

19	300476	胜宏科技	3,231,921.00	0.08
20	600585	海螺水泥	3,157,842.00	0.08

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	203,031,571.43
卖出股票收入（成交）总额	274,318,158.90

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,768,065,309.52	69.93
	其中：政策性金融债	872,695,799.99	22.05
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）	958,638,684.03	24.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,726,703,993.55	94.15

7.6 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	110059	浦发转债	3,386,110	366,012,329.81	9.25
2	113052	兴业转债	2,264,230	230,301,781.07	5.82
3	150218	15 国开 18	1,800,000	190,732,487.67	4.82
4	128129	青农转债	1,208,673	122,430,793.03	3.09
5	190404	19 农发 04	1,200,000	122,272,229.51	3.09

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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浦发转债（代码：110059 SH）、兴业转债（代码：113052 SH）、青农转债（代码：128129 SZ）、上银转债（代码：113042 SH）、21 国信（代码：04149536 SZ）、23 国君 G4（代码：138890 SH）、22 招证 G4（代码：137654 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. 上海浦东发展银行股份有限公司

2022 年 8 月 17 日，上海浦东发展银行股份有限公司因未依法履行职责被上海市市场监督管理局罚款。

2022 年 9 月 2 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得、通知整改。

2022 年 10 月 24 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被中国银行间市场交易商协会诫勉谈话、通知整改。

2022 年 10 月 26 日，上海浦东发展银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会诫勉谈话。

2. 兴业银行股份有限公司

2022 年 10 月 28 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2022 年 11 月 4 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会罚款。

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。

3. 青岛农村商业银行股份有限公司

2023 年 4 月 28 日，青岛农村商业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会青岛监管局罚款。

4. 上海银行股份有限公司

2023 年 4 月 21 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得。

5. 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。

6. 国泰君安证券股份有限公司

2022 年 11 月 11 日，国泰君安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通知整改。

2023 年 1 月 16 日，国泰君安证券股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行上海分行罚款。

2023 年 5 月 11 日，国泰君安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上海监管局出具警示函。

7. 招商证券股份有限公司

2022 年 7 月-11 月，招商证券股份有限公司因内部制度不完善、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规多次被中国证券监督管理委员会警示、立案调查、罚款、没收违法所得、通知整改。

2022 年 8 月-9 月，招商证券股份有限公司因内部制度不完善，产品不合格被深圳证券交易所、

上海证券交易所书面警示。

2022 年 8 月-2023 年 6 月，招商证券股份有限公司因内部制度不完善、未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2022 年 8 月 24 日，招商证券股份有限公司因内部制度不完善、产品不合格被上海证券交易所警示。

2023 年 6 月 8 日，招商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。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	165,282.68
2	应收清算款	7,308,524.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,963,403.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,437,210.60

7.12.4 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	366,012,329.81	9.25
2	113052	兴业转债	230,301,781.07	5.82
3	128129	青农转债	122,430,793.03	3.09
4	113042	上银转债	105,415,530.05	2.66
5	113037	紫银转债	18,680,766.55	0.47
6	113065	齐鲁转债	10,341,498.80	0.26
7	123076	强力转债	9,424,214.84	0.24
8	113624	正川转债	6,764,782.80	0.17
9	118020	芳源转债	6,644,315.40	0.17
10	123128	首华转债	6,609,589.59	0.17

11	118000	嘉元转债	6,332,230.91	0.16
12	113608	威派转债	5,396,480.06	0.14
13	113584	家悦转债	5,206,925.64	0.13
14	113610	灵康转债	4,010,316.99	0.10
15	128125	华阳转债	3,707,172.78	0.09
16	123153	英力转债	3,685,204.25	0.09
17	123113	仙乐转债	3,429,886.50	0.09
18	127024	盈峰转债	3,293,014.43	0.08
19	113653	永 22 转债	2,756,570.91	0.07
20	123126	瑞丰转债	2,737,633.38	0.07
21	128116	瑞达转债	2,548,588.45	0.06
22	123155	中陆转债	2,498,047.28	0.06
23	123106	正丹转债	2,464,991.87	0.06
24	113593	沪工转债	2,350,780.48	0.06
25	123093	金陵转债	2,323,805.10	0.06
26	123039	开润转债	2,320,818.57	0.06
27	128118	瀛通转债	2,267,497.32	0.06
28	113600	新星转债	2,098,743.34	0.05
29	123082	北陆转债	2,065,933.00	0.05
30	118010	洁特转债	2,064,728.44	0.05
31	113606	荣泰转债	2,054,644.27	0.05
32	128117	道恩转债	2,053,449.74	0.05
33	127041	弘亚转债	1,985,782.41	0.05
34	128063	未来转债	1,419,399.12	0.04
35	118005	天奈转债	1,182,137.34	0.03
36	118004	博瑞转债	1,172,190.30	0.03
37	113625	江山转债	936,962.41	0.02
38	123132	回盛转债	788,666.40	0.02
39	123056	雪榕转债	674,895.73	0.02
40	113046	金田转债	179,039.06	0.00
41	132026	G 三峡 EB2	5,533.83	0.00
42	113056	重银转债	1,011.78	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 (%)
安信新趋势混合 A	106,811	12,366.72	698,582,013.96	52.89	622,320,148.49	47.11
安信新趋势混合 C	146,162	13,885.66	650,890,215.49	32.07	1,378,665,581.68	67.93
合计	249,898	13,407.30	1,349,472,229.45	40.28	2,000,985,730.17	59.72

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）。

8.2 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	安信新趋势混合 A	232,665.12	0.02
	安信新趋势混合 C	123,354.99	0.01
	合计	356,020.11	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）。

8.3 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	安信新趋势混合 A	0
	安信新趋势混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信新趋势混合 A	0
	安信新趋势混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日）基金份额总额	8,930.97	200,399,193.77
本报告期期初基金份额总额	1,806,632,510.63	1,771,410,498.89
本报告期基金总申购份额	334,833,282.04	1,407,139,040.81
减：本报告期基金总赎回份额	820,563,630.22	1,148,993,742.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,320,902,162.45	2,029,555,797.17

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金管理人于 2023 年 5 月 20 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第十六次会议审议通过，张翼飞先生自 2023 年 5 月 18 日起担任公司副总经理。

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基

金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
中信建投	4	275,240,068.60	60.01	253,580.56	65.71	-
山西证券	2	183,454,280.47	39.99	132,320.51	34.29	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	新租
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新租
西部证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等服务作为交易单元的选择标准，由分管投资领导、投资部门、研究部门、交易部对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

10.7.2 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	成交金额	占当期债	成交	占当期权

		券 成交总额 的比例 (%)		券回购成 交总额的 比例 (%)	金额	证 成交总额 的比例 (%)
中信建投	914,278,759.40	93.18	14,786,460,000.00	61.74	-	-
山西证券	66,936,499.96	6.82	9,164,569,000.00	38.26	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-01-19
2	安信基金管理有限责任公司关于基金经理恢复履职的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2023-02-21
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-03-30
4	安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报	2023-04-04
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-04-21
6	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-20
7	安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-22
8	安信基金管理有限责任公司关于取消安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额和安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额参加交通银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2023-05-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

12.3 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

2023年8月29日