

安信企业价值优选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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	11
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	13
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43

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	43
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	44
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
§ 8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9	开放式基金份额变动	46
§ 10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	49
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信企业价值优选混合型证券投资基金	
基金简称	安信企业价值优选混合	
基金主代码	004393	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 8 月 8 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	95,745,122.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信企业价值优选混合 A	安信企业价值优选混合 C
下属分级基金的交易代码	004393	020964
报告期末下属分级基金的份额总额	84,684,937.39 份	11,060,184.66 份

2.2 基金产品说明

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	资产配置上，本基金以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，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。股票投资上，本基金的股票投资策略包括公司基本面分析、股票估值分析、港股通标的股票投资策略及存托凭证投资策略。债券投资上，在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上，分析基础利率的走势，研究利率期限结构和中长期收益率走势。此外，本基金还将适当参与衍生品和资产支持证券的投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率调整后）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%
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。 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。本基金可投资于港股通标的股票，从而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。

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	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	许俊
	联系电话	0755-82509999	010-66596688
	电子邮箱	service@essencefund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	4008-088-088	95566	
传真	0755-82799292	010-66594942	
注册地址	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
邮政编码	518026	100818	
法定代表人	刘入领	葛海蛟	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

§ 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(2024 年 1 月 1 日 -2024 年 6 月 30 日)	2024 年 3 月 7 日(基金合同生效日) -2024 年 6 月 30 日
	安信企业价值优选混合 A	安信企业价值优选混合 C
本期已实现收益	1,060,030.84	177,680.66
本期利润	11,095,351.73	-141,396.28
加权平均基金份额本期利润	0.2090	-0.0539
本期加权平均净值利润率	10.07%	-2.48%
本期基金份额净值增长率	9.41%	3.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	93,745,185.99	12,202,020.74
期末可供分配基金份额利润	1.1070	1.1032
期末基金资产净值	178,430,123.38	23,262,205.40
期末基金份额净值	2.1070	2.1032
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.78%	3.05%

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、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。

4、根据基金管理人 2024 年 3 月 7 日《关于安信企业价值优选混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2024 年 3 月 7 日起，本基金增加 C 类份额。

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

安信企业价值优选混合 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	-3.79%	0.64%	-2.17%	0.39%	-1.62%	0.25%
过去三个月	2.51%	0.69%	0.53%	0.61%	1.98%	0.08%
过去六个月	9.41%	0.77%	2.16%	0.73%	7.25%	0.04%
过去一年	2.29%	0.77%	-6.51%	0.73%	8.80%	0.04%
自基金转型起至今	10.78%	0.91%	-10.23%	0.80%	21.01%	0.11%

安信企业价值优选混合 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	-3.82%	0.64%	-2.17%	0.39%	-1.65%	0.25%
过去三个月	2.35%	0.68%	0.53%	0.61%	1.82%	0.07%

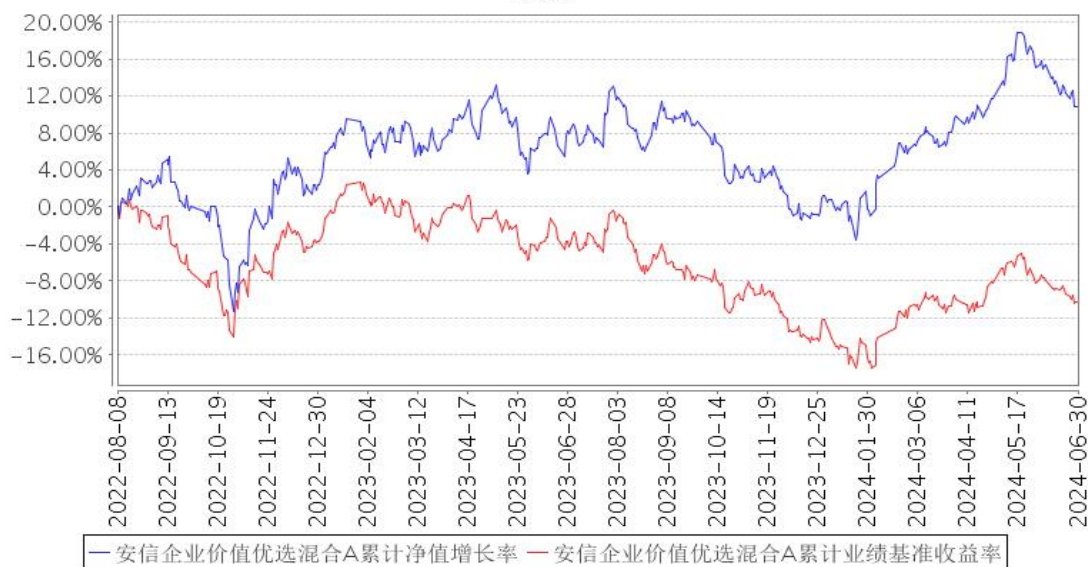
自基金合同生效起 至今	3.05%	0.64%	1.00%	0.60%	2.05%	0.04%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

注：根据《安信企业价值优选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：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率调整后）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20% 沪深 300 指数由专业指数提供商中证指数有限公司编制和发布，由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，以综合反映沪深 A 股市场整体表现，具有良好的市场代表性和市场影响力。恒生指数是由恒生指数有限公司编制，以香港股票市场中的若干只上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合（全价）指数的样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。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。

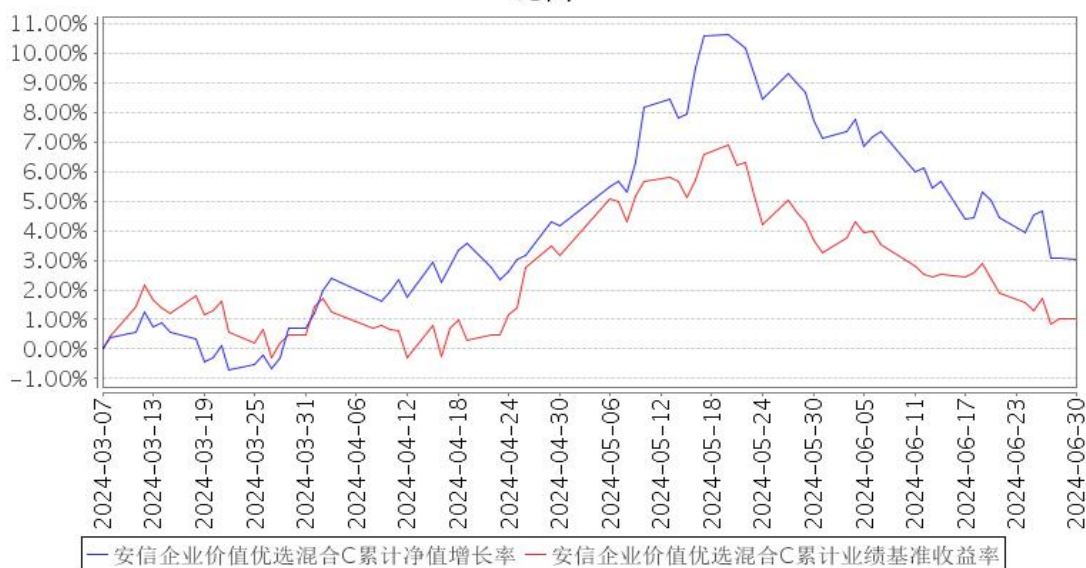
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 60%、20%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

安信企业价值优选混合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



安信企业价值优选混合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 2022 年 8 月 8 日由安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金转型而成, 本基金合同生效日为 2022 年 8 月 8 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。

3、根据基金管理人 2024 年 3 月 7 日《关于安信企业价值优选混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》, 自 2024 年 3 月 7 日起, 本基金增加 C 类份额。

§ 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, 国投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 2024 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 92 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、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金。

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		
张明	本基金的基金经理，价值投资部副总经理	2022 年 8 月 8 日	-	13 年	张明先生，管理学硕士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组任研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、价值投资部总经理助理。现任安信基金管理有限责任公司价值投资部副总经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；安信中国制造 2025 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）、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信平稳双利 3 个月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、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金的基金经理。

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

本产品一直坚持自下而上的投资选股思路，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，在“好价格”下买入并持有“好公司”，长期获得企业内在价值增长的收益。

上半年经济数据总体前高后低，近期 PMI、发电量和社零数据显示国内经济增长动能边际有所减弱。整个上半年国内地产销售继续下行但边际有降幅改善，核心城市二手房以价换量贡献明显，这主要得益于 5 月中旬以后核心城市限购限贷政策的放松。展望下半年，由于基数效应，地产销售可能继续改善。货币政策方面，社融和 M2 数据也是前高后低，总体依然保持高个位数增长。

十年期国债收益率上半年总体下行至 2.2% 左右，我们判断今年货币政策仍将维持相对合理充裕。人民币汇率上半年以来小幅贬值。

2024 年上半年市场震荡分化，中证红利、沪深 300 指数表现相对较好，创业板指、中证 500 指数表现较弱，微盘股指数跌幅明显。分行业来看，上半年银行、煤炭、公用事业、家电、石油石化等行业表现较好，计算机、商贸零售、社服、传媒、医药等行业表现较差。今年上半年安信企业价值有所上涨，相对跑赢沪深 300 指数。

今年上半年我们仓位小幅减少，但整体仍在相对高位。相比年初主要增加了银行、交运、建材等行业的配置，减少了地产、食品饮料、家电等行业的配置。目前相对看好的公司集中在银行、纺织服饰、煤炭、建筑建材、交运等细分行业的优秀公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信企业价值优选混合 A 基金份额净值为 2.1070 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.41%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；安信企业价值优选混合 C 基金份额净值为 2.1032 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.05%，同期业绩比较基准收益率为 1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来市场指数震荡分化，我们继续维持年初的判断，认为当下依然很可能是未来 3-5 年股票投资很好的时点。无论是沪深 300 指数还是中证红利指数的估值依然处于历史相对低位。上半年市场大幅波动过程中，我们积极坚持自下而上找寻优质股票错误定价的机会。自下而上来看，我们发现无论 A 股还是港股，多个行业均有十分优秀的公司，其竞争优势依然显著，市场份额有机会持续提升，这一部分企业的投资价值值得我们把握，例如银行、纺织服饰、煤炭、建筑建材、交运、家电等行业的优秀公司。

近期由于地产政策的调整，特别是核心一线城市的限购限贷政策放松，我们提高了对地产为代表的顺周期板块的关注度，但后续全国范围的地产销售企稳仍然具有不确定性，我们总体策略还是密切保持跟踪，不做过早预判。

再次，上半年小市值股票下跌明显并且中间伴随大幅波动，我们从自下而上研究企业价值的角度，对部分小盘价值股票也有关注。关键是从业绩增长确定性的角度，找到一些未来经营业绩能持续增长的公司，如果在估值性价比明显占优的情况下，我们会提高关注力度。

另外，上半年港股市场有所反弹，目前 AH 溢价指数相比之前 160 的水平有所回落，但仍有 140 多，整体港股估值依然比较便宜。我们继续看好港股估值较低而预计今明两年业绩还能保持平稳的公司，主要集中在金融、煤炭、石油、交运等行业。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信企业价值优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行

了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：安信企业价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	60,506,310.53	3,949,324.68
结算备付金		3,589,894.50	3,598.69
存出保证金		47,143.90	3,178.20
交易性金融资产	6.4.7.2	163,833,859.97	49,523,989.48
其中：股票投资		163,833,859.97	49,523,989.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		1,207,496.56	-
应收申购款		15,033,887.18	8,219.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		244,218,592.64	53,488,310.27
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		42,226,246.09	30,785.20
应付赎回款		27,537.52	12,307.00
应付管理人报酬		135,225.23	53,507.85
应付托管费		22,537.58	8,917.98
应付销售服务费		3,535.43	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	111,182.01	104,927.47
负债合计		42,526,263.86	210,445.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	95,745,122.05	27,666,410.41
未分配利润	6.4.7.8	105,947,206.73	25,611,454.36
净资产合计		201,692,328.78	53,277,864.77
负债和净资产总计		244,218,592.64	53,488,310.27

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 95,745,122.05 份，其中安信企业价值优选混合 A 基金份额总额 84,684,937.39 份，基金份额净值 2.1070 元；安信企业价值优选混合 C 基金份额总额 11,060,184.66 份，基金份额净值 2.1032 元。

6.2 利润表

会计主体：安信企业价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		11,811,073.41	3,336,534.58
1. 利息收入		28,037.16	10,890.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,037.16	8,917.90
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资		-	1,972.88

产收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,030,148.39	1,974,076.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-767,210.32	738,126.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	55,000.16
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,797,358.71	1,180,950.38
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	9,716,243.95	1,334,340.39
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	36,643.91	17,226.75
减：二、营业总支出		857,117.96	487,577.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	682,840.15	373,659.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	113,806.70	62,276.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,018.54	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	0.86
8. 其他费用	6.4.7.19	53,452.57	51,640.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,953,955.45	2,848,957.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,953,955.45	2,848,957.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,953,955.45	2,848,957.32

6.3 净资产变动表

会计主体：安信企业价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	27,666,410.41	-	25,611,454.36	53,277,864.77
二、本期期初净资产	27,666,410.41	-	25,611,454.36	53,277,864.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	68,078,711.64	-	80,335,752.37	148,414,464.01
(一)、综合收益总额	-	-	10,953,955.45	10,953,955.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	68,078,711.64	-	69,381,796.92	137,460,508.56
其中：1. 基金申购款	80,999,650.16	-	83,444,917.47	164,444,567.63
2. 基金赎回款	-12,920,938.52	-	-14,063,120.55	-26,984,059.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	95,745,122.05	-	105,947,206.73	201,692,328.78
项目	上年度可比期间 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	25,415,578.82	-	24,077,948.13	49,493,526.95
二、本期期初净资产	25,415,578.82	-	24,077,948.13	49,493,526.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,804,267.08	-	4,772,105.75	6,576,372.83
(一)、综合收益总额	-	-	2,848,957.32	2,848,957.32

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	1,804,267.08	-	1,923,148.43	3,727,415.51
其中：1. 基金申购款	6,484,907.12	-	6,933,711.57	13,418,618.69
2. 基金赎回款	-4,680,640.04	-	-5,010,563.14	-9,691,203.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,219,845.90	-	28,850,053.88	56,069,899.78

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

安信企业价值优选混合型证券投资基金由安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“安信合作创新混合”）于 2022 年 8 月 8 日转型而来。基金转型事项获中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 23 日下发的证监许可[2022]609 号文“关于准予安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复”的核准，并经安信合作创新混合基金份额持有人大会决议通过。自 2022 年 8 月 8 日起，由《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信企业价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效，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基金合同》同日失效，原安信合作创新混合更名为安信企业价值优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），为契约型开放式基金，存续期限不定。

原安信合作创新混合于基金合同失效前的基金资产净值为 52,874,121.96 元，基金份额为 27,803,840.65 份，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值、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，

基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2024 年 3 月 7 日发布的《关于安信企业价值优选混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新的《安信企业价值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金自 2024 年 3 月 7 日起增加 C 类份额，原份额转为 A 类基金份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信企业价值优选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的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、次级债、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、可交换债券、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款和其他银行存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权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。本基金可根据相关规定参与融资业务。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 60% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%）。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（经汇率调整后）*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

证券(股票)交易印花税税率为 1%,由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）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。

（4）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。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	60,506,310.53
等于：本金	60,503,325.51
加：应计利息	2,985.02
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	60,506,310.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	156,072,069.66	-	163,833,859.97	7,761,790.31
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	156,072,069.66	-	163,833,859.97	7,761,790.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本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

本基金于本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

本基金于本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

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	61,453.82
其中：交易所市场	61,453.82
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	39,781.56
应付审计费	9,944.48

合计	111,182.01
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信企业价值优选混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,666,410.41	27,666,410.41
本期申购	67,018,757.40	67,018,757.40
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,230.42	-10,000,230.42
本期末	84,684,937.39	84,684,937.39

安信企业价值优选混合 C

项目	本期 2024 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	13,980,892.76	13,980,892.76
本期赎回（以“-”号填列）	-2,920,708.10	-2,920,708.10
本期末	11,060,184.66	11,060,184.66

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。本基金于 2024 年 3 月 7 日增设 C 类基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信企业价值优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,149,512.78	-12,538,058.42	25,611,454.36
本期期初	38,149,512.78	-12,538,058.42	25,611,454.36
本期利润	1,060,030.84	10,035,320.89	11,095,351.73
本期基金份额交易产生的变动数	78,693,693.95	-21,655,314.05	57,038,379.90
其中：基金申购款	92,332,754.27	-24,638,794.36	67,693,959.91
基金赎回款	-13,639,060.32	2,983,480.31	-10,655,580.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,903,237.57	-24,158,051.58	93,745,185.99

安信企业价值优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	177,680.66	-319,076.94	-141,396.28
本期基金份额交易产生的变动数	15,197,727.25	-2,854,310.23	12,343,417.02

其中：基金申购款	19,183,066.53	-3,432,108.97	15,750,957.56
基金赎回款	-3,985,339.28	577,798.74	-3,407,540.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,375,407.91	-3,173,387.17	12,202,020.74

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	24,156.85	
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	3,753.05	
其他	127.26	
合计	28,037.16	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	23,267,019.02	
减：卖出股票成本总额	23,835,841.57	
减：交易费用	198,387.77	
买卖股票差价收入	-767,210.32	

6.4.7.11 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资产生的股利收益	2,797,358.71	
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	2,797,358.71
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	9,716,243.95
股票投资	9,716,243.95
债券投资	-
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	9,716,243.95

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	29,467.72
基金转换费收入	7,176.19
合计	36,643.91

6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,232.80
证券组合费	1,493.73
合计	53,452.57

6.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分

部报告。

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

本基金的基金管理人于 2024 年 7 月 31 日宣告 2024 年度第一次分红，向截至 2024 年 8 月 1 日止在本基金注册登记人安信基金管理有限责任公司登记在册的本基金份额持有人派发红利。A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 1.04 元，C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 1.04 元。

截至本财务报表批准报出日，除上述事项外，本基金无其他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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
国投证券	44,075,103.11	29.05	24,275,400.92	83.49

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均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 2024年1月1日至2024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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国投证券	33,512.31	29.05	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国投证券	17,509.92	82.01	9,052.59	79.65

注：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协商约定，并扣除由交易所或登记结算公司收取的相关费用后的净额列示。

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	682,840.15	373,659.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	85,190.49	84,168.59
应支付基金管理人的净管理费	597,649.66	289,490.48

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的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	113,806.70	62,276.51

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 0.20% 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管理费

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信企业价值优选混合 A	安信企业价值优选混合 C	合计
安信基金	-	4,136.86	4,136.86
合计	-	4,136.86	4,136.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	安信企业价值优选混合 A	安信企业价值优选混合 C	合计
合计	-	-	-

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年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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自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自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

安信企业价值优选混合 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	-	-	4,949,509.95	17.89

份额单位：份

安信企业价值优选混合 C

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	7,137,013.06	7.45	-	-

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国银行	60,506,310.53	24,156.85	7,106,709.24	8,446.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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 2024 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无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，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2023 年 12 月 31 日：无）。

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。货币资金、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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,506,310.53	-	-	-	60,506,310.53
结算备付金	3,589,894.50	-	-	-	3,589,894.50
存出保证金	47,143.90	-	-	-	47,143.90
交易性金融资产	-	-	-	163,833,859.97	163,833,859.97
应收股利	-	-	-	1,207,496.56	1,207,496.56
应收申购款	-	-	-	15,033,887.18	15,033,887.18
资产总计	64,143,348.93	-	-	180,075,243.71	244,218,592.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,537.52	27,537.52
应付管理人报酬	-	-	-	135,225.23	135,225.23
应付托管费	-	-	-	22,537.58	22,537.58
应付清算款	-	-	-	42,226,246.09	42,226,246.09
应付销售服务费	-	-	-	3,535.43	3,535.43
其他负债	-	-	-	111,182.01	111,182.01
负债总计	-	-	-	42,526,263.86	42,526,263.86
利率敏感度缺口	64,143,348.93	-	-	137,548,979.85	201,692,328.78
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,949,324.68	-	-	-	3,949,324.68
结算备付金	3,598.69	-	-	-	3,598.69
存出保证金	3,178.20	-	-	-	3,178.20
交易性金融资产	-	-	-	49,523,989.48	49,523,989.48
应收申购款	-	-	-	8,219.22	8,219.22
资产总计	3,956,101.57	-	-	49,532,208.70	53,488,310.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,307.00	12,307.00
应付管理人报酬	-	-	-	53,507.85	53,507.85
应付托管费	-	-	-	8,917.98	8,917.98
应付清算款	-	-	-	30,785.20	30,785.20
其他负债	-	-	-	104,927.47	104,927.47
负债总计	-	-	-	210,445.50	210,445.50
利率敏感度缺口	3,956,101.57	-	-	49,321,763.20	53,277,864.77

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

本基金于 2024 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对报告期末基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	71,972,293.76	-	71,972,293.76
应收股利	-	1,207,496.56	-	1,207,496.56
资产合计	-	73,179,790.32	-	73,179,790.32
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	73,179,790.32	-	73,179,790.32
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	14,820,011.06	-	14,820,011.06
资产合计	-	14,820,011.06	-	14,820,011.06

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	14,820,011.06	-	14,820,011.06

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,658,989.52	741,000.55
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,658,989.52	-741,000.55

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60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权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 2024年6月30日		上年度末 2023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	163,833,859.97	81.23	49,523,989.48	92.95

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	163,833,859.97	81.23	49,523,989.48	92.95

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		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	6,628,605.40	2,066,900.50
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-6,628,605.40	-2,066,900.50

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	163,833,859.97	49,523,989.48
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	163,833,859.97	49,523,989.48

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

本基金于本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	163,833,859.97	67.08
	其中：股票	163,833,859.97	67.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	64,096,205.03	26.25
8	其他各项资产	16,288,527.64	6.67
9	合计	244,218,592.64	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 71,972,293.76 元，占净值比例 35.68%。

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	1,220,800.00	0.61
B	采矿业	2,910,740.00	1.44
C	制造业	46,899,329.99	23.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,279,200.00	5.59
F	批发和零售业	7,948,916.22	3.94
G	交通运输、仓储和邮政业	3,960,000.00	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	153,280.00	0.08
J	金融业	11,533,100.00	5.72
K	房地产业	2,365,200.00	1.17
L	租赁和商务服务业	613,000.00	0.30
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	252,000.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	2,726,000.00	1.35
S	综合	-	-
	合计	91,861,566.21	45.55

7.2.2 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	21,978,792.87	10.90
原材料	11,041,785.17	5.47
工业	7,576,156.68	3.76
非日常生活消费品	2,729,490.93	1.35
日常消费品	263,581.98	0.13
医疗保健	1,712,278.95	0.85
金融	20,171,414.48	10.00
信息技术	-	-
通讯业务	2,977,673.26	1.48
公用事业	-	-
房地产	3,521,119.44	1.75
合计	71,972,293.76	35.68

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

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	00939	建设银行	2,170,000	11,427,575.01	5.67
1	601939	建设银行	380,000	2,812,000.00	1.39
2	01088	中国神华	363,000	11,910,337.10	5.91
3	00914	海螺水泥	575,000	9,761,112.60	4.84
3	600585	海螺水泥	70,000	1,651,300.00	0.82
4	01398	工商银行	1,820,000	7,707,400.06	3.82
4	601398	工商银行	540,000	3,078,000.00	1.53
5	601668	中国建筑	2,000,000	10,620,000.00	5.27
6	00883	中国海洋石油	370,000	7,564,291.84	3.75
7	002867	周大生	515,087	6,727,036.22	3.34
8	600612	老凤祥	110,000	6,400,900.00	3.17
9	600519	贵州茅台	4,153	6,094,070.67	3.02
10	002508	老板电器	245,089	5,416,466.90	2.69
11	600233	圆通速递	220,000	3,443,000.00	1.71
12	601288	农业银行	500,000	2,180,000.00	1.08
12	01288	农业银行	340,000	1,036,439.41	0.51
13	300750	宁德时代	17,500	3,150,525.00	1.56
14	00688	中国海外发展	240,000	2,965,844.93	1.47
15	600309	万华化学	36,000	2,910,960.00	1.44
16	600176	中国巨石	250,000	2,762,500.00	1.37
17	00576	浙江沪杭甬	570,000	2,741,599.45	1.36
18	02057	中通快递-W	18,000	2,697,517.01	1.34
19	000333	美的集团	40,000	2,580,000.00	1.28
20	600048	保利发展	270,000	2,365,200.00	1.17
21	00700	腾讯控股	6,900	2,345,186.02	1.16
22	000858	五粮液	18,000	2,304,720.00	1.14
23	600036	招商银行	60,000	2,051,400.00	1.02
24	002078	太阳纸业	143,000	1,994,850.00	0.99
25	600398	海澜之家	195,000	1,801,800.00	0.89
26	01513	丽珠医药	73,000	1,712,278.95	0.85
27	601225	陕西煤业	63,000	1,623,510.00	0.80
28	000792	盐湖股份	90,000	1,570,500.00	0.78
29	600373	中文传媒	100,000	1,484,000.00	0.74
30	00386	中国石油化工股份	310,000	1,431,629.85	0.71
31	600919	江苏银行	190,000	1,411,700.00	0.70
32	601699	潞安环能	71,000	1,287,230.00	0.64
33	600690	海尔智家	45,000	1,277,100.00	0.63
34	601098	中南传媒	100,000	1,242,000.00	0.62
35	002714	牧原股份	28,000	1,220,800.00	0.61

36	01171	兖矿能源	105,300	1,072,534.08	0.53
37	600729	重庆百货	43,000	961,480.00	0.48
38	603886	元祖股份	54,957	827,652.42	0.41
39	00390	中国中铁	210,000	826,066.67	0.41
40	01999	敏华控股	150,000	733,794.72	0.36
41	03690	美团-W	7,030	712,833.20	0.35
42	02314	理文造纸	330,000	695,735.96	0.34
43	00995	安徽皖通高速公路	80,000	682,684.64	0.34
44	02333	长城汽车	60,000	659,320.03	0.33
45	601117	中国化学	80,000	659,200.00	0.33
46	00941	中国移动	9,000	632,487.24	0.31
47	01448	福寿园	140,000	623,542.98	0.31
48	002818	富森美	50,000	613,000.00	0.30
49	000726	鲁泰 A	90,000	595,800.00	0.30
50	06655	华新水泥	85,000	584,936.61	0.29
51	000932	华菱钢铁	132,000	584,760.00	0.29
52	00107	四川成渝高速公路	180,000	561,845.81	0.28
53	02669	中海物业	130,000	555,274.51	0.28
54	601000	唐山港	110,000	517,000.00	0.26
55	603218	日月股份	45,000	462,150.00	0.23
56	603365	水星家纺	28,000	438,200.00	0.22
57	605338	巴比食品	33,000	437,250.00	0.22
58	002327	富安娜	42,100	423,105.00	0.21
59	603896	寿仙谷	18,000	422,460.00	0.21
60	002007	华兰生物	26,000	410,540.00	0.20
61	600486	扬农化工	7,000	395,150.00	0.20
62	600276	恒瑞医药	10,000	384,600.00	0.19
63	605336	帅丰电器	34,000	383,180.00	0.19
64	603180	金牌家居	18,000	343,980.00	0.17
65	002597	金禾实业	17,000	338,130.00	0.17
66	301349	信德新材	10,000	276,400.00	0.14
67	06186	中国飞鹤	80,000	263,581.98	0.13
68	301177	迪阿股份	14,000	260,400.00	0.13
69	603279	景津装备	12,000	260,280.00	0.13
70	300244	迪安诊断	21,000	252,000.00	0.12
71	002410	广联达	16,000	153,280.00	0.08
72	00586	海螺创业	10,000	66,443.10	0.03

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	00939	建设银行	9,745,277.34	18.29
2	00914	海螺水泥	7,741,740.86	14.53
3	601668	中国建筑	7,630,158.00	14.32
4	01398	工商银行	7,051,068.55	13.23
5	01088	中国神华	6,160,330.34	11.56
6	002867	周大生	4,943,802.71	9.28
7	002508	老板电器	4,323,263.00	8.11
8	600612	老凤祥	4,234,784.00	7.95
9	600519	贵州茅台	3,939,763.00	7.39
10	00883	中国海洋石油	3,825,625.84	7.18
11	02057	中通快递-W	2,779,082.16	5.22
12	00576	浙江沪杭甬	2,750,996.33	5.16
13	600309	万华化学	2,745,229.00	5.15
14	600176	中国巨石	2,534,323.00	4.76
15	600233	圆通速递	2,525,297.00	4.74
16	601398	工商银行	2,058,795.00	3.86
17	000858	五粮液	1,762,067.00	3.31
18	600398	海澜之家	1,638,671.00	3.08
19	601699	潞安环能	1,569,694.00	2.95
20	300750	宁德时代	1,533,883.00	2.88
21	600373	中文传媒	1,467,421.00	2.75
22	601288	农业银行	1,446,122.00	2.71
23	600919	江苏银行	1,427,544.00	2.68
24	00386	中国石油化工股份	1,350,074.53	2.53
25	000792	盐湖股份	1,290,798.00	2.42
26	000333	美的集团	1,289,618.00	2.42
27	600048	保利发展	1,283,537.00	2.41
28	600729	重庆百货	1,225,067.00	2.30
29	01513	丽珠医药	1,172,589.83	2.20
30	601939	建设银行	1,099,104.00	2.06
31	01171	兖矿能源	1,094,594.58	2.05

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	601939	建设银行	1,402,316.00	2.63
2	600048	保利发展	1,310,870.00	2.46

3	601390	中国中铁	1,243,859.00	2.33
4	600585	海螺水泥	892,400.00	1.67
5	00688	中国海外发展	747,398.60	1.40
6	601012	隆基绿能	717,124.00	1.35
7	601318	中国平安	652,089.00	1.22
8	600741	华域汽车	633,260.00	1.19
9	03690	美团-W	623,072.44	1.17
10	002727	一心堂	577,395.00	1.08
11	002415	海康威视	555,038.00	1.04
12	601000	唐山港	547,757.00	1.03
13	601311	骆驼股份	527,880.00	0.99
14	01171	兖矿能源	490,123.20	0.92
15	002508	老板电器	447,440.00	0.84
16	300003	乐普医疗	428,945.00	0.81
17	02669	中海物业	425,969.43	0.80
18	600438	通威股份	409,753.00	0.77
19	601928	凤凰传媒	406,099.00	0.76
20	601398	工商银行	377,051.00	0.71

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	128,429,468.11
卖出股票收入（成交）总额	23,267,019.02

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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建设银行（代码：00939 HG）、中国建筑（代码：601668 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. 中国建设银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，中国建设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、没收违法所得。

2024 年 1 月 5 日，中国建设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。

2024 年 6 月 10 日，中国建设银行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四税务所责令改正。

2. 中国建筑股份有限公司

2023 年 6 月-2023 年 12 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责、未按期申报税款、违

反交通法规被国家税务总局佛山市南海区税务局责令改正，被福州市晋安区城管局罚款、责令改正，被中国交通运输局衡水市分局责令改正、罚款。

2024 年 1 月-5 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责、未按期申报税款被福州市晋安区城管局责令改正、罚款，被国家税务总局上海市长宁区税务局第十三税务所责令改正和采取行政监管措施，被成都铁路监督管理局罚款、责令改正。

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	47,143.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,207,496.56
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,033,887.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,288,527.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
安信企业 价值优选 混合 A	1,089	77,763.95	67,722,090.64	79.97	16,962,846.75	20.03
安信企业 价值优选 混合 C	79	140,002.34	10,699,370.86	96.74	360,813.80	3.26
合计	1,157	82,752.91	78,421,461.50	81.91	17,323,660.55	18.09

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	安信企业价值优选混合 A	957,572.92	1.13
	安信企业价值优选混合 C	-	-
	合计	957,572.92	1.00

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	安信企业价值优选混合 A	50~100
	安信企业价值优选混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	安信企业价值优选混合 A	10~50
	安信企业价值优选混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信企业价值优选混合 A	安信企业价值优选混合 C
基金合同生效日（2022 年 8 月 8 日）基金份额总额	27,803,840.65	-

本报告期期初基金份额总额	27,666,410.41	-
本报告期基金总申购份额	67,018,757.40	13,980,892.76
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,230.42	2,920,708.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	84,684,937.39	11,060,184.66

§ 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

本报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、基金托管人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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员

受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已完成整改
其他	无

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
长江证券	2	107,621,384.02	70.95	81,832.63	70.95	-
国投证券	2	44,075,103.11	29.05	33,512.31	29.05	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金管理人制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序规定。基金管理人综合考虑券商的研究能力后，确定证券公司的选择，并与被选择的证券公司签订协议。

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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

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提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日
2	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 19 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
6	关于安信企业价值优选混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	证券时报	2024 年 3 月 7 日
7	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港耶稣受难节、复活节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
8	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年年度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 28 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 19 日
11	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
12	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 26 日
13	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港佛诞日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 5 月 13 日
14	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港特别行政区成立纪念日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 6 月 27 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240126-20240627	-	17,154,727.39	1,436,093.82	15,718,633.57	16.42

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信企业价值优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信企业价值优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信企业价值优选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

本基金管理人和基金托管人的住所。

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

2024 年 8 月 29 日