

安信价值回报三年持有期混合型证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 安信价值回报三年持有混合   |
| 基金主代码      | 008954   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 2 月 26 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,740,795,028.91 份   |
| 投资目标       | 本基金在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，力争为基金份额持有人实现长期稳定的回报。  |
| 投资策略       | 资产配置策略方面，本基金的资产配置策略以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资策略方面，本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方法，选择内在价值被低估的股票构建投资组合。债券投资策略方面，通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，在确保资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。资产支持证券投资策略方面，本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产 |

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
|                 | 支持证券产品的投资。  |                |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率*65%+中债综合指数收益率*30%+恒生指数收益率*5%   |                |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金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。 |                |
| 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     | 安信价值回报三年持有混合 A  | 安信价值回报三年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 008954  | 010667         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,740,694,249.26 份  | 100,779.65 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） |                |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
|                 | 安信价值回报三年持有混合 A                      | 安信价值回报三年持有混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | 165,419,357.82                      | 4,240.57       |
| 2. 本期利润         | -398,928,083.30                     | -9,284.10      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1457                             | -0.1503        |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,480,239,733.57                    | 127,507.38     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2698                              | 1.2652         |

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

安信价值回报三年持有混合 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|    |        |           |            |               |     |     |

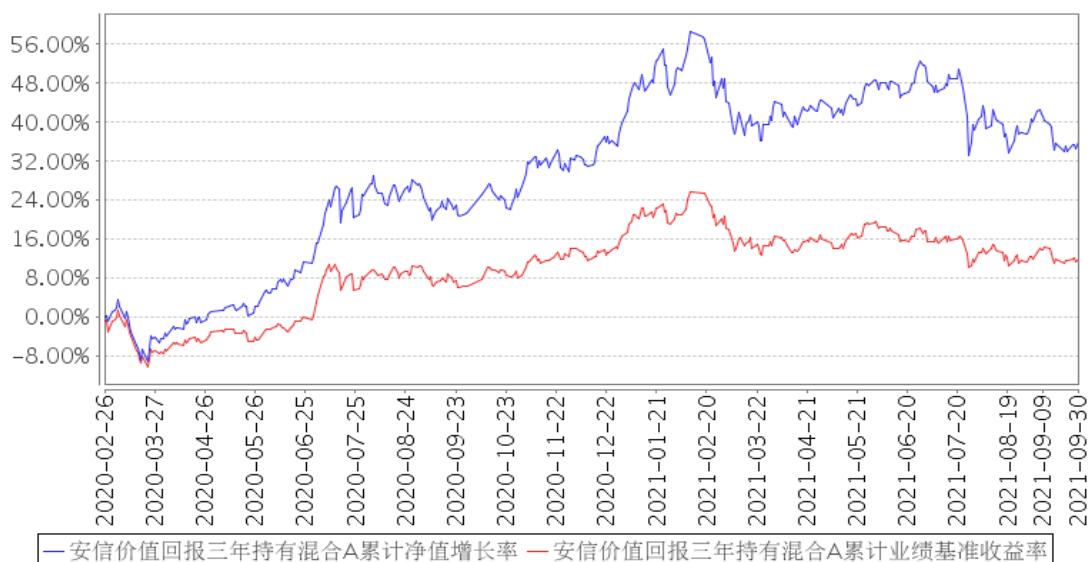
|            |         |       |        |       |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | -10.30% | 1.41% | -4.92% | 0.84% | -5.38% | 0.57% |
| 过去六个月      | -3.17%  | 1.20% | -2.51% | 0.76% | -0.66% | 0.44% |
| 过去一年       | 11.84%  | 1.28% | 5.26%  | 0.83% | 6.58%  | 0.45% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.01%  | 1.29% | 11.85% | 0.91% | 24.16% | 0.38% |

安信价值回报三年持有混合 C

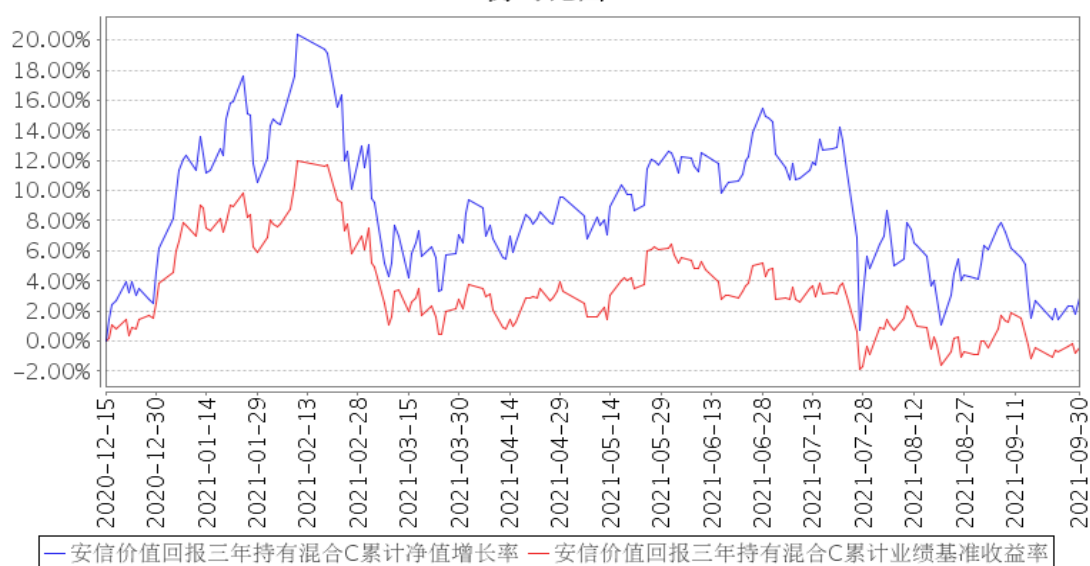
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -10.41% | 1.41%     | -4.92%     | 0.84%         | -5.49% | 0.57% |
| 过去六个月      | -3.41%  | 1.20%     | -2.51%     | 0.76%         | -0.90% | 0.44% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.86%   | 1.32%     | -0.42%     | 0.86%         | 3.28%  | 0.46% |

### 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

安信价值回报三年持有混合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



安信价值回报三年持有混合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 2020 年 2 月 26 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 2020 年 12 月 15 日《关于安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 12 月 15 日起，本基金增加 C 类份额。

## § 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 |        |  |
| 陈一峰 | 本基金的基金经理，总经理助理兼研究总监 | 2020 年 2 月 26 日 | -    | 13 年   | 陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，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、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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、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）的基金经理。  |
| 张明 | 本基金的基金经理 | 2020年2月26日 | - | 10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。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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、安信合作创新主题沪港深灵活配置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会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

本基金的核心投资思路是“选择便宜的好公司”，关键是以一个合理价格买一份未来很有价值的资产。我们始终关注以下几个焦点：公司如何做生意，公司发展空间有多大，相对竞争优势有多强，行业竞争结构和竞争环境如何。

2021 年三季度市场结构分化，上证指数下跌 0.64%，沪深 300 指数下跌 6.85%，中证 500 指数上涨 4.34%，创业板指数下跌 6.69%。分行业来看，三季度采掘、公用事业、钢铁、有色等行业涨幅居前，医药、纺织服装、食品饮料等行业涨幅靠后。

三季度国内经济总量方面，我们观察到经济动能有所减弱，各项经济数据中，出口表现是主要亮点。地产行业销售与投资在三季度明显转弱，产业链下行压力较大。此外，能源双控等政策进一步深化。

价格方面，CPI 指数保持低位运行，PPI 指数则继续维持高位，上游周期品价格特别是动力煤价格持续抬升，预计将维持一段时间。

流动性方面，近期货币政策继续保持合理充裕，十年期国债收益率保持在 3% 以下波动，人民币汇率三季度保持相对稳定。

目前市场整体估值还算合适，但结构分化依然较大。沪深 300 指数基本处于历史平均水平，在一个中期维度，未来的收益获取更多的需要依靠盈利增长驱动。同时由于结构分化较大，不同行业股票今年表现差异极大，部分行业优秀公司内在价值并未得到市场认可，在市场明显调整过程中，这是值得我们关注的错杀机会。

本基金作为股票型基金，我们坚持价值投资的理念，三季度总体加仓的行业是采掘、建材、电气设备，而医药、轻工、通信等行业的配置有所减少。未来在具体投资运作方面，我们仍将自下而上地精选个股，基于尽量精确的企业内在价值判断来优化组合配置。结合未来产业发展空间、企业盈利增速以及动态估值水平的变化，我们目前相对看好的长期投资机会，主要分布在新能源、互联网、中游制造、医药、消费等领域以及地产、建筑、采掘等低估值板块。

在新能源行业，相关公司目前静态估值普遍不太便宜，但从产业维度上来看，行业高成长性毋庸置疑的，展望未来 5-10 年，随着电动车的广泛普及以及储能电池的应用推广，我们预计成长空间有 10 倍以上，所以动态来看部分新能源公司的潜在风险报酬比还是不错的。在互联网行业，公司的商业模式普遍较好，短期由于行业政策监管原因，相关公司估值普遍跌到了历史较低位置，但从长期来看，这些龙头公司的商业模式和竞争优势并无显著影响，也是值得我们特别关注的领域。在医药行业，展望未来 3-5 年，创新研发和进口替代将是医药多个细分子行业加快增长的核心逻辑，医药板块经历此前的调整，很多优质的公司已经回到较低的估值水平，进入可以逐步布局的区间。在传统消费领域，食品饮料行业可能是所有行业中商业模式最好的几个行业之一，龙头具有较强的差异化竞争优势，近期受到市场风格调整影响，部分公司已经进入了风险报酬比不错的区间。在中游制造领域，中国在很多细分行业已具备比较优势，正涌现出一批具备全球竞争力的龙头公司，目前估值仍然具备吸引力，值得我们重点关注。最后，在地产、建筑、采掘等低估值板块，这个领域的公司普遍静态估值较低，且多数处于历史较低分位，反映了市场很多悲观预期，我们认为这类公司会有阶段性估值修复的机会，值得我们把握。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.2698 元，本报告期基金份额净值增长率为 -10.30%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.2652 元，本报告期基金份额净值增长率为 -10.41%，同期业绩比较基准收益率为 -4.92%。

#### 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              | 3,242,169,464.26 | 92.99        |
|    | 其中：股票             | 3,242,169,464.26 | 92.99        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 149,580,000.00   | 4.29         |
|    | 其中：债券             | 149,580,000.00   | 4.29         |
|    | 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 | -                | -            |



|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
|   | 产            |                  |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 75,867,974.71    | 2.18   |
| 8 | 其他资产         | 19,140,268.83    | 0.55   |
| 9 | 合计           | 3,486,757,707.80 | 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 1,072,951,530.69 元，占净值比例 30.83%。

## 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         | 18,116.82        | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 57,301,659.00    | 1.65         |
| C  | 制造业              | 1,436,023,302.37 | 41.26        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,299,875.22     | 0.18         |
| E  | 建筑业              | 289,660,403.39   | 8.32         |
| F  | 批发和零售业           | 73,572,780.33    | 2.11         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 76,445,226.63    | 2.20         |
| J  | 金融业              | 179,280,446.85   | 5.15         |
| K  | 房地产业             | 50,358,776.92    | 1.45         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 218,487.04       | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 29,906.38        | 0.00         |
| 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        | 8,952.62         | 0.00         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 2,169,217,933.57 | 62.33        |

### 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       | 134,061,155.18 | 3.85         |
| 工业       | 9,696,218.60   | 0.28         |
| 非日常生活消费品 | 117,552,009.72 | 3.38         |
| 日常消费品    | 195,840,793.14 | 5.63         |
| 医疗保健     | 82,309,118.75  | 2.36         |
| 金融       | 1,103,121.39   | 0.03         |

|      |                  |       |
|------|------------------|-------|
| 信息技术 | 4,344,262.11     | 0.12  |
| 通讯服务 | 342,973,741.70   | 9.85  |
| 公用事业 | 7,640,626.39     | 0.22  |
| 房地产  | 177,430,483.71   | 5.10  |
| 合计   | 1,072,951,530.69 | 30.83 |

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  | 300750 | 宁德时代   | 669,500    | 351,976,235.00 | 10.11        |
| 2  | 00700  | 腾讯控股   | 892,292    | 342,973,741.70 | 9.85         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 155,777    | 285,071,910.00 | 8.19         |
| 4  | 06186  | 中国飞鹤   | 17,812,000 | 194,977,426.42 | 5.60         |
| 5  | 00688  | 中国海外发展 | 12,006,000 | 177,430,483.71 | 5.10         |
| 6  | 002142 | 宁波银行   | 4,948,879  | 173,953,096.85 | 5.00         |
| 7  | 601668 | 中国建筑   | 33,082,859 | 158,797,723.20 | 4.56         |
| 8  | 000786 | 北新建材   | 4,869,620  | 155,584,359.00 | 4.47         |
| 9  | 601012 | 隆基股份   | 1,749,093  | 144,265,190.64 | 4.15         |
| 10 | 000513 | 丽珠集团   | 3,424,538  | 132,906,319.78 | 3.82         |

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 149,580,000.00 | 4.30         |
|    | 其中：政策性金融债 | 149,580,000.00 | 4.30         |
| 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） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 149,580,000.00 | 4.30         |

### 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  | 210407 | 21 农发 07 | 1,500,000 | 149,580,000.00 | 4.30         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除 21 农发 07（股票代码：210407 CY）、中国建筑（股票代码：601668 SH）、腾讯控股（股票代码：00700 HK）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。

2021 年 4 月 12 日，中国农业发展银行因未依法履行职责被乌审旗住房和城乡建设局罚款人民币 2479.3 元【乌住建罚决字（2021）002 号】。

2020 年 10 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被江西省交通运输厅行政处罚。

2020 年 12 月 1 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被北京市住房和城乡建设委员会整改通知，罚款 0.1 万元【京建法罚简（市）字[2020]第 020721 号】。

2020 年 12 月 15 日，中国建筑股份有限公司因涉嫌违反法律法规被日喀则市生态环境局罚款 30 万元【日市环罚（2020）13 号】。

2021 年 1 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被郑州市城市综合执法局、江阴市住房和城乡建设局分别处以罚款 1 万元、罚款 3 万元【市执罚决字[2020]第 26015 号、澄住建罚字（2021）第 2 号】。

2021 年 3 月 1 日，中国建筑股份有限公司因违反交通法规被肇庆市交通运输局罚款 0.2 万元【粤肇交罚[2021]00298 号】。

2021 年 3 月 26 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局大连市中山区税务局通知整改。

2021 年 3 月 29 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被合肥市城乡建设局行政列入不良行为记录名单, 通报批评, 通知整改。

2021 年 4 月 26 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局庄河市税务局通知整改。

2021 年 5 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局庄河市税务局、重庆市住房和城乡建设委员会罚款、通知整改【（渝）建罚（2021）第 0013-1 号】。

2021 年 5 月 6 日，中国建筑股份有限公司因违反交通法规被广东省交通行政执法局罚款 0.2 万元【粤肇交罚[2021]00297 号】。

2021 年 6 月 10 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被郑州市城市综合执法局罚款 11.5 万元【郑城综罚决字[2021]第 2129107 号、郑城综罚决字[2021]第 2129110 号】。

2021 年 6 月 15 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被惠州市交通运输局行政处罚。

2021 年 6 月 15 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被海东市住房和城乡建设局行政处罚【东建工监（2021）第（0614）号】。

2021 年 8 月 25 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被惠州市交通运输局罚款 10 万元【粤惠交罚[2021]01561 号】。

2021 年 3 月 12 日，腾讯控股有限公司因价格垄断被市场监管总局罚款 50 万元【国市监处（2021）13 号】。

2021 年 3 月 19 日，腾讯控股有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室诫勉谈话，通知整改。

2021 年 4 月 30 日，腾讯控股有限公司在易车、途虎股权收购交易中因涉嫌违反法律法规，被国家市场监督管理总局分别各处以罚款 50 万元【国市监处（2021）30 号、国市监处（2021）31 号】。

2021 年 7 月 7 日，腾讯控股有限公司在小红书、猎豹移动、蘑菇街、搜狗股权收购交易中因涉嫌违反法律法规，被国家市场监督管理总局分别各处以罚款 50 万元【国市监处（2021）59 号、国市监处（2021）60 号、国市监处(2021)61 号、国市监处（2021）65 号】。

2021 年 7 月 8 日，腾讯控股有限公司因违规经营被工业和信息化部通知整改。

2021 年 7 月 24 日，腾讯控股有限公司因价格垄断被市场监管总局通知整改，罚款 50.00 万元【国市监处（2021）67 号】。

### 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   | 298,555.80    |
| 2  | 应收证券清算款 | 14,030,600.34 |
| 3  | 应收股利    | 4,303,566.96  |
| 4  | 应收利息    | 507,545.73    |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 9 | 合计 | 19,140,268.83 |
|---|----|---------------|

#### 5.11.4 报告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。

#### 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                        | 安信价值回报三年持有混合 A   | 安信价值回报三年持有混合 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,733,535,449.44 | 48,296.84      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 7,158,799.82     | 52,482.81      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                | -              |
| 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               | 2,740,694,249.26 | 100,779.65     |

### § 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

单位：份

| 项目                       | 安信价值回报三年持有混合 A | 安信价值回报三年持有混合 C |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 2,964,614.38   | -              |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -              | -              |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -              | -              |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 2,964,614.38   | -              |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.11           | -              |

#### 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价值回报三年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信价值回报三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他文件。

### 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

2021 年 10 月 26 日