

# 安信招信一年持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
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.....	14
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.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52

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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信招信一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	安信招信一年持有混合	
基金主代码	012161	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 20 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	
报告期末基金份额总额	639,852,647.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信招信一年持有混合 A	安信招信一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012161	012162
报告期末下属分级基金的份额总额	372,022,187.19 份	267,830,460.47 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略方面，本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的配置比例。股票投资策略方面，本基金以基本面分析为基础，采用“自下而上”的分析方法，主要从公司的盈利能力、自由现金流状况、估值水平、行业地位等角度，综合评价个股的投资价值，选择低估值、安全边际较高的个股进行投资。债券投资策略方面，本基金通过对国内外宏观经济态势、未来市场利率趋势、收益率曲线变化趋势及市场信用环境变化方向等因素进行综合分析，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构建和调整固定收益证券投资组合。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。投资的原则是控制投资风险、稳健增值。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。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。存

	托凭证投资策略方面，本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%（经汇率调整）+人民币活期存款利率（税后）*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。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	张燕
	联系电话	0755-82509999	0755-83199084
	电子邮箱	service@essencefund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95555
传真		0755-82799292	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		刘入领	缪建民

### 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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	安信招信一年持有混合 A	安信招信一年持有混合 C
本期已实现收益	-12,877,109.91	-10,917,012.27
本期利润	-17,495,350.75	-15,191,679.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0405	-0.0446
本期加权平均净值利润率	-4.19%	-4.62%
本期基金份额净值增长率	-3.54%	-3.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-8,286,747.55	-6,837,605.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0223	-0.0255
期末基金资产净值	363,735,439.64	260,992,854.81
期末基金份额净值	0.9777	0.9745
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.23%	-2.55%

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

安信招信一年持有混合 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	2.31%	0.24%	1.02%	0.16%	1.29%	0.08%
过去三个月	2.90%	0.28%	1.20%	0.21%	1.70%	0.07%
过去六个月	-3.54%	0.32%	-0.72%	0.23%	-2.82%	0.09%
过去一年	-2.71%	0.34%	-0.82%	0.19%	-1.89%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.23%	0.32%	-0.60%	0.19%	-1.63%	0.13%

安信招信一年持有混合 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	2.30%	0.25%	1.02%	0.16%	1.28%	0.09%
过去三个月	2.84%	0.28%	1.20%	0.21%	1.64%	0.07%
过去六个月	-3.68%	0.32%	-0.72%	0.23%	-2.96%	0.09%
过去一年	-3.00%	0.34%	-0.82%	0.19%	-2.18%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.55%	0.32%	-0.60%	0.19%	-1.95%	0.13%

注：根据《安信招信一年持有期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：中债综合全价（总值）指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*12%+恒生指数收益率\*3%（经汇率调整）+人民币活期存款利率（税后）\*5%。中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好

地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，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。

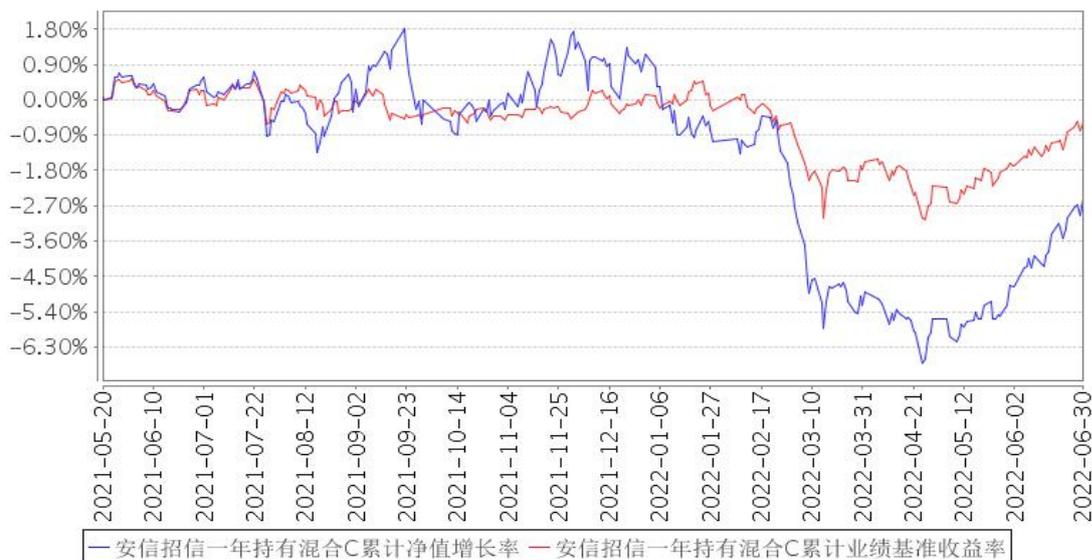
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 80%、12%、3%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信招信一年持有混合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



安信招信一年持有混合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 2021 年 5 月 20 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 81 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、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、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、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、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、安信永丰定期开放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、安信永泰定期开放债券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、安信永瑞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、安信盈利驱动股票型证券投资基金、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。

#### 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		
任凭	本基金的基金经理	2021年6月1日	-	15年	任凭女士，法学硕士。曾任职于招商基金管理有限公司，2011年加入安信基金管理有限公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信保证金交易型货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理；安信恒利增强债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任安信活期宝货币市场基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信宏盈18个月持有期混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金的基金经理。
张睿	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2022年5月20日	-	15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公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置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、安信浩盈6个月持有期混合型证券投资基金

					的基金经理。
钟光正	本基金的基金经理，固定收益投资总监	2021年5月20日	2022年6月23日	18年	钟光正先生，经济学硕士。历任广东发展银行总行资金部交易员，招商银行股份有限公司总行资金交易部交易员，长城基金管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信稳健回报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

总体来看，2022 年二季度债市偏震荡格局。国外方面，二季度美国通胀持续超预期，美联储启动加息并宣布缩表，6 月一次性加息 75BP，造成国际资本市场较大波动。国内方面，上海疫情集中爆发后，五六月份已得到有效控制，国内经济呈现复苏态势，经济数据总体持续向好。受益于银行间流动性充裕，资金利率维持低位，中短端利率品种表现优于长端。随着经济数据的改善，季度末债券收益率上行较为明显。

权益方面 2022 上半年，全球主要股指普遍调整：A 股上证指数、深证成指、创业板指涨跌幅分别为：-6.57%、-6.63%和-15.41%；美股方面，纳斯达克指数、标普 500 和道琼斯工业指数涨跌幅分别为：-29.51%、-20.58%和-15.31%，A 股表现相对海外更有韧性。

组合操作方面，主要投资品种仍然以高等级信用债和利率债为主，以保证组合充足的流动性，同时使用多种策略力争增厚收益，可转债整体仓位较为中性。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信招信一年持有混合 A 基金份额净值为 0.9777 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.54%；安信招信一年持有混合 C 基金份额净值为 0.9745 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.68%；同期业绩比较基准收益率为-0.72%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年的货币政策核心为稳增长，包括保持“较合理充裕略高水平”的流动性环境来应对疫情对二季度经济活动的极大扰动，以及为政府债券发行提供适宜的货币环境。下半年，上述影响已基本出清，外部制约明显加强，货币政策或将更为关注多目标间的平衡。需重点关注 7 月缴税走款期间的央行应对操作和资金面表现，8、9 月 MLF 到期将给央行提供操作空间，当前货币市场微观结构的紧绷也是影响预期波动的重要因素。权益方面，强势美元驱动下，新兴市场大类资产可能面临定价调整。

## 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，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核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：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：安信招信一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,389,747.65	52,869,214.00
结算备付金		533,272.93	4,558,801.50
存出保证金		87,959.36	140,167.12
交易性金融资产	6.4.7.2	488,705,932.99	768,565,311.46
其中：股票投资		93,732,207.33	159,923,788.84
基金投资		-	-
债券投资		394,973,725.66	608,641,522.62
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	125,097,273.69	16,000,000.00
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		10,049,585.54	-

应收股利		-	-
应收申购款		727.09	729.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,460,372.01
资产总计		629,864,499.25	851,594,595.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	40,711,012.05
应付赎回款		4,527,209.83	-
应付管理人报酬		318,686.51	411,611.46
应付托管费		79,671.64	102,902.86
应付销售服务费		67,505.50	91,534.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,815.83	25,091.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	127,315.49	817,174.94
负债合计		5,136,204.80	42,159,326.74
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	639,852,647.66	799,267,756.71
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-15,124,353.21	10,167,511.84
净资产合计		624,728,294.45	809,435,268.55
负债和净资产总计		629,864,499.25	851,594,595.29

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 639,852,647.66 份，其中安信招信一年持有混合 A 基金份额总额 372,022,187.19 份，基金份额净值 0.9777 元；安信招信一年持有混合 C 基金份额总额 267,830,460.47 份，基金份额净值 0.9745 元。

（2）以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：安信招信一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 5 月 20 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-29,245,036.83	4,851,837.79
1. 利息收入		992,920.45	1,684,617.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	295,013.54	271,729.77
债券利息收入		-	689,315.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		697,906.91	723,572.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-21,345,049.15	1,132,143.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,041,046.66	383,905.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-18,698,436.13	-439,939.91
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	77,603.90	-
股利收益	6.4.7.15	1,316,829.74	1,188,178.38
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	-8,892,908.13	2,035,075.90
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,441,993.48	1,048,282.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,228,030.77	539,718.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	557,007.68	134,929.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	491,126.81	120,125.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		27,180.51	5,091.84
其中：卖出回购金融资产支		27,180.51	5,091.84

出			
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		18,494.99	1,150.08
8. 其他费用	6.4.7.19	120,152.72	247,267.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,687,030.31	3,803,555.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,687,030.31	3,803,555.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-32,687,030.31	3,803,555.54

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信招信一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
一、上期期末净资产（基金净值）	799,267,756.71	-	10,167,511.84	809,435,268.55
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）	799,267,756.71	-	10,167,511.84	809,435,268.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-159,415,109.05	-	-25,291,865.05	-184,706,974.10
（一）、综合收益总额	-	-	-32,687,030.31	-32,687,030.31
（二）、本期基	-159,415,109.05	-	7,395,165.26	-152,019,943.79

基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	391,988.77	-	-15,431.84	376,556.93
2. 基金赎回款	-159,807,097.82	-	7,410,597.10	-152,396,500.72
(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、本期期末净资产(基金净值)	639,852,647.66	-	-15,124,353.21	624,728,294.45
项目	上年度可比期间 2021年5月20日(基金合同生效日)至2021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)	-	-	-	-
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)	799,006,713.76	-	-	799,006,713.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	3,803,555.54	3,803,555.54
(一)、综合收益总额	-	-	3,803,555.54	3,803,555.54
(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)				
其中: 1. 基金申 购款	-	-	-	-
2. 基金 赎回款	-	-	-	-
(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、本期期末净 资产(基金净 值)	799,006,713.76	-	3,803,555.54	802,810,269.30

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:

刘入领	廖维坤	苗杨
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

安信招信一年持有期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”)证监许可[2021]232号《关于准予安信招信一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》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《安信招信一年持有期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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 798,850,638.55 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0509 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 5 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 799,006,713.76 份,其中认购资金利息折合 156,075.21 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

司。

对于每份基金份额，锁定期从起始日开始，至起始日后一年的年度对日的前一日止。基金份额在锁定期内不办理赎回及转换转出业务，锁定期届满后的下一个工作日起可以办理赎回及转换业务。对于每份认购份额，起始日指基金合同生效日；对于每份申购份额，起始日指该基金份额申购申请确认日，对于每份转换转入份额，起始日指基金份额转换转入确认日。年度对日指某一个特定日期在后续年份中的对应日期，若该年份无此对应日期，则调整至该日所在月度的最后一日。若该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。

根据《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《安信招信一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费/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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、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：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/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《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券资产(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款和其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-30%，其中投资于港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%。本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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：中债综合全价(总值)指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*12%+恒生指数收益率\*3%(经汇率调整)+人民币活期存款利率(税后)\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间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

除下文涉及的会计政策变更外，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种

方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公

允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

###### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 52,869,214.00 元、4,558,801.50 元、140,167.12 元、16,000,000.00 元、9,460,372.01 元和 729.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 52,872,381.04 元、4,561,058.15 元、140,236.53 元、16,000,000.00 元、0.00 元和 729.20 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 768,565,311.46 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 778,020,190.37 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为 40,711,012.05 元、411,611.46 元、102,902.86 元、91,534.23 元和 687,874.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、

应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 40,711,012.05 元、411,611.46 元、102,902.86 元、91,534.23 元和 687,874.94 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	5,389,747.65
等于：本金	5,388,356.95
加：应计利息	1,390.70
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	5,389,747.65

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	99,899,917.22	-	93,732,207.33	-6,167,709.89	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	76,371,141.40	441,668.87	79,029,929.35	2,217,119.08
	银行间市场	313,197,363.12	2,779,196.31	315,943,796.31	-32,763.12
	合计	389,568,504.52	3,220,865.18	394,973,725.66	2,184,355.96
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	489,468,421.74	3,220,865.18	488,705,932.99	-3,983,353.93	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	125,097,273.69	-
合计	125,097,273.69	-

#### 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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	28,755.34
其中：交易所市场	15,969.16
银行间市场	12,786.18
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	29,752.78
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	127,315.49

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信招信一年持有混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	443,439,783.56	443,439,783.56
本期申购	136,299.31	136,299.31
本期赎回（以“-”号填列）	-71,553,895.68	-71,553,895.68
本期末	372,022,187.19	372,022,187.19

##### 安信招信一年持有混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	355,827,973.15	355,827,973.15
本期申购	255,689.46	255,689.46
本期赎回（以“-”号填列）	-88,253,202.14	-88,253,202.14
本期末	267,830,460.47	267,830,460.47

注：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

安信招信一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,284,705.20	2,725,974.08	6,010,679.28
本期利润	-12,877,109.91	-4,618,240.84	-17,495,350.75
本期基金份额交易产生的变动数	1,752,186.37	1,445,737.55	3,197,923.92
其中：基金申购款	-1,931.85	-2,532.99	-4,464.84
基金赎回款	1,754,118.22	1,448,270.54	3,202,388.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,840,218.34	-446,529.21	-8,286,747.55

安信招信一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,969,393.55	2,187,439.01	4,156,832.56
本期利润	-10,917,012.27	-4,274,667.29	-15,191,679.56
本期基金份额交易产生的变动数	2,434,642.47	1,762,598.87	4,197,241.34
其中：基金申购款	-6,594.03	-4,372.97	-10,967.00
基金赎回款	2,441,236.50	1,766,971.84	4,208,208.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,512,976.25	-324,629.41	-6,837,605.66

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	91,511.56
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	202,234.54
其他	1,267.44
合计	295,013.54

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	121,088,436.94
减：卖出股票成本总额	124,851,137.66
减：交易费用	278,345.94
买卖股票差价收入	-4,041,046.66

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,375,395.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,073,831.37
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	-18,698,436.13

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,361,812,795.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,373,379,244.08
减：应计利息总额	15,494,041.93
减：交易费用	13,340.68
买卖债券差价收入	-27,073,831.37

#### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
国债期货投资收益	77,603.90

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,316,829.74
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	1,316,829.74

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,892,908.13
股票投资	-10,156,218.09
债券投资	1,263,309.96
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	-8,892,908.13

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,292.57
银行间账户维护费	18,600.00
合计	120,152.72

#### 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

截至本财务报表批注报出日，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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年5月20日（基金合同生效日） 至2021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	-	-	217,659,168.40	100.00

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 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（%）

-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年5月20日（基金合同生效日）至2021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	154,822.72	100.00	154,822.72	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的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市场信息服务。

#### 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年5月20日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,228,030.77	539,718.10
其中：支付销售机构的客户维护费	1,113,550.67	269,753.69

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0.60%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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年5月20日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	557,007.68	134,929.54

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0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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 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		
	安信招信一年持有混合 A	安信招信一年持有混合 C	合计
安信基金	-	36.42	36.42
安信证券	-	231.24	231.24
招商银行	-	489,926.25	489,926.25
合计	-	490,193.91	490,193.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信招信一年持有混合 A	安信招信一年持有混合 C	合计
安信基金	-	6.70	6.70
安信证券	-	54.40	54.40
招商银行	-	119,844.88	119,844.88
合计	-	119,905.98	119,905.98

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 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年5月20日（基金合同生效日）至2021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
	招商银行	5,389,747.65	91,511.56	13,510,805.09

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本期及上年度可比期间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(2022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
300834	星辉环材	2022年1月6	6个月	新股锁定	55.57	30.03	521	28,951.97	15,645.63	-

		日									
301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70		-
301112	信邦智能	2022年 6月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	89	2,450.17	4,008.56		-
301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42		-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28		-
301123	奕东电子	2022年 1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84		-
301125	腾亚精工	2022年 5月27日	6个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34		-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90		-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
301139	元道通信	2022年 6月30日	1-6个月(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46		-
301150	中一科技	2022年 4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	292	31,894.20	24,165.92		-
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38		-
301153	中科江南	2022年 5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04		-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301160	翔楼新材	2022年 5月25日	6个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72		-
301162	国能	2022年	6个月	新股锁	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74		-

	日新	4月19日		定							
301175	中科环保	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股锁定	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	268	17,173.44	10,055.36		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	494	28,098.72	27,871.48		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77		-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	240	4,144.80	3,559.20		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	201	19,485.76	17,651.82		-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1-6个月(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-

301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	1,547	29,671.46	49,612.29	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1-6个月(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股锁定	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-

		日									
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72		-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股锁定	82.79	65.19	4,297	355,748.63	280,121.43		-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券											
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注	
113060	浙22转债	2022年6月17日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	10	999.98	1,000.05		

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，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，本基金无从事交易所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。

#### 6.4.12.4 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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于 2022 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 39.13%(2021 年 12 月 31 日：47.32%)。

##### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	171,119,027.82	126,112,797.00
合计	171,119,027.82	126,112,797.00

- 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	57,724,236.40	206,903,925.62
AAA 以下	15,590,969.46	85,969,000.00
未评级	150,539,491.98	189,655,800.00
合计	223,854,697.84	482,528,725.62

- 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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于报告期末，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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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 2022 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	5,389,747.65	-	-	-	5,389,747.65
结算备付金	533,272.93	-	-	-	533,272.93
存出保证金	87,959.36	-	-	-	87,959.36
交易性金融资产	259,526,357.25	100,367,754.16	35,079,614.25	93,732,207.33	488,705,932.99
买入返售金融资产	125,097,273.69	-	-	-	125,097,273.69
应收申购款	-	-	-	727.09	727.09
应收清算款	-	-	-	10,049,585.54	10,049,585.54
资产总计	390,634,610.88	100,367,754.16	35,079,614.25	103,782,519.96	629,864,499.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,527,209.83	4,527,209.83
应付管理人报酬	-	-	-	318,686.51	318,686.51
应付托管费	-	-	-	79,671.64	79,671.64
应付销售服务费	-	-	-	67,505.50	67,505.50
应交税费	-	-	-	15,815.83	15,815.83
其他负债	-	-	-	127,315.49	127,315.49
负债总计	-	-	-	5,136,204.80	5,136,204.80
利率敏感度缺口	390,634,610.88	100,367,754.16	35,079,614.25	98,646,315.16	624,728,294.45
上年度末 2021 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	52,869,214.00	-	-	-	52,869,214.00
结算备付金	4,558,801.50	-	-	-	4,558,801.50
存出保证金	140,167.12	-	-	-	140,167.12
交易性金融资产	136,646,597.00	377,911,800.00	94,083,125.62	159,923,788.84	768,565,311.46
买入返售金融资产	16,000,000.00	-	-	-	16,000,000.00
应收申购款	-	-	-	729.20	729.20
其他资产	-	-	-	9,460,372.01	9,460,372.01
资产总计	210,214,779.62	377,911,800.00	94,083,125.62	169,384,890.05	851,594,595.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	411,611.46	411,611.46
应付托管费	-	-	-	102,902.86	102,902.86
应付证券清算款	-	-	-	40,711,012.05	40,711,012.05
应付销售服务费	-	-	-	91,534.23	91,534.23
应交税费	-	-	-	25,091.20	25,091.20
其他负债	-	-	-	817,174.94	817,174.94
负债总计	-	-	-	42,159,326.74	42,159,326.74
利率敏感度缺口	210,214,779.62	377,911,800.00	94,083,125.62	127,225,563.31	809,435,268.55

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	1,502,244.83	3,080,484.99
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,476,275.10	-3,047,339.94

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-30%，其中投资于港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%；同业存单的比例不超过基金资产的 20%。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)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2022年6月30日		上年度末 2021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	93,732,207.33	15.00	159,923,788.84	19.76
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	93,732,207.33	15.00	159,923,788.84	19.76

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	5,304,035.05	8,593,166.85
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-5,304,035.05	-8,593,166.85

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	155,017,490.11	183,270,015.83
第二层次	332,777,096.60	585,295,295.63

第三层次	911,346.28	-
合计	488,705,932.99	768,565,311.46

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## § 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	93,732,207.33	14.88
	其中：股票	93,732,207.33	14.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	394,973,725.66	62.71
	其中：债券	394,973,725.66	62.71
	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	125,097,273.69	19.86
	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	5,923,020.58	0.94
8	其他各项资产	10,138,271.99	1.61

9	合计	629,864,499.25	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	5,338,529.30	0.85
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,159,032.41	10.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,891.58	0.00
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	19,698,507.01	3.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	274,111.15	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	193,386.55	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	93,732,207.33	15.00

### 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	300750	宁德时代	24,100	12,869,400.00	2.06
2	600519	贵州茅台	5,800	11,861,000.00	1.90
3	600702	舍得酒业	56,800	11,586,632.00	1.85
4	002555	三七互娱	441,800	9,379,414.00	1.50
5	002624	完美世界	592,600	8,515,662.00	1.36
6	002466	天齐锂业	59,000	7,363,200.00	1.18

7	603501	韦尔股份	38,000	6,575,140.00	1.05
8	002991	甘源食品	88,700	6,119,413.00	0.98
9	002714	牧原股份	96,590	5,338,529.30	0.85
10	000568	泸州老窖	20,000	4,930,800.00	0.79
11	600809	山西汾酒	12,000	3,897,600.00	0.62
12	000858	五粮液	10,000	2,019,300.00	0.32
13	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.24
14	688234	天岳先进	4,297	280,121.43	0.04
15	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.04
16	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
17	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
18	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.01
19	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
20	301238	瑞泰新材	1,547	49,612.29	0.01
21	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
22	301207	华兰疫苗	494	27,871.48	0.00
23	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
24	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
25	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
26	301150	中一科技	292	24,165.92	0.00
27	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
28	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
29	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
30	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
31	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
32	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
33	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
34	301219	腾远钴业	201	17,651.82	0.00
35	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
36	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
37	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
38	300834	星辉环材	521	15,645.63	0.00
39	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
40	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
41	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
42	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
43	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
44	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
45	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
46	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
47	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
48	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00

49	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
50	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
51	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
52	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
53	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
54	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
55	301196	唯科科技	268	10,055.36	0.00
56	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
57	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
58	000049	德赛电池	200	9,020.00	0.00
59	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
60	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
61	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
62	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
63	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
64	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
65	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
66	301112	信邦智能	89	4,008.56	0.00
67	301217	铜冠铜箔	240	3,559.20	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	300750	宁德时代	13,231,350.00	1.63
2	603501	韦尔股份	12,387,685.80	1.53
3	002624	完美世界	7,950,863.00	0.98
4	000792	盐湖股份	7,933,557.00	0.98
5	000661	长春高新	6,285,412.00	0.78
6	002555	三七互娱	6,070,164.00	0.75
7	002714	牧原股份	5,339,130.30	0.66
8	688062	迈威生物	580,394.40	0.07
9	688223	晶科能源	401,150.00	0.05
10	688234	天岳先进	355,748.63	0.04
11	688261	东微半导	343,850.00	0.04
12	301150	中一科技	317,633.52	0.04
13	301238	瑞泰新材	296,637.88	0.04
14	300834	星辉环材	289,297.42	0.04
15	301207	华兰疫苗	280,645.92	0.03
16	301201	诚达药业	256,232.25	0.03
17	301123	奕东电子	243,893.73	0.03

18	301175	中科环保	243,311.08	0.03
19	301302	华如科技	241,991.53	0.03
20	688270	臻镭科技	229,265.40	0.03

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	000792	盐湖股份	17,488,402.00	2.16
2	600048	保利发展	9,059,614.00	1.12
3	600499	科达制造	8,394,860.00	1.04
4	603501	韦尔股份	7,614,834.00	0.94
5	000661	长春高新	6,961,360.00	0.86
6	002648	卫星化学	6,821,915.00	0.84
7	000155	川能动力	6,467,609.00	0.80
8	300122	智飞生物	6,447,525.00	0.80
9	300035	中科电气	5,955,433.00	0.74
10	002624	完美世界	5,606,821.00	0.69
11	300752	隆利科技	5,422,857.45	0.67
12	002466	天齐锂业	5,033,757.00	0.62
13	603707	健友股份	4,482,611.70	0.55
14	002402	和而泰	4,138,035.00	0.51
15	000568	泸州老窖	3,845,501.00	0.48
16	603799	华友钴业	3,086,290.00	0.38
17	688223	晶科能源	867,301.30	0.11
18	688187	时代电气	728,015.36	0.09
19	688062	迈威生物	554,197.80	0.07
20	301238	瑞泰新材	483,413.68	0.06

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	68,815,774.24
卖出股票收入（成交）总额	121,088,436.94

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	119,351,363.21	19.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,188,128.77	4.99
	其中：政策性金融债	31,188,128.77	4.99
4	企业债券	12,627,330.18	2.02
5	企业短期融资券	161,598,585.75	25.87
6	中期票据	7,291,218.03	1.17
7	可转债（可交换债）	62,917,099.72	10.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	394,973,725.66	63.22

## 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	012105158	21 蓉城轨交 SCP006	500,000	50,847,652.05	8.14
2	012281494	22 东航股 SCP013	500,000	50,195,000.00	8.03
3	210008	21 付息国债 08	400,000	40,322,290.41	6.45
4	012281777	22 华能集 SCP014	300,000	30,087,328.77	4.82
5	210004	21 付息国债 04	250,000	25,420,897.26	4.07

## 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。

## 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。

### 7.11.2 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，季末随着债券收益率的上行，了结了空头头寸，符合既定的投资策略和投资目标。

## 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 18 国开 11（代码：180211 CY）、21 电网 CP018（代码：042100475 CY）、22 华能集 SCP014（代码：012281777 CY）、浦发转债（代码：110059 SH）、22 东航股 SCP013（代码：012281494 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. 国家开发银行

2022 年 3 月 25 日，国家开发银行因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。

#### 2. 国家电网有限公司

2021 年 7 月 1 日，国家电网有限公司因未依法履行职责被国家能源局通知整改。

#### 3. 中国华能集团有限公司

2021 年 7 月 31 日，中国华能集团有限公司因涉嫌违反法律法规被自然资源部行政处罚。

#### 4. 上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 7 月 16 日，上海浦东发展银行股份有限公司因逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2021 年 11 月 15 日，上海浦东发展银行股份有限公司因提供虚假资料证明文件被国家外汇管

理局上海市分局罚款。

2022 年 3 月 25 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保险监督管理委员会罚款。

5. 中国东方航空股份有限公司

2021 年 7 月 30 日，中国东方航空股份有限公司因未依法履行职责被中国民用航空新疆管理局罚款。

2021 年 12 月-2022 年 1 月，中国东方航空股份有限公司因未依法履行职责被中国民用航空华东地区管理局罚款。

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。

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	87,959.36
2	应收清算款	10,049,585.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	727.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,138,271.99

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	14,839,827.40	2.38
2	132018	G 三峡 EB1	13,996,095.89	2.24
3	132015	18 中油 EB	7,335,319.18	1.17
4	113044	大秦转债	3,271,742.47	0.52
5	127045	牧原转债	2,773,496.47	0.44
6	110053	苏银转债	2,771,548.55	0.44
7	123107	温氏转债	2,392,158.71	0.38
8	113052	兴业转债	1,997,803.75	0.32
9	128081	海亮转债	1,662,135.48	0.27

10	110081	闻泰转债	1,601,393.07	0.26
11	113602	景 20 转债	1,573,246.82	0.25
12	123119	康泰转 2	1,510,610.33	0.24
13	113633	科沃转债	1,438,887.06	0.23
14	110076	华海转债	1,358,995.33	0.22
15	128136	立讯转债	1,143,952.05	0.18
16	127044	蒙娜转债	793,123.34	0.13
17	113616	韦尔转债	733,125.38	0.12
18	127030	盛虹转债	258,428.82	0.04

### 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 (%)
安信招信一年持有混合 A	2,385	155,984.15	-	-	372,022,187.19	100.00
安信招信一年持有混合 C	1,568	170,810.24	500,118.06	0.19	267,330,342.41	99.81
合计	3,929	162,853.82	500,118.06	0.08	639,352,529.60	99.92

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	安信招信一年持有混合 A	12,638.08	0.00

理人所有从业人员持有本基金	安信招信一年持有混合 C	10.00	0.00
	合计	12,648.08	0.00

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	安信招信一年持有混合 A	0
	安信招信一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信招信一年持有混合 A	0
	安信招信一年持有混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信招信一年持有混合 A	安信招信一年持有混合 C
基金合同生效日 (2021年5月20日) 基金份额总额	443,303,319.38	355,703,394.38
本报告期期初基金份额总额	443,439,783.56	355,827,973.15
本报告期基金总申购份额	136,299.31	255,689.46
减：本报告期基金总赎回份额	71,553,895.68	88,253,202.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	372,022,187.19	267,830,460.47

## § 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

本基金管理人未发生重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所（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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	佣金	占当期佣金	

			交总额的比例 (%)		总量的比例 (%)	
长江证券	2	180,286,599.04	100.00	128,436.79	100.00	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	新租

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、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、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	310,562,599.66	100.00	3,472,000,000.00	100.00	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 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公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-01
2	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金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	2022-01-21
3	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国盛证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-26
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众惠基金销售有	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-02-16

	限公司为基金销售服务机构的公告		
5	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金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	2022-03-31
6	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华宝证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-08
7	安信基金管理有限责任公司关于对公司旗下 FOF 资产管理计划通过直销柜台办理旗下基金认购、申购、赎回及转换业务免收相关费用的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-15
8	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金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	2022-04-21
9	安信招信一年持有期混合型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告	上海证券报	2022-05-18
10	2022 年度 安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报	2022-05-21
11	2022 年度 安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报	2022-06-25

## § 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招信一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信招信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信招信一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信招信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。

### 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

2022 年 8 月 30 日