

# 安信价值启航混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度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 2023 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
8.6 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 .....	59
8.7 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 .....	59
8.8 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 .....	59
8.9 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 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 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 .....	62
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信价值启航混合型证券投资基金	
基金简称	安信价值启航混合	
基金主代码	011905	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 29 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	388,217,598.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C
下属分级基金的交易代码	011905	011906
报告期末下属分级基金的份额总额	355,388,783.83 份	32,828,814.96 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求，合理确定基金在股票、债券、金融衍生品等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。股票投资策略方面，本基金所称价值主题相关股票是指从基本面研究出发，根据现金流贴现模型，所得到的公司潜在价值显著低于市场交易价格的上市公司股票。本基金将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、境外机构投资者行为、境内机构和个人投资者行为、世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等影响港股投资的主要因素，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。债券投资方面，本基金将采取自上而下的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策、利率水平、物价水平以及风险偏好的变化趋势，从而确定债券的配置数量与结构。具体而言，通过比较不同券种之间的收益率水平、流动性、信用风险等因素评估债券的内在投资价值，灵活运用多种策略进行债券组合的配置。衍生品投资方面，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

	<p>健增值。其中股指期货以对冲持仓现货波动风险为主要原则。资产支持证券投资方面，本基金将通过对宏观经济形势、提前偿还率、资产池结构、资产池质量以及资产池资产所属行业景气度等因素的研究，预测资产池未来的现金流特征，并通过详查标的证券的发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×25%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>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。</p>

### 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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2022 年		2021 年 6 月 29 日 (基金合同生效日) - 2021 年 12 月 31 日	
	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C
本期已实现收益	4,220,516.46	-824,796.66	47,714,529.32	3,608,652.31
本期利润	-9,802,721.69	-14,541,084.92	58,896,203.77	4,248,810.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0265	-0.3183	0.0772	0.0715
本期加权平均净值利润率	-2.51%	-30.52%	7.58%	7.04%
本期基金份额净值增长率	-5.22%	-5.60%	7.36%	7.14%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	6,253,483.73	374,546.68	33,825,087.74	2,435,470.28
期末可供分配基金份额利润	0.0176	0.0114	0.0567	0.0546
期末基金资产净值	361,642,267.56	33,203,361.64	640,206,700.97	47,773,081.58
期末基金份额净值	1.0176	1.0114	1.0736	1.0714
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.14%	7.36%	7.14%

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

安信价值启航混合 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
过去三个月	1.70%	1.82%	1.92%	1.00%	-0.22%	0.82%
过去六个月	-10.37%	1.57%	-10.02%	0.85%	-0.35%	0.72%
过去一年	-5.22%	1.65%	-15.87%	0.98%	10.65%	0.67%
自基金合同生效起至今	1.76%	1.52%	-19.88%	0.91%	21.64%	0.61%

安信价值启航混合 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
过去三个月	1.58%	1.82%	1.92%	1.00%	-0.34%	0.82%
过去六个月	-10.56%	1.57%	-10.02%	0.85%	-0.54%	0.72%
过去一年	-5.60%	1.65%	-15.87%	0.98%	10.27%	0.67%
自基金合同生效起至今	1.14%	1.52%	-19.88%	0.91%	21.02%	0.61%

注：根据《安信价值启航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×70%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×25%。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。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。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。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。

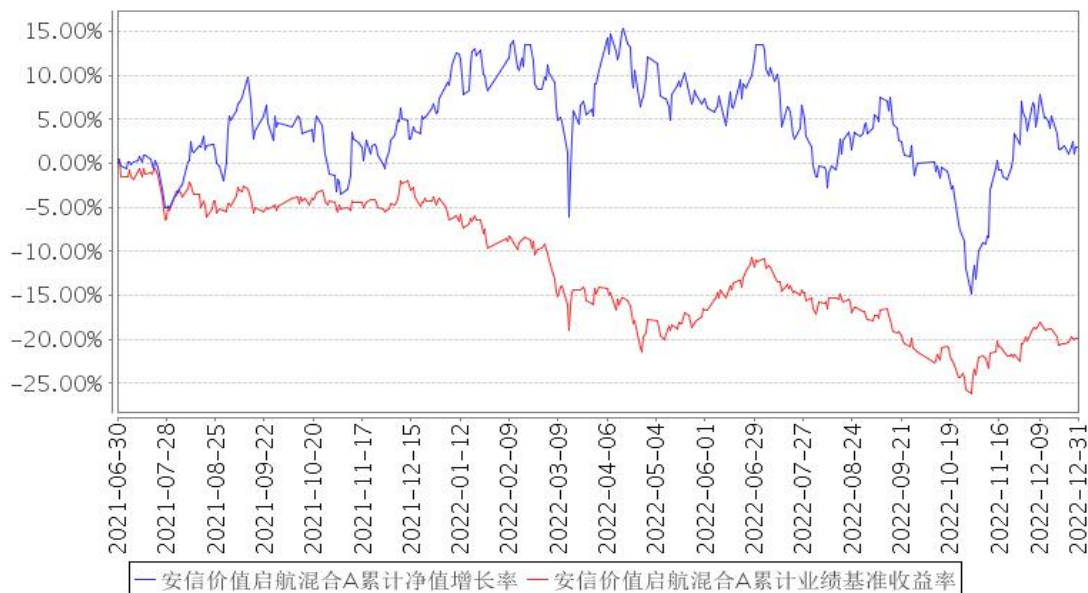
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合



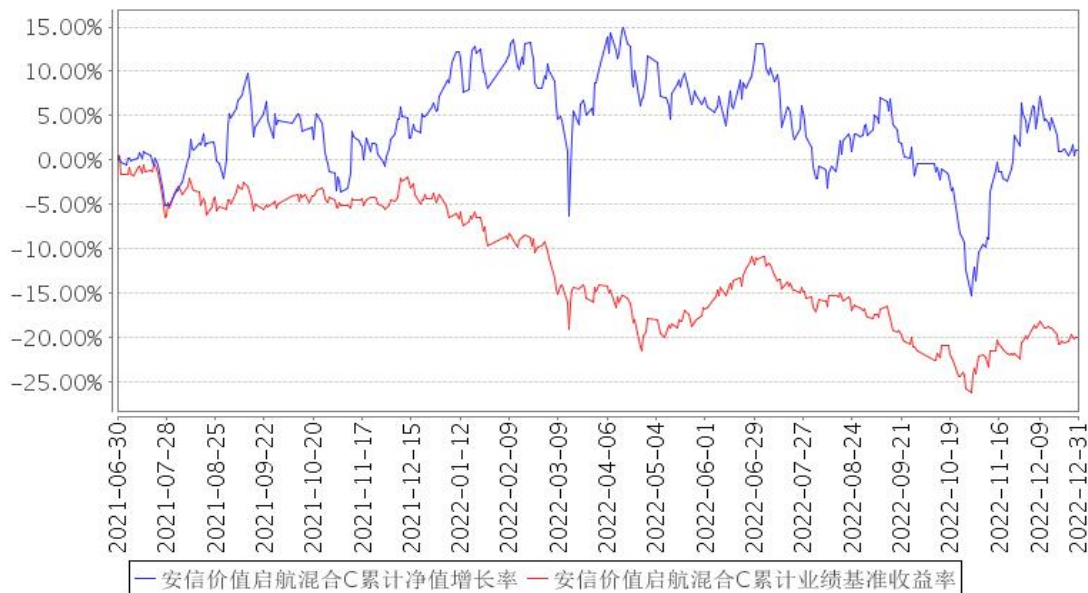
同要求，基准指数每日按照 70%、5%、25%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信价值启航混合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



安信价值启航混合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

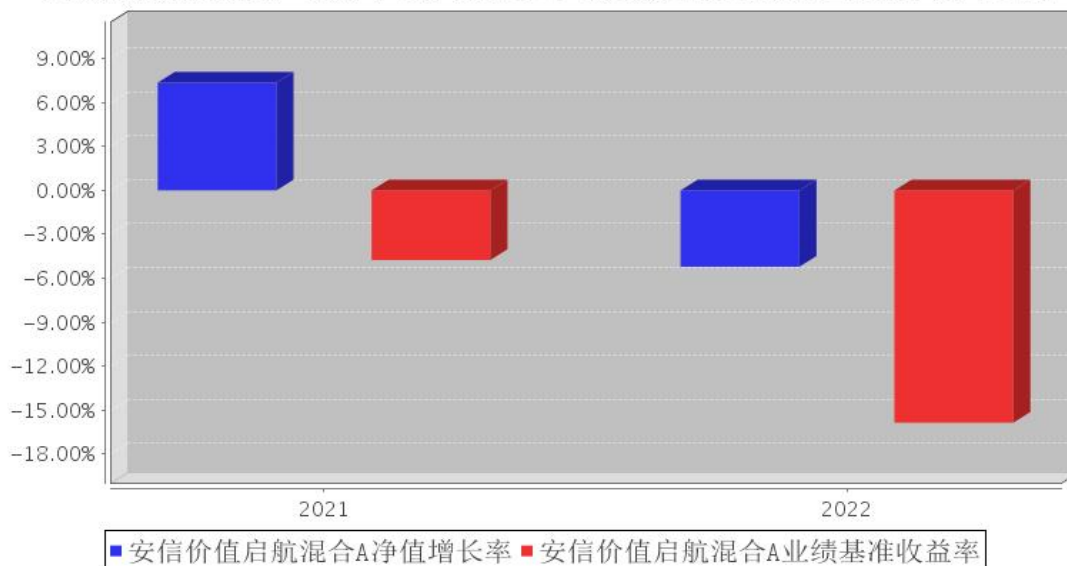


注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 29 日。

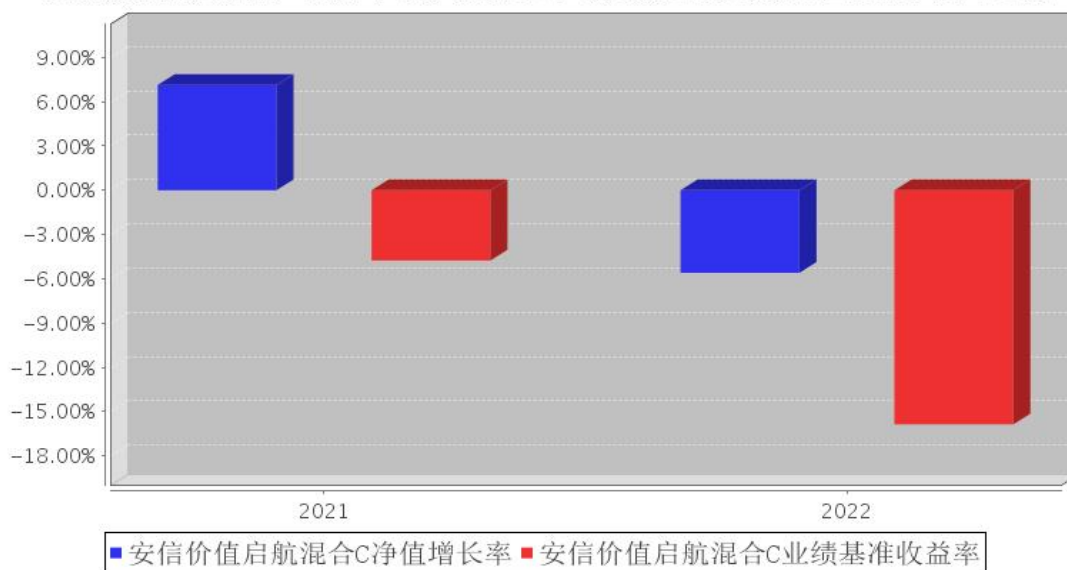
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信价值启航混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信价值启航混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2021年6月29日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 83 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、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。

#### 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		
袁玮	本基金的基金经理	2021 年 6 月 29 日	-	12 年	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券

					投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理的基金经理；现任安信新常态沪港深精选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、安信价值启航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、安信稳健启航一年持有期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”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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。

#### 4.1.3 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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

回顾 2022 年，市场经历了很多困难，市场风格一变再变，最终除了极少数行业外，绝大多数行业都出现较大的下跌。支撑过去几年市场行情的各种因素都发生了比较大的变化。首先，政策重心从过去的调结构转为稳增长。其次，A 股的流动性由强转弱。最后，企业盈利增速在经济与 PPI 下行过程中，在 2021 年高基数的背景下，出现了整体的大幅回落。另外，俄乌战争的爆发，美联储的持续性加息，以及国内疫情防控的严峻形势，对市场各方的信心构成了严重的打击。

尽管我们预期到了 2022 年是比较困难的一年，但我们并没有选择较低的仓位，而是坚持在长期价值判断的基础上，配置了很多与经济稳增长相关的个股，尤其是房地产板块。地产板块整体表现是显著好于市场的，但也经历了较多的波折。一季度，在稳增长政策的刺激下，地产板块逆势上涨，取得了巨大的超额收益，我们也适当地进行了减仓操作。二季度，地产进入了调整期，大盘却出现了强势反弹。主要原因是稳增长的地产政策没有取得市场预期的效果（但符合我们的预期），而汽车刺激政策则很快有了效果，尤其是在上海解封之后。加上货币政策此时出现了进一步的松动，社融重新放量，而且结构上以短融为主，外资也有所回流，因此市场风格大变，前期跌幅大的成长股反弹，前期强势的地产股大幅调整。进入三季度后，随着经济下行的压力越来越大，越来越多的行业都感受到了寒意，市场的信心再次溃散，迅速回吐二季度的涨幅。以地产为代表的传统行业在这轮调整中也未能幸免，甚至率先创出了调整新低。尤其是地产行业风声鹤唳，各种负面新闻不断，债券和股票同时暴跌。在这个过程中，市场总是会在短期过度反应边际变化，股市中很多投资者的博弈心态过重，羊群效应明显，但我们还是坚持认为稳增长的逻辑只是短期的弱化，未来肯定还是主线逻辑。因此三季度当地产创新低的时候，我们没有恐慌，而是选择了较为理性的持仓甚至加仓，并最终收获了四季度的大幅反弹。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信价值启航混合 A 基金份额净值为 1.0176 元，本报告期基金份额净值增长

率为-5.22%；安信价值启航混合 C 基金份额净值为 1.0114 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.60%；同期业绩比较基准收益率为-15.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，我们认为是整装待发的一年。随着第一波疫情的过去，随着防疫政策的不断优化，随着医疗技术的不断进步，随着老百姓的自主防护意识的提升，我们相信疫情对于中国的影响将会越来越小，各种社会活动将恢复正常，各方信心都有明显的提升。但是，我们也不认为 2023 年就是非常轻松的一年，市场也依然会有较大的波动。首先，海外供给恢复的速度是比较快的，而海外对于耐用品的需求是存在下行压力的，因此过去几年支撑中国经济的一股非常重要的力量——外需，存在较大概率的下行压力。其次，尽管疫情不再困扰大家，但各方的长期信心恢复需要一个过程，尤其是眼下大家的资产负债表都不是太理想。地产作为一个支柱产业，当下的销售依然非常低迷。事实上，地产行业可能是需求最先看到底部，供给最先完成出清的行业。反观其它行业，地产端传递过来的需求下行压力可能还没充分显现和被市场反应，同时供给端也远没到出清的状态，甚至很多制造业还在不断的扩大产能，未来都可能面临供求关系的恶化。最后，关于美联储的货币政策，我们认为美国经济软着陆的可能性大，即使美国停止加息也不会很快进入新一轮的货币宽松，这对于美股是有积极影响的，但对 A 股的作用则偏中性。A 股的核心还是在如何激活内需，我们相信，地产政策还会进一步的优化，地产需求或会在 2023 年见到底部。因此，当下我们依然维持稳增长是核心，地产是稳增长的核心观点不变，投资端依然会非常重视这类机会，同时我们也会适当地对组合进行优化，争取做得比过去几年更加地均衡，净值表现更加平稳。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 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，估值委员会成员由权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、混合资产投资部、研究部、固定收益研究部、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：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、混合资产投资部、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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信价值启航混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信价值启航混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的安信价值启航混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信价值启航混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信价值启航混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	安信价值启航混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信价值启航混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,671,140.10	50,144,069.95
结算备付金		2,574,282.97	684,799.76
存出保证金		84,142.12	307,038.62
交易性金融资产	7.4.7.2	369,086,139.51	642,209,377.27
其中：股票投资		369,086,139.51	638,659,398.28
基金投资		-	-
债券投资		-	3,549,978.99
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		12,412.26	8,980,667.99
应收股利		137,148.00	-
应收申购款		30,376.14	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	8,863.14
资产总计		397,595,641.10	702,334,816.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,374,633.23	26.70
应付赎回款		228,765.00	12,598,991.69

应付管理人报酬		523,610.37	909,200.16
应付托管费		87,268.38	151,533.36
应付销售服务费		13,130.51	16,731.71
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	7.4.7.6	522,604.41	678,550.56
负债合计		2,750,011.90	14,355,034.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	388,217,598.79	640,929,400.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	6,628,030.41	47,050,382.35
净资产合计		394,845,629.20	687,979,782.55
负债和净资产总计		397,595,641.10	702,334,816.73

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 388,217,598.79 份，其中安信价值启航混合 A 基金份额总额为 355,388,783.83 份，基金份额净值 1.0176 元；安信价值启航混合 C 基金份额总额为 32,828,814.96 份，基金份额净值 1.0114 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。

## 7.2 利润表

会计主体：安信价值启航混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-16,189,686.32	74,195,251.65
1. 利息收入		168,047.75	789,540.78
其中：存款利息收入	7.4.7.9	168,047.75	309,898.93
债券利息收入		-	56.80
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资		-	479,585.05

产收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,991,636.79	60,647,672.75
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,761,890.88	48,185,729.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	421,035.42	-
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	15,332,492.25	12,461,942.92
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）	7.4.7.16	-27,739,526.41	11,821,832.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	390,155.55	936,205.56
<b>减：二、营业总支出</b>		8,154,120.29	11,050,237.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,632,998.77	6,348,125.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,105,499.78	1,058,020.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	193,937.25	122,096.05
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	221,684.49	3,521,995.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,343,806.61	63,145,014.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,343,806.61	63,145,014.19
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-24,343,806.61	63,145,014.19

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。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信价值启航混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	640,929,400.20	-	47,050,382.35	687,979,782.55
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）	640,929,400.20	-	47,050,382.35	687,979,782.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-252,711,801.41	-	-40,422,351.94	-293,134,153.35
（一）、综合收益总额	-	-	-24,343,806.61	-24,343,806.61
（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）	-252,711,801.41	-	-16,078,545.33	-268,790,346.74
其中：1. 基金申购	285,672,366.18	-	15,381,245.21	301,053,611.39

款				
2. 基金赎回款	-538,384,167.59	-	-31,459,790.54	-569,843,958.13
(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)	388,217,598.79	-	6,628,030.41	394,845,629.20
项目	上年度可比期间			
	2021年6月29日(基金合同生效日)至2021年12月31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)	944,757,915.83	-	-	944,757,915.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-303,828,515.63	-	47,050,382.35	-256,778,133.28
(一)、综	-	-	63,145,014.19	63,145,014.19

合收益总额				
(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)	-303,828,515.63	-	-16,094,631.84	-319,923,147.47
其中：1. 基金申购款	17,686,045.22	-	770,997.71	18,457,042.93
2. 基金赎回款	-321,514,560.85	-	-16,865,629.55	-338,380,190.40
(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)	640,929,400.20	-	47,050,382.35	687,979,782.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信价值启航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”）2019年10月29日下发的证监许可[2019]2131号文“关于准予安信价值启航混合型证券投资基金注册的批复”的核准，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《安信价值启航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。本基金募集期间为2021年6月15日至2021年6月25日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2021)验字第60962175\_H06号验资报告。经向中国证监会备案，《安信价值启航混合型证券投资基金基金合同》于2021年6月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为944,757,915.83份，其中认购资金利息折合228,890.13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，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《安信价值启航混合型证券投资基金基金合同》及《安信价值启航混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、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、赎回时收取赎回费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，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、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信价值启航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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、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（含分离型可转换债券的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、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的相关规定。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，并可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整投资范围。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股指期货合约和国债期货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、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于价值主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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×70%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×25%。

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 6 月 29 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确

定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定

公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分

配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 50,144,069.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,099.53 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 50,151,169.48 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 684,799.76 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,533.78 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 686,333.54 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 307,038.62 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 152.02 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 307,190.64 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,863.14 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 7,099.53 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,533.78 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 152.02 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 77.81 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 642,209,377.27 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 77.81 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 642,209,455.08 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。



上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税

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。

#### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### （4）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。

#### （5）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。

#### （6）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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	25,671,140.10	50,144,069.95
等于：本金	25,668,073.30	50,144,069.95
加：应计利息	3,066.80	-
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	25,671,140.10	50,144,069.95

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	385,003,833.36	-	369,086,139.51	-15,917,693.85
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	385,003,833.36	-	369,086,139.51	-15,917,693.85
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	626,837,565.72	-	638,659,398.28	11,821,832.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,549,978.99	3,549,978.99	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,549,978.99	3,549,978.99	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	630,387,544.71	-	642,209,377.27	11,821,832.56

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	8,863.14
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	8,863.14

注：“应收利息”上年度末所列示的金额为上年末资产负债表中“应收利息”项目的“本期末”余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.59	27.09
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	348,093.82	554,023.47
其中：交易所市场	348,093.82	554,023.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	120,000.00	60,000.00
应付审计费	50,000.00	60,000.00
应付银行间账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	522,604.41	678,550.56

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信价值启航混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	596,339,321.60	596,339,321.60
本期申购	127,953,205.01	127,953,205.01
本期赎回（以“-”号填列）	-368,903,742.78	-368,903,742.78
本期末	355,388,783.83	355,388,783.83

##### 安信价值启航混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,590,078.60	44,590,078.60
本期申购	157,719,161.17	157,719,161.17
本期赎回（以“-”号填列）	-169,480,424.81	-169,480,424.81
本期末	32,828,814.96	32,828,814.96

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信价值启航混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	33,825,087.74	10,042,291.63	43,867,379.37
本期利润	4,220,516.46	-14,023,238.15	-9,802,721.69
本期基金份额交易产生的变动数	-15,147,096.30	-12,664,077.65	-27,811,173.95
其中：基金申购款	14,321,322.54	-8,033,749.02	6,287,573.52
基金赎回款	-29,468,418.84	-4,630,328.63	-34,098,747.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,898,507.90	-16,645,024.17	6,253,483.73

安信价值启航混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,435,470.28	747,532.70	3,183,002.98
本期利润	-824,796.66	-13,716,288.26	-14,541,084.92
本期基金份额交易产生的变动数	298,575.76	11,434,052.86	11,732,628.62
其中：基金申购款	15,497,105.95	-6,403,434.26	9,093,671.69
基金赎回款	-15,198,530.19	17,837,487.12	2,638,956.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,909,249.38	-1,534,702.70	374,546.68

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	127,071.60	250,147.35
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	38,485.28	58,131.15
其他	2,490.87	1,620.43
合计	168,047.75	309,898.93

#### 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,258,470,786.86	1,022,896,234.39
减：卖出股票成本	1,259,625,165.96	974,710,504.56

总额		
减：交易费用	3,607,511.78	-
买卖股票差价收入	-4,761,890.88	48,185,729.83

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	48,477.18	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	372,558.24	-
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	421,035.42	-

##### 7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	33,745,454.85	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,687,026.19	-
减：应计利息总额	685,825.41	-
减：交易费用	45.01	-
买卖债券差价收入	372,558.24	-

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,332,492.25	12,461,942.92
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	15,332,492.25	12,461,942.92

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-27,739,526.41	11,821,832.56
股票投资	-27,739,526.41	11,821,832.56
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	-27,739,526.41	11,821,832.56

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	387,352.26	933,199.86
基金转换费收入	2,803.29	3,005.70



合计	390,155.55	936,205.56
----	------------	------------

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	25,064.83	13,962.17
银行间账户维护费	18,000.00	7,500.00
证券组合费	8,619.66	-
其他	-	400.00
交易费用	-	3,380,132.99
合计	221,684.49	3,521,995.16

#### 7.4.7.20 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至 2021年12月31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	757,298,003.93	33.59	1,803,463,034.71	69.20

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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12月31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	585,941.42	35.32	107,657.40	30.93
关联方名称	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31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	1,298,050.17	69.45	194,183.54	35.05

注：1、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签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类席位租用协议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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月

		31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,632,998.77	6,348,125.32
其中：支付销售机构的客户维护费	2,963,549.58	3,157,104.97

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 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,105,499.78	1,058,020.93

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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C	合计
安信基金	-	34,783.45	34,783.45
安信证券	-	50,830.43	50,830.43
招商银行	-	60,593.62	60,593.62
合计	-	146,207.50	146,207.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C	合计
安信基金	-	360.93	360.93
安信证券	-	61,373.60	61,373.60
招商银行	-	51,810.11	51,810.11
合计	-	113,544.64	113,544.64

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 0.40% 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 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.10.3 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的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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	25,671,140.10	127,071.60	50,144,069.95	250,147.35

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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301121	紫建电子	2022年8月1日	6个月	新股锁定	61.07	49.77	237	14,473.59	11,795.49	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	25.31	486	18,691.56	12,300.66	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股锁定	32.38	31.61	414	13,405.32	13,086.54	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股锁定	3.82	6.01	4,247	16,223.54	25,524.47	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股锁定	71.17	73.04	220	15,657.40	16,068.80	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	69.68	451	15,176.15	31,425.68	-
301265	华新	2022年	6个月	新股锁	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-

	环保	12月8日		定							
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股锁定	32.69	87.94	360	11,768.40	31,658.40		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95		-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股锁定	34.72	23.87	454	15,762.88	10,836.98		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定	119.88	175.78	152	18,221.76	26,718.56		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股锁定	22.50	17.16	918	20,655.00	15,752.88		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	173	16,608.00	14,007.81		-
688252	天德钰	2022年9月20日	6个月	新股锁定	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78		-
688459	哈铁科技	2022年9月28日	6个月	新股锁定	13.58	8.27	16,437	223,214.46	135,933.99		-

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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 2022 年 12 月 31 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（2021 年 12 月 31 日：0.52%）。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	3,549,978.99
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	3,549,978.99

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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。银行存款、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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	25,671,140.10	-	-	-	25,671,140.10
结算备付金	2,574,282.97	-	-	-	2,574,282.97
存出保证金	84,142.12	-	-	-	84,142.12
交易性金融资产	-	-	-369,086,139.51	-	369,086,139.51
应收股利	-	-	-	137,148.00	137,148.00
应收申购款	-	-	-	30,376.14	30,376.14
应收清算款	-	-	-	12,412.26	12,412.26
资产总计	28,329,565.19	-	-369,266,075.91	-	397,595,641.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	228,765.00	228,765.00
应付管理人报酬	-	-	-	523,610.37	523,610.37
应付托管费	-	-	-	87,268.38	87,268.38
应付清算款	-	-	-	1,374,633.23	1,374,633.23
应付销售服务费	-	-	-	13,130.51	13,130.51
其他负债	-	-	-	522,604.41	522,604.41
负债总计	-	-	-	2,750,011.90	2,750,011.90
利率敏感度缺口	28,329,565.19	-	-366,516,064.01	-	394,845,629.20
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	50,144,069.95	-	-	-	50,144,069.95
结算备付金	684,799.76	-	-	-	684,799.76
存出保证金	307,038.62	-	-	-	307,038.62
交易性金融资产	-	-	3,549,978.99	638,659,398.28	642,209,377.27
应收证券清算款	-	-	-	8,980,667.99	8,980,667.99
其他资产	-	-	-	8,863.14	8,863.14
资产总计	51,135,908.33	-	3,549,978.99	647,648,929.41	702,334,816.73
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	12,598,991.69	12,598,991.69
应付管理人报酬	-	-	-	909,200.16	909,200.16
应付托管费	-	-	-	151,533.36	151,533.36
应付证券清算款	-	-	-	26.70	26.70
应付销售服务费	-	-	-	16,731.71	16,731.71
其他负债	-	-	-	678,550.56	678,550.56
负债总计	-	-	-	14,355,034.18	14,355,034.18
利率敏感度缺口	51,135,908.33	-	3,549,978.99	633,293,895.23	687,979,782.55

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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		
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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	52,714.35
2. 市场利率上升 25 个基点	-	-51,848.42	

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-	116,407,192.52	-	116,407,192.52
应收股利	-	137,148.00	-	137,148.00
资产合计	-	116,544,340.52	-	116,544,340.52
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	-	116,544,340.52	-	116,544,340.52
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	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	-	122,942,910.99	-	122,942,910.99
资产合计	-	122,942,910.99	-	122,942,910.99
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	-	122,942,910.99	-	122,942,910.99

#### 7.4.13.4.2.2 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	5,827,217.03	6,147,145.55
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-5,827,217.03	-6,147,145.55	

### 7.4.13.4.3 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证券，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，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股指期货合约和国债期货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、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于价值主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	369,086,139.51	93.48	638,659,398.28	92.83
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	369,086,139.51	93.48	638,659,398.28	92.83

#### 7.4.13.4.3.2 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）

1. 沪深 300 指数上升 5%	14,081,539.52	26,461,374.50
2. 沪深 300 指数下降 5%	-14,081,539.52	-26,461,374.50

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	368,633,417.52	634,797,796.32
第二层次	-	7,411,580.95
第三层次	452,721.99	-
合计	369,086,139.51	642,209,377.27

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	交易性金融资产	合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	541,075.87	541,075.87
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-88,353.88	-88,353.88
其中：计入损益的利得或损失	-	-88,353.88	-88,353.88
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	452,721.99	452,721.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-88,353.88	-88,353.88
项目	上年度可比同期 2021年6月29日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	452,721.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-1.6500	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	369,086,139.51	92.83
	其中：股票	369,086,139.51	92.83
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	28,245,423.07	7.10
8	其他各项资产	264,078.52	0.07
9	合计	397,595,641.10	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 116,407,192.52 元，占净值比例 29.48%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	7,010,144.00	1.78
C	制造业	89,974,204.77	22.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,264,308.00	6.40
E	建筑业	31,236,476.82	7.91
F	批发和零售业	-	-
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	2,081,707.64	0.53
J	金融业	15,663,522.55	3.97
K	房地产业	81,370,012.13	20.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,620.93	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	25,524.47	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,425.68	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	252,678,946.99	63.99

### 8.2.2 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	9,104,743.80	2.31
原材料	-	-
工业	15,242,920.07	3.86
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	27,537,861.55	6.97
信息技术	-	-
通讯业务	8,159,016.52	2.07



公用事业	13,837,306.13	3.50
房地产	42,525,344.45	10.77
合计	116,407,192.52	29.48

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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	601668	中国建筑	5,752,574	31,236,476.82	7.91
2	600048	保利发展	1,993,108	30,155,724.04	7.64
3	600383	金地集团	2,355,405	24,095,793.15	6.10
4	688169	石头科技	89,094	22,073,038.50	5.59
5	00688	中国海外发展	1,146,171	21,091,107.48	5.34
6	000002	万科A	1,118,429	20,355,407.80	5.16
7	601985	中国核电	2,699,114	16,194,684.00	4.10
8	01186	中国铁建	3,654,000	15,242,920.07	3.86
9	02328	中国财险	2,238,000	14,813,614.51	3.75
10	00902	华能国际电力股份	4,198,000	13,837,306.13	3.50
11	000651	格力电器	414,000	13,380,480.00	3.39
12	01109	华润置地	418,000	13,348,580.25	3.38
13	00939	建设银行	2,913,000	12,724,247.04	3.22
14	600585	海螺水泥	438,308	12,000,873.04	3.04
15	01088	中国神华	452,000	9,104,743.80	2.31
15	601088	中国神华	56,100	1,549,482.00	0.39
16	603486	科沃斯	120,500	8,789,270.00	2.23
17	601318	中国平安	177,300	8,333,100.00	2.11
18	00941	中国移动	176,500	8,159,016.52	2.07
19	00960	龙湖集团	372,500	8,085,656.72	2.05
20	002142	宁波银行	225,899	7,330,422.55	1.86
21	001979	招商蛇口	535,478	6,763,087.14	1.71
22	000932	华菱钢铁	1,252,103	5,884,884.10	1.49
23	600900	长江电力	271,600	5,703,600.00	1.44
24	601225	陕西煤业	293,900	5,460,662.00	1.38
25	300760	迈瑞医疗	16,500	5,213,505.00	1.32
26	600801	华新水泥	340,128	5,040,696.96	1.28
27	600782	新钢股份	970,500	3,969,345.00	1.01
28	600461	洪城环境	484,320	3,366,024.00	0.85
29	002179	中航光电	54,200	3,130,592.00	0.79
30	002832	比音勒芬	114,600	2,934,906.00	0.74
31	600741	华域汽车	141,400	2,450,462.00	0.62
32	000333	美的集团	45,600	2,362,080.00	0.60
33	600176	中国巨石	156,400	2,144,244.00	0.54

34	603444	吉比特	6,200	1,939,608.00	0.49
35	301367	怡和嘉业	1,514	325,772.90	0.08
36	688459	哈铁科技	16,437	135,933.99	0.03
37	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.02
38	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
39	301269	华大九天	360	31,658.40	0.01
40	301239	普瑞眼科	451	31,425.68	0.01
41	301175	中科环保	4,247	25,524.47	0.01
42	301195	北路智控	220	16,068.80	0.00
43	301389	隆扬电子	918	15,752.88	0.00
44	301391	卡莱特	173	14,007.81	0.00
45	301165	锐捷网络	414	13,086.54	0.00
46	301139	元道通信	486	12,300.66	0.00
47	301121	紫建电子	237	11,795.49	0.00
48	301365	矩阵股份	454	10,836.98	0.00
49	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
50	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
51	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600383	金地集团	86,057,607.69	12.51
2	600048	保利发展	70,452,803.00	10.24
3	688169	石头科技	63,733,490.54	9.26
4	01109	华润置地	46,130,526.74	6.71
5	000002	万科 A	41,048,956.93	5.97
6	00960	龙湖集团	36,670,440.88	5.33
7	601985	中国核电	34,934,308.56	5.08
8	001979	招商蛇口	33,478,592.98	4.87
9	00688	中国海外发展	32,466,318.51	4.72
10	601225	陕西煤业	28,525,414.00	4.15
11	000651	格力电器	25,348,736.47	3.68
12	603486	科沃斯	24,299,809.00	3.53
13	02328	中国财险	21,074,749.80	3.06
14	01088	中国神华	20,592,011.28	2.99
15	01999	敏华控股	20,420,998.77	2.97
16	00902	华能国际电力股份	19,179,651.66	2.79
17	600782	新钢股份	18,173,314.00	2.64
18	300059	东方财富	17,324,025.54	2.52

19	03690	美团-W	17,228,283.30	2.50
20	01186	中国铁建	16,165,656.70	2.35
21	00939	建设银行	15,860,241.90	2.31
22	601668	中国建筑	15,433,667.00	2.24
23	002648	卫星化学	14,927,210.00	2.17
24	601318	中国平安	13,936,807.00	2.03

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600383	金地集团	112,459,587.11	16.35
2	600048	保利发展	99,770,042.60	14.50
3	00688	中国海外发展	62,974,890.95	9.15
4	001979	招商蛇口	53,070,246.23	7.71
5	601225	陕西煤业	46,640,763.94	6.78
6	000002	万科 A	46,080,296.76	6.70
7	00960	龙湖集团	42,953,031.08	6.24
8	601668	中国建筑	35,526,981.90	5.16
9	01109	华润置地	34,544,329.33	5.02
10	01999	敏华控股	29,024,962.42	4.22
11	00884	旭辉控股集团	27,612,743.29	4.01
12	688169	石头科技	27,521,887.74	4.00
13	601166	兴业银行	25,454,853.00	3.70
14	601088	中国神华	25,274,632.00	3.67
15	601985	中国核电	24,338,343.30	3.54
16	002078	太阳纸业	21,855,977.12	3.18
17	600176	中国巨石	20,302,491.86	2.95
18	000333	美的集团	19,825,507.00	2.88
19	600031	三一重工	19,513,113.00	2.84
20	03690	美团-W	18,149,171.46	2.64
21	600461	洪城环境	18,008,034.00	2.62
22	000786	北新建材	17,921,226.00	2.60
23	300059	东方财富	17,785,693.00	2.59
24	002142	宁波银行	17,754,088.80	2.58
25	601939	建设银行	17,500,436.00	2.54
26	00939	建设银行	16,692,754.85	2.43
27	002230	科大讯飞	16,450,289.00	2.39
28	002415	海康威视	15,260,047.88	2.22
29	000932	华菱钢铁	14,487,953.00	2.11
30	002648	卫星化学	14,337,025.99	2.08

31	601318	中国平安	14,225,156.00	2.07
32	002867	周大生	13,937,001.30	2.03

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。

#### 8.4.3 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	1,017,791,433.60
卖出股票收入（成交）总额	1,258,470,786.86

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，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管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

### 8.11.2 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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中国建筑（代码：601668 SH）、中国铁建（代码：01186 HG）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. 中国建筑股份有限公司

2022 年 1 月-8 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被福建省住房和城乡建设厅、昆明市水务局、重庆市住房和城乡建设委员会罚款；因环境污染被江阴市住房和城乡建设局罚款；因欠税、未依法履行职责被国家税务总局佛山市南海区税务局责令改正。

2022 年 9 月-12 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佛山市南海区税务局、国家税务总局上海市嘉定区税务局第十五税务所、国家税务总局广州市白云区税务局石井税务所通知整改。

##### 2. 中国铁建股份有限公司

2022 年 6 月 17 日，中国铁建股份有限公司因未依法履行职责被福建省住房和城乡建设厅处以行政处罚。

2022 年 6 月 30 日，中国铁建股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所通知整改。

2022 年 12 月 27 日，中国铁建股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市白云区税务局钟落潭税务所通知整改。

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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	84,142.12
2	应收清算款	12,412.26

3	应收股利	137,148.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,376.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	264,078.52

#### 8.12.4 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债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
安信价值 启航混合 A	4,741	74,960.72	93,344,065.15	26.27	262,044,718.68	73.73
安信价值 启航混合 C	1,477	22,226.69	8,581,344.11	26.14	24,247,470.85	73.86
合计	6,071	63,946.24	101,925,409.26	26.25	286,292,189.53	73.75

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）。

### 9.2 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	安信价值启航混合 A	788,902.99	0.22
	安信价值启航混合 C	193,736.84	0.59
	合计	982,639.83	0.25

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）。

### 9.3 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	安信价值启航混合 A	0~10
	安信价值启航混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信价值启航混合 A	50~100
	安信价值启航混合 C	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信价值启航混合 A	安信价值启航混合 C
基金合同生效日 （2021年6月29日） 基金份额总额	874,418,170.90	70,339,744.93
本报告期期初基金份额总额	596,339,321.60	44,590,078.60
本报告期基金总申购份额	127,953,205.01	157,719,161.17
减：本报告期基金总赎回份额	368,903,742.78	169,480,424.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	355,388,783.83	32,828,814.96

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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

本报告期内本基金的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

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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。本年度应支付的审计费为人民币 50,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	963,782,122.11	42.75	687,992.17	41.47	-
安信证券	2	757,298,003.93	33.59	585,941.42	35.32	-
东方证券	2	533,594,261.33	23.67	384,885.48	23.20	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
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。

### 11.7.2 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	33,647,182.80	70.21	-	-	-	-
安信证券	10,577,688.20	22.07	-	-	-	-
东方证券	3,700,148.00	7.72	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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关于旗下部分开放式基金新增国联证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2022-01-07
3	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
4	安信基金管理有限责任公司关于 2022 年春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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-24
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下	中国证券报、证券日报、	2022-01-26

	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	证券时报、上海证券报	
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众惠基金销售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	2022-02-16
7	安信基金管理有限责任公司关于 2022 年清明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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-03-29
8	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	2022-03-30
9	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
10	安信基金管理有限责任公司关于 2022 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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-13
11	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
12	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
13	安信基金管理有限责任公司关于 2022 年劳动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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-26
14	安信基金管理有限责任公司关于 2022 年香港佛诞翌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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-05-05
15	安信基金管理有限责任公司关于 2022 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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-06-29
16	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	2022-07-20
17	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、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-08-11
18	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-08-30
19	安信基金管理有限责任公司关于 2022	中国证券报、证券日报、	2022-09-27

	年国庆节、香港重阳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	证券时报、上海证券报	
20	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年第 3 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	2022-10-25
21	关于安信基金管理有限责任公司上海分公司营业场所变更的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-12-13
22	安信基金管理有限责任公司关于 2022 年香港圣诞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	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-12-22

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信价值启航混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信价值启航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信价值启航混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信价值启航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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 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

2023 年 3 月 30 日