

安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 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 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信楚盈一年持有混合
基金主代码	014621
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	444,319,859.09 份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置方面，本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、衍生品、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。债券投资方面，本基金将综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、类属配置策略、个券选择策略、信用债投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略等策略。股票投资方面，本基金管理人将采用自下而上的研究方法，采取定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面进行深入分析，运用不同的估值方法对上市公司的估值水平进行分析，精选优质股票构建投资组合。此外，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进行投资，并适当投资于资产支持证券。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调

	整) × 5% + 中债总指数 (全价) 收益率 × 80%	
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	安信楚盈一年持有混合 A	安信楚盈一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	014621	014622
报告期末下属分级基金的份额总额	331,782,682.27 份	112,537,176.82 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)	
	安信楚盈一年持有混合 A	安信楚盈一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	-4,971,586.92	-1,903,602.18
2. 本期利润	1,889,764.96	372,470.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0055	0.0032
4. 期末基金资产净值	322,174,855.66	107,389,597.52
5. 期末基金份额净值	0.9710	0.9543

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

安信楚盈一年持有混合 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

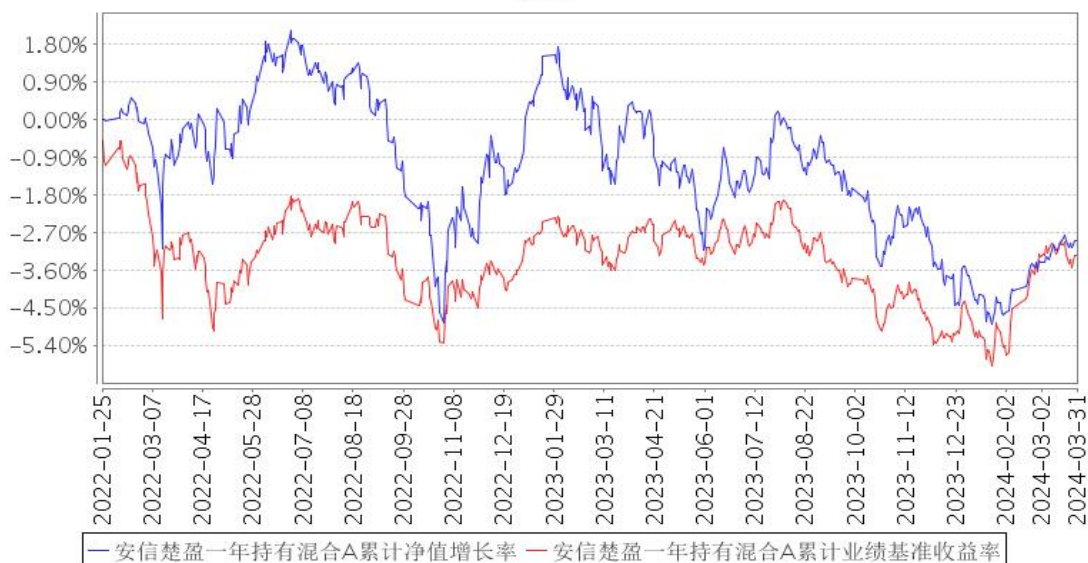
过去三个月	0.62%	0.16%	1.16%	0.23%	-0.54%	-0.07%
过去六个月	-1.29%	0.22%	0.60%	0.20%	-1.89%	0.02%
过去一年	-3.22%	0.24%	-0.41%	0.18%	-2.81%	0.06%
自基金合同生效起至今	-2.90%	0.31%	-3.23%	0.23%	0.33%	0.08%

安信楚盈一年持有混合 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	0.43%	0.16%	1.16%	0.23%	-0.73%	-0.07%
过去六个月	-1.67%	0.22%	0.60%	0.20%	-2.27%	0.02%
过去一年	-3.98%	0.24%	-0.41%	0.18%	-3.57%	0.06%
自基金合同生效起至今	-4.57%	0.31%	-3.23%	0.23%	-1.34%	0.08%

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

安信楚盈一年持有混合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



安信楚盈一年持有混合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 2022 年 1 月 25 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		
聂世林	本基金的基金经理，均衡投资部副总经理	2022年1月25日	-	15年	聂世林先生，经济学硕士。历任安信证券股份有限公司资产管理部研究员、证券投资部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部、权益投资部基金经理助理、权益投资部基金经理，现任安信基金管理有限责任公司均衡投资部副总经理。现任安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；安信优势增长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、安信价值成长混合型证券投资基金、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信楚盈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的基金经理。
张睿	本基金的基金经	2022年1月25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

	理，固定收益部总经理			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、安信 90 天滚动持有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

2024 年一季度国内经济延续弱修复态势，内生动能有边际上升趋势、仍呈现结构分化。人民币汇率持续贬值，期间多数宏观指标低于市场预期。

海外方面，美国经济韧性和通胀粘性均大幅超市场预期，美联储议息会议维持利率不变，降息短期落空但趋势未改。一季度美元指数震荡上行、美债收益率再度上行。国内方面，在连续 5 个月位于荣枯线下方后，3 月制造业 PMI 重回扩张区间，结构上生产端的修复强于需求端，反映了现阶段经济内生动能仍待改善。具体来看，投资同比增速回升，制造业投资表现强劲，主要受益于纺织业、食品制造业和运输行业的需求增长；基建投资在财政托底下保持较高速增长，但受一季度专项债发行节奏偏慢、项目开工率低于往年影响，同比增速较去年有所下滑；房地产政策虽然在积极推进，部分城市二手房成交量有所回升，但市场“以价换量”逻辑未变，地产链仍面临较大挑战。消费受假日经济提振，总体景气、社零增速好于预期，结构上呈现服务消费占优，但居民意愿和能力呈现分化。出口在外需动能边际增强的支撑和低基数下同比增速大幅回升，但外贸环境的不确定性未来仍将对我国出口增速形成一定压制。融资端，受专项债发行进度偏慢、春节错位等因素影响，新增社融和信贷数据在 1 月经历“开门红”以后双双回落，呈现居民部门需求收缩，显著弱于企业部门。通胀数据维持低位，CPI 在假期效应的支撑下由负转正，PPI 连续 17 个月录得负值。货币政策方面，央行 1 月下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，2 月下调 5 年期以上 LPR 25 个基点，为该期限 LPR 的单次历史最大降幅，反映了货币政策对经济金融形势的及时响应。在央行 2023 年四季度货币政策执行报告和政府工作报告中都强调“稳健的货币政策要灵活适度、精准有效”“保持流动性合理充裕，社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配”。债券市场一季度受供需失衡、降息预期升温、风险偏好下降和机构行为等多重因素的推动，收益率大幅下行，收益率曲线先平后陡，超长端利率债收益率下行显著、期间 10-30 年国债突破历史低位，信用利差较 2023 年四季度末继续分化，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。权益市场一季度经历先跌后涨行情，年初微盘股流动性危机，市场风险偏好迅速降温，主要指数大幅调整，随着政策的不断推进，权益市场情绪逐渐企稳，指数迎来震荡反弹。转债市场一季度跟随正股经历先跌后涨行情，转股溢价率先走阔至历史最高水平后有所收敛，在年初大幅回调后，债性转债到期收益率大幅上行、相对纯债性价比提升，大盘转债、债性转债和双低转债在一季度取得正收益。

报告期内，本基金相较 2023 年四季度末降低了股票和可转债资产的持仓比例，行业配置方面，

减仓高股息的煤炭、光伏，加仓 AI 软硬件、锂电以及有色。债券方面，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。年初提高债券组合久期，两会结束后逐步降低债券组合久期和杠杆比例，期间通过利率债和信用债做波段交易增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信楚盈一年持有混合 A 基金份额净值为 0.9710 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.62%；安信楚盈一年持有混合 C 基金份额净值为 0.9543 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；同期业绩比较基准收益率为 1.16%。

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	47,248,131.47	10.13
	其中：股票	47,248,131.47	10.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	417,969,339.21	89.62
	其中：债券	417,969,339.21	89.62
	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	1,158,824.82	0.25
8	其他资产	5,693.73	0.00
9	合计	466,381,989.23	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 12,862,376.17 元，占净值比例 2.99%。

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	465,500.00	0.11
B	采矿业	4,343,828.00	1.01
C	制造业	24,642,927.30	5.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	458,671.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	635,830.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,352,036.00	0.31
J	金融业	634,923.00	0.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	410,016.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	843,608.00	0.20
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	598,416.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,385,755.30	8.00

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	774,991.46	0.18
原材料	1,076,183.64	0.25
工业	-	-
非日常生活消费品	758,755.15	0.18
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	10,173,576.07	2.37
公用事业	-	-
房地产	78,869.85	0.02
合计	12,862,376.17	2.99

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	00700	腾讯控股	35,500	9,777,051.10	2.28
2	600519	贵州茅台	5,400	9,195,660.00	2.14
3	300750	宁德时代	27,600	5,248,416.00	1.22
4	000858	五粮液	21,000	3,223,710.00	0.75
5	601088	中国神华	36,600	1,430,694.00	0.33
6	600809	山西汾酒	5,800	1,421,464.00	0.33
7	300442	润泽科技	43,600	1,352,036.00	0.31
8	002304	洋河股份	11,700	1,142,505.00	0.27
9	601001	晋控煤业	72,100	1,109,619.00	0.26
10	02899	紫金矿业	76,000	1,076,183.64	0.25

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	37,964,232.38	8.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,007,507.81	44.23
	其中：政策性金融债	113,327,635.25	26.38
4	企业债券	45,218,777.81	10.53
5	企业短期融资券	42,017,222.58	9.78
6	中期票据	59,695,309.73	13.90
7	可转债（可交换债）	43,066,288.90	10.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	417,969,339.21	97.30

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	240426	23 京城 04	250,000	25,535,850.69	5.94
2	230207	23 国开 07	250,000	25,489,959.02	5.93
3	210208	21 国开 08	200,000	20,643,475.41	4.81
4	092318005	23 农发清发 05	200,000	20,272,786.89	4.72
5	2420002	24 北部湾银行小微债 01	140,000	14,099,331.15	3.28

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的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-59,653.06
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 24 北部湾银行小微债 01（代码：2420002 CY）、23 包钢 CP001（代码：042380211 CY）、20 民生银行二级（代码：2028022 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. 广西北部湾银行股份有限公司

2023 年 5 月 29 日，广西北部湾银行股份有限公司因未依法履行职责被广西壮族自治区市场

监督管理局罚款。

2023 年 8 月 28 日，广西北部湾银行股份有限公司因违规经营、工作人员贪污、挪用、侵占银行或者客户的资金被国家金融监督管理总局广西监管局罚款。

2023 年 12 月 27 日，广西北部湾银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局广西壮族自治区分局警告、罚款。

2. 内蒙古包钢钢联股份有限公司

2023 年 6 月 16 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因未依法履行职责被包头市昆都仑区应急管理局罚款。

2023 年 10 月 7 日-11 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因违反安全生产行为多次被包头市昆都仑区应急管理局罚款。

2023 年 10 月 17 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因违法占地被包头市白云鄂博矿区自然资源局没收非法财物、责令改正。

2023 年 10 月 18 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因违反安全生产行为、违规经营被包头市昆都仑区应急管理局罚款。

2023 年 10 月 25 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因违反安全生产行为被包头市昆都仑区应急管理局罚款。

2024 年 1 月 5 日，内蒙古包钢钢联股份有限公司因未依法履行职责被包头市应急管理局罚款。

3. 中国民生银行股份有限公司

2023 年 5 月 9 日，中国民生银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会立案调查。

2023 年 8 月 16 日，中国民生银行股份有限公司因违规事项被中国银行间市场交易商协会责令限期改正、一般警告。

2023 年 8 月 18 日，中国民生银行股份有限公司因内部制度不完善、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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	5,671.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	21.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,693.73

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	110085	通 22 转债	4,862,580.41	1.13
2	113037	紫银转债	4,829,588.63	1.12
3	123107	温氏转债	3,454,916.16	0.80
4	113056	重银转债	3,347,424.84	0.78
5	127045	牧原转债	2,863,244.52	0.67
6	113584	家悦转债	2,249,237.44	0.52
7	113052	兴业转债	2,083,564.38	0.49
8	127061	美锦转债	1,852,866.85	0.43
9	110079	杭银转债	1,674,868.36	0.39
10	113055	成银转债	1,559,903.31	0.36
11	127018	本钢转债	1,552,385.92	0.36
12	118020	芳源转债	1,111,963.03	0.26
13	128129	青农转债	833,648.00	0.19
14	110047	山鹰转债	755,379.59	0.18
15	123146	中环转 2	715,777.81	0.17
16	127049	希望转 2	620,958.08	0.14
17	113059	福莱转债	558,431.51	0.13
18	113042	上银转债	554,575.21	0.13
19	110059	浦发转债	544,985.62	0.13
20	127089	晶澳转债	518,363.29	0.12
21	123104	卫宁转债	437,100.52	0.10
22	128048	张行转债	433,214.79	0.10
23	110075	南航转债	418,126.01	0.10
24	113033	利群转债	370,510.00	0.09
25	127071	天箭转债	341,927.92	0.08
26	113046	金田转债	339,546.89	0.08
27	123093	金陵转债	333,132.93	0.08
28	113051	节能转债	332,477.29	0.08
29	113625	江山转债	331,513.15	0.08
30	118000	嘉元转债	315,124.93	0.07

31	127019	国城转债	304,514.38	0.07
32	123126	瑞丰转债	222,221.75	0.05
33	113048	晶科转债	210,003.56	0.05
34	113640	苏利转债	206,312.88	0.05
35	118026	利元转债	190,398.79	0.04
36	128127	文科转债	150,910.90	0.04
37	113665	汇通转债	127,279.44	0.03
38	113060	浙 22 转债	124,495.12	0.03
39	113050	南银转债	113,964.93	0.03
40	127040	国泰转债	108,482.44	0.03
41	128125	华阳转债	108,025.48	0.03
42	128138	侨银转债	105,742.60	0.02
43	128105	长集转债	105,113.70	0.02
44	113053	隆 22 转债	101,080.79	0.02
45	123190	道氏转 02	94,406.05	0.02
46	123156	博汇转债	88,719.87	0.02
47	123085	万顺转 2	66,080.96	0.02
48	123151	康医转债	62,004.23	0.01
49	113624	正川转债	53,764.49	0.01
50	118013	道通转债	53,221.30	0.01
51	113610	灵康转债	51,888.90	0.01
52	118014	高测转债	50,982.66	0.01
53	118008	海优转债	48,753.62	0.01
54	123186	志特转债	43,194.50	0.01
55	118030	睿创转债	40,323.46	0.01
56	123133	佩蒂转债	37,064.71	0.01

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	安信楚盈一年持有混合 A	安信楚盈一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	361,168,317.86	125,667,943.92
报告期期间基金总申购份额	66,417.55	3,459.36
减：报告期期间基金总赎回份额	29,452,053.14	13,134,226.46
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	331,782,682.27	112,537,176.82

§ 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楚盈一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信楚盈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 4 月 19 日