

安信证券策略优选1号集合资产管理计划 2023年年度报告

资产管理人:安信证券资产管理有限公司

资产托管人:上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行

报告期:2023年01月01日-2023年12月31日

重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的主要财务指标、报告期内资产管理计划投资收益分配情况、投资组合报告（不包含业绩报酬）、集合计划份额变动情况的财务数据的内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及风险揭示书。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

一、资产管理计划产品概况

| | |
|----------------|--------------------|
| 资产管理计划全称 | 安信证券策略优选1号集合资产管理计划 |
| 资产管理计划简称 | 安信证券策略优选1号 |
| 资产管理计划编码 | SGE564 |
| 资产管理计划成立日 | 2019年04月02日 |
| 资产管理人 | 安信证券资产管理有限公司 |
| 资产托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行 |
| 报告期末资产管理计划份额总额 | 80,892,681.26份 |

二、主要财务指标、资产管理计划净值表现、利润分配情况以及业绩表现

（一）主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| | |
|------------------|----------------|
| 期间数据和指标 | |
| 本期已实现收益 | 8,403,454.35 |
| 本期利润 | -904,973.62 |
| 本期资产管理计划份额净值增长率 | 2.97% |
| 期末数据和指标 | |
| 期末可供分配利润 | 76,198,056.02 |
| 期末可供分配资产管理计划份额利润 | 0.9420 |
| 期末资产管理计划资产净值 | 157,090,737.28 |
| 期末资产管理计划份额净值 | 1.9420 |
| 累计期末指标 | |
| 资产管理计划份额累计净值增长率 | 94.20% |

(二) 集合计划成立以来净值变动情况

安信证券策略优选1号集合资产管理计划成立以来净值变动情况
(2019年04月02日-2023年12月31日)



（三）收益分配情况

本报告期内未进行收益分配。

三、管理人报告

（一）报告期内资产管理计划的投资表现

截至期末，安信证券策略优选1号集合资产管理计划单位净值为1.9420元，累计单位净值1.9420元，集合计划本期单位净值增长率2.97%。

（二）投资经理（或投资经理小组）简介

胡红伟，男，华东师范大学金融学硕士。2009年至今先后任职于上海昂诺投资管理有限公司、西藏同信证券股份有限公司、万联证券股份有限公司从事权益研究与投资工作，2018年加入安信证券资产管理部，担任投资经理。现任安信资管权益投资部投资经理。管理的安信证券策略优选1号集合资产管理计划曾荣获一年期金牛奖和英华奖。

（三）投资经理工作报告

1、市场回顾和运作情况

2023年，沪深300指数年线历史上首次出现三连阴走势，8月到12月出现历史上首次的月线五连阴走势。表现在指数上则是各个指数继2022年下跌后再次收跌，其中上证指数全年下跌3.70%、沪深300指数下跌11.38%、创业板指下跌19.41%、万得全A全年下跌5.19%。从行业角度看，31个申万一级行业有10个行业上涨，涨幅超过10%的仅有通讯和传媒两个行业，但有6个行业跌幅超过20%，美容护理和商贸零售跌幅超过30%，结构重仓行业普遍跌幅较大。

回顾2023年，年初基于对疫后恢复的憧憬，投资者对行情充满期望。但三个因素导致了市场走势出现巨大偏差，一是地产行业大幅低于市场预期。基于疫情后购买需求释放的预期，投资者普遍对2023年房地产销量企稳抱有期待。但实际情况是地产销售3月份短暂释放后又快速下滑，碧桂园暴雷将投资者对地产的担忧提升到一个新的高度。8月份碧桂园上市债券停止交易直接诱发了外资持续大幅的外逃，也导致海外评级机构调降中国主权评级。对国内投资者而言，地产行业的恶化一方面影响机构投资者对经济的预期。另一方面房价下跌导致居民财富缩水压制居民的信心和消费需

求，使得经济和资产出现负向循环。地产问题是 2023 年市场波动的一个核心问题；二是亏钱效应对投资者信心的冲击。20-21 年大多数投资者通过公募通道进入的 A 股市场，且网络销售中占比较高，年轻人、银行理财是重要资金来源。连续深幅的亏损对初入市场的投资者带来较重的伤害，银行理财本就低风险偏好，连续的受伤使得资金对权益产品的畏惧心理极重，小级别反弹行情并不能带来预期的改善。同时，因为年轻群体具备网络话语权，使得负面情绪的传递和酝酿既快速又极端，这大幅压制了市场风险偏好的恢复；三是市场交易结构对行情运行的影响。截止到 23 年 12 月，北向资金、融资资金和量化交易占日交易总量约 30%-40%之间，这批资金交易逻辑是日内高抛低吸，对政策、基本面所有的因素均无关，这就导致日内一旦冲高面临极大的抛压。在供需平衡市场影响并不大，但在风险偏好持续压缩的市场，巨量高抛低吸的资金卖出带来的跟风盘和买入带来的跟风盘完全不成正比，这导致市场持续阴跌的出现。8 月 28 日政策组合拳出台，巨量日内资金瞬间的卖出将仅有的一次多头反击机会彻底磨灭。当前这种交易结构导致的直接结果是日内波动率的大幅下滑，但日线级别的趋势性越来越强，这也是下半年 A 股市场众多利好不涨的重要原因。纵观 2023 年市场影响因素，交易、情绪因素重于基本面因素，市场的极端走势是多方面因素的综合结果。

策略优选 1 号年初对 2023 年判断也比较乐观，核心逻辑是经过 22 年下跌，市场仓位并不重，公募发行萎缩到低位之后对市场资金影响减少。综合考虑公募、私募、外资等资金通道判断 2023 年市场微观资金面要好于 2022 年。但实际情况是因为部分非基本面因素，散户风险偏好降至新低，比 2022 年疫情极端情况下还低，这导致市场微观资金面在 2023 年仍处于失衡状态。在操作上，4 月中旬略微降低仓位规避了 4 月下旬到 5 月份的下跌，但下半年持续保持高仓位，由此导致收益持续缩水。最终，策略优选 1 号 2023 年净值小幅上涨 2.97%，大幅跑赢主要指数和业绩基准。产品自成立（2019.4.2）至 2023 年底，实现总收益 94.20%，超额收益 99.61%，超过中证 500 指数 99.91%。

2、2024 年市场展望

当前市场的起点环境是风险偏好处于极端低位，除公募群体外，市场存量资金仓位处于较低水平，投资者对未来预期也处于极低状态。这与 2023 年有较大的区别，因为预期足够低，那么再度出现低于预期的可能性大幅下降。

回归短期市场波动本质，市场涨跌决定于买卖力量的强弱对比，即使市场像 2023 年一样低迷，没有资金流入，那么市场环境也将大幅优于 2023 年。就资金流入端考虑，因为 A 股市场极低估值（上证 50 分红收益率高达 4.4%，沪深 300 指数分红收益率 3.34%），保险资金大概率会成为重要的增量流出端口。包括国家队、产业资本等等资金也在陆陆续续的流入市场，整体资金流入通道也明显优于 2023 年。仅从资金供需角度考虑，2024 年也没有悲观的必要。同时，国内资产荒的困境在不断加重。2022 年居民超储增加 8 万亿，2023 年并没有消耗超储，反而继续大幅增加。截止到 2023

年 11 月底，居民超储又增加 5 万亿。与此同时，利率下行的趋势在延续，3 年期存款利率已经低于 2%。2024 年固收型理财产品收益率大概率降至 3.3% 左右的水平，全社会可投资的方向越来越少。与不动产、实业相比，权益资产是最被低估的方向，只不过受制于信心的问题无法快速修复。但一旦投资者认知到权益投资的高性价比（中证红利指数分红收益率超过 6%），那么资产荒将成为市场上行的重要的推动力。市场不能排除走出一波大级别行情的可能。

业绩层面，在先立后破、以进促稳基调之下，经济将延续弱复苏态势，并支撑企业盈利逐步改善。叠加新一轮库存周期，2024 年全部 A 股净利润增速有望达到 5%-10% 的区间。2023 年受到地产拖累的情况也将大幅好转，主要原因是地产销售面积已经将至 8 亿平方米左右，这是刚需的水平，继续大幅萎缩的概率并不大。由于 2023 年经济低于预期，投资者对 2024 年并没有过度的期盼，企业业绩和经济基本面真实情况与投资者之间的预期差在 2024 年有利于股票市场表现。

外围因素，美国 10 年期国债在 23 年底已经降低至 3.8% 的水平，已经确定美联储加息周期的结束，24 年市场预期存在 3 次左右的降息。一方面国内货币政策掣肘因素下降，另一方面外资因为息差流出的压力大幅减小。中美贸易从 11 月开始同比转正，两国长期竞争短期缓和的特征较为明显。因为美国大选以及经济压力加大，2024 年中美关系大概率并不会成为掣肘 A 股的重要因素。

交易结构角度，日内高抛低吸资金占比过高问题对市场影响并不是单向的。其主要机制是不同风险偏好变动趋势下卖出和买入带来的跟风交易不同，下跌端会导致利好效应萎缩，但上涨端也会呈现增强的特征。举个例子就是日内高抛低吸资金不会改变弹簧是压缩还是回弹，但会影响压缩的程度和时间。2023 年过度的压制使得市场出清极其充分，2024 年随着微观资金面的扭转，日内高抛低吸资金阶段性会放大市场上行波动。

综合看影响市场的各种因素，业绩、政策、外围等等因素均已经发生明显的积极变化，但受制于交易结构的压制，市场整个 2023 年都处于出清的过程之中。直到年底，微观资金面流入流出开始达到均衡，一旦微观资金面临临界点到来，市场拐点也将随之而来。2024 年 A 股市场业绩向上，流动性充裕，外围因素转多，在风险偏好极低的基础上，没有必要在随波逐流看空市场。正是没有期望，才会出现意外之喜。

3、下阶段投资策略

2023 年配置以疫后修复的消费、科技以及证券为主，截止到年底，依然维持了这样的配置结构。就目前市场核心矛盾变化看，已经从疫后恢复预期阶段转向业绩验证阶段（23 年 3 季度全 A 净利润增速转正）。从高景气度延续和困境反转两条路径出发，线下消费包括餐饮、旅游、影视依然是景气度最高的方向，经历了 2023 年估值的压缩，依然具备足够的吸引力。科技方向则是因为全球技术突破浪潮和政策导向，持续是市场关注的焦点。电子板块因为手机换机需求增加和元宇宙的突破出现了行业性

拐点，计算机也受益于技术变革的浪潮。2024 年两个行业大概率仍是重要的配置方向。另外，A 股高分红个股已经具备较强的吸引力，在资产荒背景下，存在价值重估的诉求，也会是 2024 年的重要线索。当前，策略优选 1 号配置集中在电子、消费、计算机等领域，辅助性配置了证券、交运等行业。在持仓没有达到预期目标之前，将维持当前配置结构，并且将维持高仓位运作。

（四）风险控制报告

1. 集合计划合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他相关法律法规的规定，严格执行内部各项管理制度，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书、与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

2. 风险控制报告

本报告期内，管理人针对本集合计划的运作特点，通过日常风险监控工作和风险预警机制，对业务运作过程中可能出现的风险状况进行全面检查，及时进行风险提示，评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关法律法规、公司制度和集合计划合同书进行集合计划资产的管理运作。本集合计划持有的证券符合投资范围及投资比例的要求，相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

四、年度财务报表

（一）资产负债表

报告截止日： 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|-----|------------------|------------------|
| 资产： | | |

| | | |
|-------------|--------------------------|--------------------------|
| 货币资金 | 1, 151, 239. 70 | 1, 730, 783. 16 |
| 结算备付金 | 2, 021, 972. 12 | 2, 456, 138. 57 |
| 存出保证金 | 19, 143. 40 | 29, 955. 19 |
| 衍生金融资产 | | |
| 应收清算款 | 1, 073, 582. 91 | 645, 525. 38 |
| 应收利息 | | |
| 应收股利 | | |
| 应收申购款 | | |
| 买入返售金融资产 | 2, 999, 656. 98 | 7, 997, 744. 12 |
| 发放贷款和垫款 | | |
| 交易性金融资产 | 150, 295, 323. 09 | 104, 379, 745. 07 |
| 债权投资 | | |
| 其他债权投资 | | |
| 其他权益工具投资 | | |
| 长期股权投资 | | |
| 其他资产 | | |
| 资产合计 | 157, 560, 918. 20 | 117, 239, 891. 49 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | | |
| 交易性金融负债 | | |
| 衍生金融负债 | | |
| 卖出回购金融资产款 | | |
| 应付管理人报酬 | 402, 569. 93 | 293, 039. 03 |
| 应付托管费 | 12, 077. 10 | 8, 791. 19 |
| 应付销售服务费 | | |
| 应付投资顾问费 | | |
| 应交税费 | 9, 443. 35 | 2, 222. 08 |
| 应付清算款 | | |

| | | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付赎回款 | | |
| 应付利息 | | |
| 应付利润 | | |
| 其他负债 | 46,090.54 | 216,521.68 |
| 负债合计 | 470,180.92 | 520,573.98 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 80,892,681.26 | 61,890,465.79 |
| 其他综合收益 | | |
| 未分配利润 | 76,198,056.02 | 54,828,851.72 |
| 净资产合计 | 157,090,737.28 | 116,719,317.51 |
| 负债与净资产总计 | 157,560,918.20 | 117,239,891.49 |

注：

1、截止本报告期末，本计划份额净值(暂估业绩报酬前)1.9420元，基金份额总额80,892,681.26份。

2、本计划资产净值(暂估业绩报酬前)157,090,737.28元，暂估业绩报酬0.00元，基金资产净值(暂估业绩报酬后)157,090,737.28元；暂估业绩报酬为假设本计划于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据基金委托人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各基金委托人的暂估业绩报酬的合计，各基金委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

(二) 利润表

本报告期：2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 2023 年度 | 2022 年度 |
|---------|------------|-------------------|
| 一、营业总收入 | 721,394.07 | - 7,973,107.71 |
| 利息收入 | 167,997.76 | 183,823.74 |

| | | |
|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| 投资收益（损失以“-”填列） | 9,861,824.28 | - 4,611,972.79 |
| 其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | |
| 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | -9,308,427.97 | - 3,544,958.66 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | |
| 其他收入（损失以“-”号填列） | | |
| 二、营业总支出 | 1,626,367.69 | 1,224,444.90 |
| 管理人报酬 | 1,527,253.33 | 1,162,553.84 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | |
| 托管费 | 45,817.57 | 34,876.62 |
| 销售服务费 | | |
| 投资顾问费 | | |
| 利息支出 | | |
| 信用减值损失 | | |
| 税金及附加 | 35,463.05 | 3,167.75 |
| 其他费用 | 17,833.74 | 23,846.69 |
| 三、利润总额 | -904,973.62 | - 9,197,552.61 |
| 减：所得税费用 | | |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -904,973.62 | - 9,197,552.61 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | |
| 六、综合收益总额 | -904,973.62 | - 9,197,552.61 |

(三) 净资产变动表

本报告期：2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 2023 年度 | | | | 2022 年度 | | | |
|----------------------|---------------|--------|---------------|----------------|---------------|--------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末余额 | 61,890,465.79 | | 54,828,851.72 | 116,719,317.51 | 60,208,634.58 | | 59,662,168.82 | 119,870,803.40 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本期期初余额 | 61,890,465.79 | | 54,828,851.72 | 116,719,317.51 | 60,208,634.58 | | 59,662,168.82 | 119,870,803.40 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 19,002,215.47 | | 21,369,204.30 | 40,371,419.77 | 1,681,831.21 | | -4,833,317.10 | -3,151,485.89 |
| （一）综合收 | | | -904,973.62 | -904,973.62 | | | -9,197,552.61 | -9,197,552.61 |

| | | | | | | | | |
|------------------|----------------|--|----------------|----------------|----------------|--|----------------|----------------|
| 益总额 | | | | | | | | |
| (二) 产品持有人申购和赎回 | 19,002,215.47 | | 22,274,177.92 | 41,276,393.39 | 1,681,831.21 | | 4,364,235.51 | 6,046,066.72 |
| 其中：产品申购 | 48,002,488.39 | | 51,300,083.77 | 99,302,572.16 | 20,286,460.31 | | 19,936,806.95 | 40,223,267.26 |
| 产品赎回 | -29,000,272.92 | | -29,025,905.85 | -58,026,178.77 | -18,604,629.10 | | -15,572,571.44 | -34,177,200.54 |
| (三) 利润分配 | | | | 0.00 | | | | 0.00 |
| (四) 其他综合收益结转留存收益 | | | | | | | | |
| 四、本期期末余额 | 80,892,681.26 | | 76,198,056.02 | 157,090,737.28 | 61,890,465.79 | | 54,828,851.72 | 116,719,317.51 |

五、投资组合报告

(一) 期末资产管理计划资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占资产管理计划总资产的比例（%） |
|----|----|-------|------------------|
|----|----|-------|------------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 121,078,282.30 | 76.85 |
| | 其中：股票 | 121,078,282.30 | 76.85 |
| 2 | 基金投资 | 2,976,000.00 | 1.89 |
| 3 | 固定收益投资 | 26,241,040.79 | 16.65 |
| | 其中：债券 | 26,241,040.79 | 16.65 |
| | 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 | 2,999,656.98 | 1.90 |
| | 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 | 3,173,211.82 | 2.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,092,726.31 | 0.69 |
| 9 | 合计 | 157,560,918.20 | 100.00 |

(二) 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 19,143.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,073,582.91 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,092,726.31 |

(三) 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） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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) | 26,241,040.79 | 16.70 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 26,241,040.79 | 16.70 |

(四) 期末按公允价值占资产管理计划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) | 占资产管理计划资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------|---------------|-------------------|
| 1 | 605108 | 同庆楼 | 610000 | 18,568,400.00 | 11.82 |
| 2 | 300219 | 鸿利智汇 | 1900000 | 15,998,000.00 | 10.18 |
| 3 | 300451 | 创业慧康 | 2200000 | 14,410,000.00 | 9.17 |
| 4 | 300296 | 利亚德 | 2300000 | 13,800,000.00 | 8.78 |
| 5 | 002739 | 万达电影 | 980000 | 12,759,600.00 | 8.12 |
| 6 | 002926 | 华西证券 | 1250000 | 9,700,000.00 | 6.17 |
| 7 | 300088 | 长信科技 | 1300000 | 8,697,000.00 | 5.54 |
| 8 | 605305 | 中际联合 | 250000 | 8,077,500.00 | 5.14 |
| 9 | 603713 | 密尔克卫 | 143068 | 7,612,648.28 | 4.85 |
| 10 | 002912 | 中新赛克 | 260000 | 7,277,400.00 | 4.63 |

(五) 期末按公允价值占资产管理计划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 | 123035 | 利德转债 | 90000 | 10,558,234.11 | 6.72 |
| 2 | 127015 | 希望转债 | 90350 | 9,767,415.47 | 6.22 |
| 3 | 128042 | 凯中转债 | 45710 | 5,915,391.21 | 3.76 |

(六) 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名公募基金投资明细

| 序号 | 名称 | 基金代码 | 类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|------------------------|--------|-------|--------|--------------|--------------|------------------|
| 1 | 华泰柏瑞南方东英恒生科技ETF(QD II) | 513130 | ETF基金 | 契约型开放式 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 2,976,000.00 | 1.89 |

(七) 资产管理计划运用杠杆情况

产品杠杆：本产品为非结构化产品，无产品杠杆。

投资杠杆：截至报告期末，本产品投资杠杆约为 100.30%。

(八) 两费及业绩报酬说明

| 项目 | 计提方式 |
|------|-------------------|
| 管理费 | 1.00%/年，每日计提，按季支付 |
| 托管费 | 0.03%/年，每日计提，按季支付 |
| 业绩报酬 | 本集合计划不收取业绩报酬。 |

(九) 集合计划份额变动情况

单位：份

| | |
|-------------------|---------------|
| 本报告期期初资产管理计划份额总额 | 61,890,465.79 |
| 本报告期资产管理计划总参与份额 | 48,002,488.39 |
| 减：本报告期资产管理计划总退出份额 | 29,000,272.92 |
| 本报告期资产管理计划拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末资产管理计划份额总额 | 80,892,681.26 |

(十) 关联方持有本集合计划份额变动情况

| | |
|-----------------|--------------|
| 期初份额 | 4,267,739.45 |
| 报告期间参与份额 | 2,119,404.57 |
| 红利再投资份额 | - |
| 报告期间退出份额 | 485,104.92 |
| 报告期末份额 | 5,902,039.10 |
| 期末份额占集合计划总份额的比例 | 7.30% |

六、其他重大事项

本报告期内，本集合资产管理计划没有其他需要披露的重大事项。

七、查阅方式

投资者可或登录集合计划管理人网站 www.axzqzg.com 查阅，还可拨打本公司客服电话 95517 查询相关信息。

安信证券资产管理有限公司

2024年04月30日