

安信聚利增强债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	9
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	14
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
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51

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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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
§ 12 备查文件目录	59
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	安信聚利增强债券型证券投资基金		
基金简称	安信聚利增强债券		
基金主代码	006839		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 4 月 15 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	52,688,236.81 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C
下属分级基金的交 易代码	006839	010053	006840
报告期末下属分级 基金的份额总额	7,583,055.96 份	0.00 份	45,105,180.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金所定义的增强是指在积极的债券配置基础上，进行适当的股票投资以增强基金获利能力，动态调节债券和股票的配置比例，采用类 CPPI 策略控制回撤，力争超越本基金的业绩比较基准中债总指数（全价）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。债券配置方面，通过上下结合的宏观和微观研究，动态调整债券资产的久期、信用等级配比，采取多种灵活的策略（主要包括骑乘策略、回购策略等），进行积极的债券配置，力争超越中债总指数（全价）收益率。股票配置方面，将以成份股在基准指数中的基准权重为基础，进行超配或低配，并通过深入研究基本面精选个股，同时在有效控制风险及交易成本最低化的基础上建立投资组合，力求超越沪深 300 指数收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*80%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

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	张姗
	联系电话	0755-82509999	0755-83077987

电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C
本期已实现收益	122,124.18	-	254,776.02
本期利润	135,375.32	-	721,965.29
加权平均基金份额本期利润	0.0158	-	0.0341
本期加权平均净值利润率	1.46%	-	3.17%
本期基金份额净值增长率	1.11%	1.11%	1.02%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		

和指标			
期末可供分配利润	510,806.41	-	2,626,165.94
期末可供分配基金份额利润	0.0674	-	0.0582
期末基金资产净值	8,124,672.92	-	47,918,992.56
期末基金份额净值	1.0714	1.0714	1.0624
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	7.14%	-0.74%	6.24%

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。

4、根据基金管理人 2020 年 9 月 18 日《关于安信聚利增强债券型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 9 月 18 日起，本基金增加 B 类份额。截至本报告期末，无 B 类份额，B 类份额净值参考 A 类份额净值披露，净值增长率数据参照 A 类份额计算。

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

安信聚利增强债券 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	0.63%	0.36%	0.47%	0.17%	0.16%	0.19%
过去三个月	-1.98%	0.38%	-0.20%	0.16%	-1.78%	0.22%
过去六个月	1.11%	0.31%	0.61%	0.16%	0.50%	0.15%
过去一年	-1.68%	0.28%	-1.80%	0.19%	0.12%	0.09%
过去三年	-0.76%	0.38%	1.11%	0.24%	-1.87%	0.14%
自基金合同生效起	7.14%	0.33%	4.75%	0.24%	2.39%	0.09%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

安信聚利增强债券 B

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	0.63%	0.36%	0.47%	0.17%	0.16%	0.19%
过去三个月	-1.98%	0.38%	-0.20%	0.16%	-1.78%	0.22%
过去六个月	1.11%	0.31%	0.61%	0.16%	0.50%	0.15%
过去一年	-1.68%	0.28%	-1.80%	0.19%	0.12%	0.09%
自基金合同生效起 至今	-0.74%	0.38%	-0.06%	0.23%	-0.68%	0.15%

安信聚利增强债券 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	0.62%	0.36%	0.47%	0.17%	0.15%	0.19%
过去三个月	-2.02%	0.38%	-0.20%	0.16%	-1.82%	0.22%
过去六个月	1.02%	0.31%	0.61%	0.16%	0.41%	0.15%
过去一年	-1.87%	0.28%	-1.80%	0.19%	-0.07%	0.09%
过去三年	-1.36%	0.38%	1.11%	0.24%	-2.47%	0.14%
自基金合同生效起 至今	6.24%	0.33%	4.75%	0.24%	1.49%	0.09%

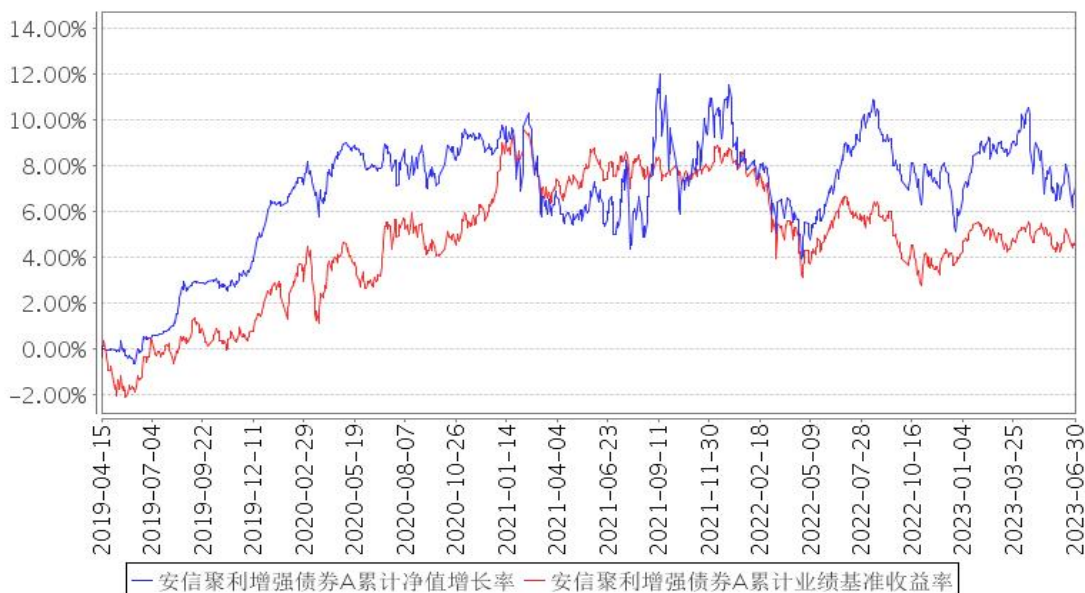
注：1、根据《安信聚利增强债券型证券投资基金》的约定，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*80%。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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 20%、80%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。

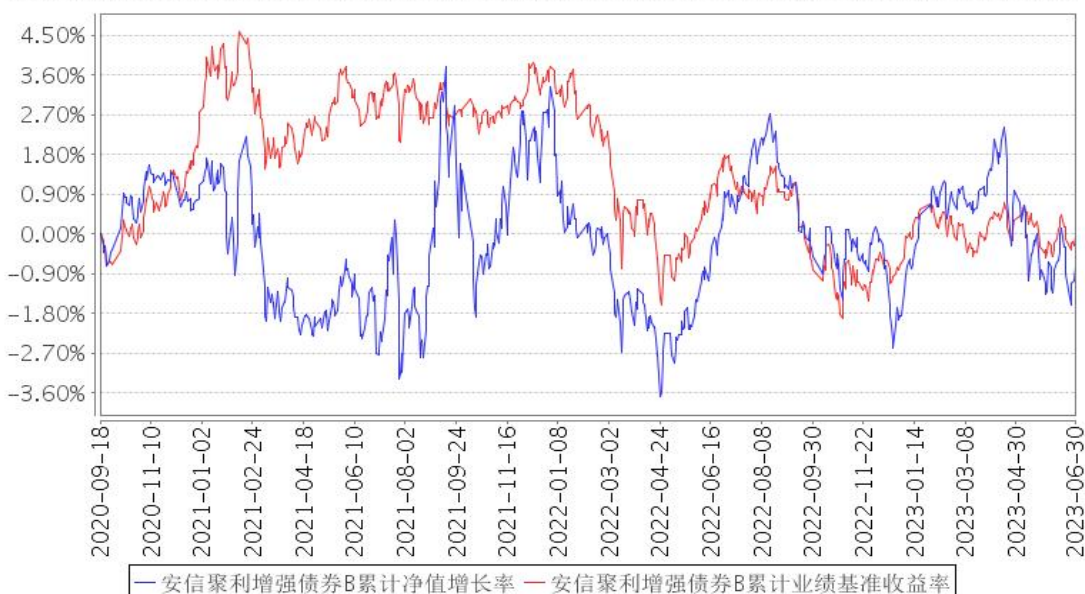
2、报告期内无 B 类份额时，净值增长率数据参照 A 类份额计算。

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

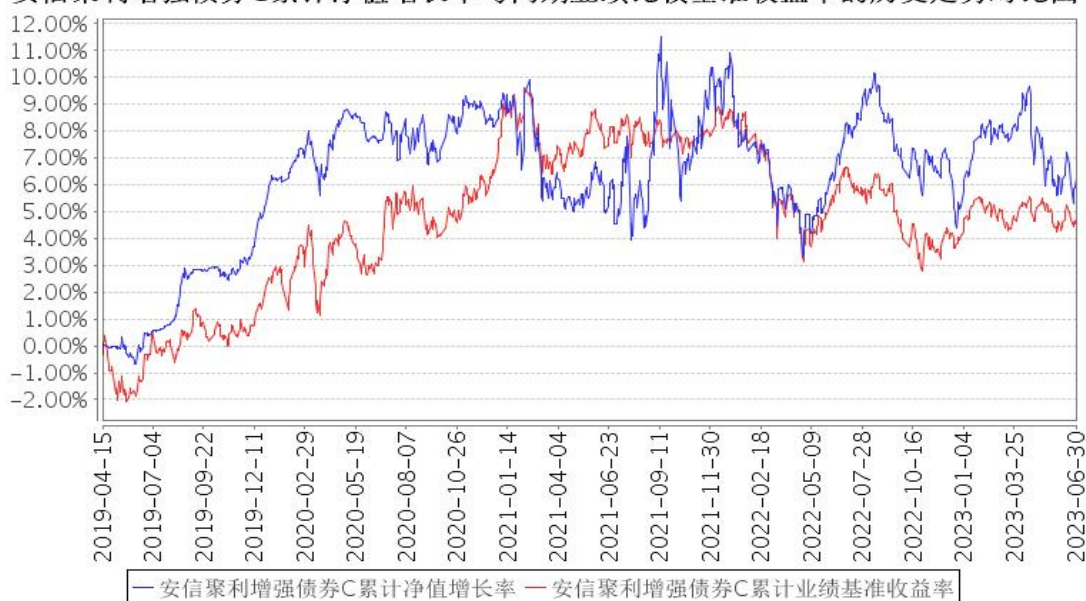
安信聚利增强债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信聚利增强债券B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



安信聚利增强债券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. 本基金合同生效日为 2019 年 4 月 15 日。

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

3、根据基金管理人 2020 年 9 月 18 日《关于安信聚利增强债券型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 9 月 18 日起，本基金增加 B 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路

主题指数分级证券投资基金)、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金(原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金)、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金(LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信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、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金。

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		
梁冰哲	本基金的基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	7 年	梁冰哲先生，理学硕士。曾任德勤华永会计师事务所审计部审计员，安信基金管理有限责任公司固定收益研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信新价值灵活配置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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
王涛	本基金的基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	20 年	王涛先生，经济学硕士，CFA、FRM。历任中国工商银行股份有限公司深圳分行资金运营部交易员、招商银行股份有限公司金融市场部交易员、东莞证券有限责任公司深圳分公司投资经理、融通基金管理有限公司基金经理、安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利率债债券型证券投资基金、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、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

施荣盛	本基金的基金经理	2022 年 10 月 10 日	-	10 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任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）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信聚利增强债券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

年初以来，随着新冠疫情对于经济的影响逐渐褪去，我国经济呈现出稳中向好、逐步恢复的态势。春节之后，从航空、铁路等客流量、餐饮消费、观影人数、工业品开工率等各种指标来看，我国经济在春节之后进入了复苏区间。彼时市场参与者普遍对于经济复苏的节奏和力度比较乐观，市场呈现“股强债弱”的特征。3月之后，实体经济的复苏节奏有所放缓，市场参与者讨论较多的是“强预期”逐步演变为“弱预期”的问题，市场参与者对经济的乐观情绪有所降温，债券市场表现强于股票市场。

股票市场方面，上半年上证指数上涨 3.65%，其中受到 ChatGPT 产业景气度预期持续上行的影响，传媒、计算机等行业录得较大涨幅。受益于整体利率下行的影响，高股息板块表现也相对较好；商贸零售、美容护理、地产、建材等板块表现相对较差。债券市场整体表现较好，10 年国债收益率由 2.86% 下行至 2.63% 左右，信用债也录得较好收益。

股票方面的配置，首先通过逆向投资策略合理增减权益仓位，力争在控制回撤的基础上，获得尽可能高的有效权益仓位的收益。其次在个股选择方面采用量化投资方法，基于对股票市场和上市公司相关数据进行深度挖掘，使用机器学习等量化模型构建股票组合。

债券方面的配置也呈现“哑铃型”结构，一方面持有短久期利率债，另一方面也持有中长久期利率债以获得更好的长期回报，还可降低组合波动水平。转债方面，组合维持低价高弹的配置策略，重点寻找具有较高成长性且价格较低的转债品种，在有价格保护的情况下为组合提供更大的向上弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信聚利增强债券 A 基金份额净值为 1.0714 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%；安信聚利增强债券 B 基金份额净值为 1.0714 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%；安信聚利增强债券 C 基金份额净值为 1.0624 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.02%；同期业绩比较基准收益率为 0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为我国经济仍将呈现复苏势头，稳中向好的态势没有发生改变。对于当下经济复苏进程的放缓，我们认为需要辩证地看待。首先，欧美等国家前期过度消费导致耐用库存水平较高，制约全球外贸水平。日本、韩国、东南亚等外向型经济体的出口增速均明显下行。其次，疫情之后，居民、企业等经济参与者的信心都有一个持续修复的过程，中间有所反复是正常的。考虑到经济内生动能的改善和海外需求的逐步企稳，我们对下半年的经济增长仍然

保持信心。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间范围为 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 3 月 6 日、2023 年 4 月 7 日至 2023 年 6 月 27 日。

§ 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：安信聚利增强债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,901,885.84	972,289.73
结算备付金		198,461.62	308,120.68
存出保证金		10,173.08	7,692.58
交易性金融资产	6.4.7.2	57,572,344.71	39,960,461.83
其中：股票投资		11,207,880.39	7,527,413.12
基金投资		-	-
债券投资		46,364,464.32	32,433,048.71
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		69.60	158.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		69,682,934.85	41,248,723.70
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,462,502.28	2,499,113.68
应付清算款		11,619,591.65	502,497.37
应付赎回款		487,047.82	1.95
应付管理人报酬		15,179.19	27,412.60
应付托管费		4,336.92	7,832.15
应付销售服务费		2,921.07	5,578.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		142.83	84.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	47,547.61	64,966.87
负债合计		13,639,269.37	3,107,487.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	52,688,236.81	36,191,727.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,355,428.67	1,949,507.99
净资产合计		56,043,665.48	38,141,235.77
负债和净资产总计		69,682,934.85	41,248,723.70

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 52,688,236.81 份，其中安信聚利增强债券 A 基金份额总额 7,583,055.96 份，基金份额净值 1.0714 元；安信聚利增强债券 B 基金份额总额 0.00 份，基金份额净值 1.0714 元；安信聚利增强债券 C 基金份额总额 45,105,180.85 份，基金份额净值 1.0624 元。

6.2 利润表

会计主体：安信聚利增强债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,078,481.48	-756,021.47
1. 利息收入		6,175.70	8,874.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,696.22	5,574.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,479.48	3,299.93
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		591,848.83	574,972.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	79,377.01	-527,885.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	454,641.03	1,030,766.72
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	57,830.79	72,091.13
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	480,440.41	-1,342,709.77
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	16.54	2,841.79
减：二、营业总支出		221,140.87	306,038.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	110,629.42	173,526.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,608.43	49,578.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,391.76	35,834.73
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		30,729.36	22,380.50
其中：卖出回购金融资产支出		30,729.36	22,380.50
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		71.96	175.39
8. 其他费用	6.4.7.19	25,709.94	24,542.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		857,340.61	-1,062,059.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		857,340.61	-1,062,059.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		857,340.61	-1,062,059.91

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信聚利增强债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	36,191,727.78	-	1,949,507.99	38,141,235.77
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）	36,191,727.78	-	1,949,507.99	38,141,235.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,496,509.03	-	1,405,920.68	17,902,429.71
（一）、综合收益总额	-	-	857,340.61	857,340.61
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	16,496,509.03	-	548,580.07	17,045,089.10

“-”号填列)				
其中：1. 基金 申购款	54,347,189.37	-	3,757,475.95	58,104,665.32
2. 基金 赎回款	-37,850,680.34	-	-3,208,895.88	-41,059,576.22
(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)	52,688,236.81	-	3,355,428.67	56,043,665.48
项目	上年度可比期间 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)	39,973,918.23	-	4,453,529.57	44,427,447.80
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)	39,973,918.23	-	4,453,529.57	44,427,447.80
三、本期增减 变动额(减少 以“-”号填列)	5,464,074.29	-	-616,094.49	4,847,979.80
(一)、综合收 益总额	-	-	-1,062,059.91	-1,062,059.91
(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)	5,464,074.29	-	445,965.42	5,910,039.71

其中：1. 基金申购款	19,179,823.36	-	1,258,758.59	20,438,581.95
2. 基金赎回款	-13,715,749.07	-	-812,793.17	-14,528,542.24
(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）	45,437,992.52	-	3,837,435.08	49,275,427.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信聚利增强债券型证券投资基金（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”）于 2018 年 7 月 13 日下发的证监许可[2018]1123 号文“关于准予安信聚利增强债券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《安信聚利增强债券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 2019 年 1 月 11 日至 2019 年 4 月 10 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（2019）验字 60962175_H03 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信聚利增强债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 4 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,085,627.87 份，其中认购资金利息折合 23,529.98 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。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2020 年 9 月 18 日发布的《关于安信

聚利增强债券型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》以及更新的《安信聚利增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本基金自 2020 年 9 月 18 日起增加 B 类份额。本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中提取销售服务费的基金份额称为 A 类、B 类份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取认购/申购费用的基金份额称为 C 类份额。本基金 A 类份额、B 类份额和 C 类份额分别设置代码，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《安信聚利增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、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、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、同业存单、其他货币市场工具等，股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除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，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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。

6.4.7 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	11,901,885.84
等于：本金	11,901,361.71
加：应计利息	524.13
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	11,901,885.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,451,818.45	-	11,207,880.39	-243,938.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	46,212,106.52	164,724.36	46,364,464.32	-12,366.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,212,106.52	164,724.36	46,364,464.32	-12,366.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		57,663,924.97	164,724.36	57,572,344.71	-256,304.62

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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 2023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	33,288.21
其中：交易所市场	33,025.71
银行间市场	262.50
应付利息	-
应付审计费	4,959.40
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	47,547.61

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信聚利增强债券 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	9,990,618.77	9,990,618.77
本期申购	40,288.46	40,288.46
本期赎回（以“-”号填列）	-2,447,851.27	-2,447,851.27
本期末	7,583,055.96	7,583,055.96

安信聚利增强债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,201,109.01	26,201,109.01
本期申购	54,306,900.91	54,306,900.91
本期赎回（以“-”号填列）	-35,402,829.07	-35,402,829.07
本期末	45,105,180.85	45,105,180.85

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

安信聚利增强债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	538,176.36	57,120.30	595,296.66
本期利润	122,124.18	13,251.14	135,375.32
本期基金份额交易产生的变动数	-149,494.13	-39,560.89	-189,055.02
其中：基金申购款	2,615.49	853.28	3,468.77
基金赎回款	-152,109.62	-40,414.17	-192,523.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	510,806.41	30,810.55	541,616.96

安信聚利增强债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,202,570.02	151,641.31	1,354,211.33
本期利润	254,776.02	467,189.27	721,965.29
本期基金份额交易产生的变动数	1,168,819.90	-431,184.81	737,635.09
其中：基金申购款	3,080,091.04	673,916.14	3,754,007.18
基金赎回款	-1,911,271.14	-1,105,100.95	-3,016,372.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,626,165.94	187,645.77	2,813,811.71

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,634.37
其他	81.54
合计	4,696.22

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	45,525,375.94
减：卖出股票成本总额	45,324,967.54
减：交易费用	121,031.39
买卖股票差价收入	79,377.01

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	198,303.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	256,337.85
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	454,641.03

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,323,609.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,443,908.39
减：应计利息总额	616,964.52
减：交易费用	6,398.29
买卖债券差价收入	256,337.85

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	57,830.79
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	57,830.79

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	480,440.41
股票投资	153,339.25
债券投资	327,101.16
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	480,440.41

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15.80
基金转换费收入	0.74
合计	16.54

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,150.54
银行间账户维护费	18,600.00
合计	25,709.94

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

截至本财务报表批准报出日，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

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	110,629.42	173,526.19
其中：支付销售机构的客户维护费	23,112.71	32,419.64

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	31,608.43	49,578.95

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 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	安信聚利增强债券	安信聚利增强债券	安信聚利增强债券	合计
	A	B	C	

安信基金	-	-	15,886.93	15,886.93
安信证券	-	-	57.31	57.31
招商银行	-	-	979.85	979.85
合计	-	-	16,924.09	16,924.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	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			
	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C	合计
安信基金	-	-	30,636.93	30,636.93
安信证券	-	-	56.86	56.86
招商银行	-	-	4,683.90	4,683.90
合计	-	-	35,377.69	35,377.69

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类、B 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 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期内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自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

安信聚利增强债券 C

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
安信乾盛 财富管理 (深圳)有 限公司	13,776,052.39	26.15	13,776,052.39	38.06

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	11,901,885.84	2,980.31	1,017,964.96	4,351.73

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（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金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 1,462,502.28 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

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 2023 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 71.67%（2022 年 12 月 31 日：19.40%）。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,145,495.40	21,483,425.89
合计	4,145,495.40	21,483,425.89

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	10,617,642.98	2,145,592.42
AAA 以下	29,546,642.10	5,255,027.71
未评级	2,054,683.84	3,549,002.69
合计	42,218,968.92	10,949,622.82

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	11,901,885.84	-	-	-	11,901,885.84
结算备付金	198,461.62	-	-	-	198,461.62
存出保证金	10,173.08	-	-	-	10,173.08
交易性金融资产	7,372,239.41	27,005,643.10	11,986,581.81	11,207,880.39	57,572,344.71
应收申购款	-	-	-	69.60	69.60
资产总计	19,482,759.95	27,005,643.10	11,986,581.81	11,207,949.99	69,682,934.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	487,047.82	487,047.82
应付管理人报酬	-	-	-	15,179.19	15,179.19
应付托管费	-	-	-	4,336.92	4,336.92
应付清算款	-	-	-	11,619,591.65	11,619,591.65
卖出回购金融资产款	1,462,502.28	-	-	-	1,462,502.28
应付销售服务费	-	-	-	2,921.07	2,921.07
应交税费	-	-	-	142.83	142.83
其他负债	-	-	-	47,547.61	47,547.61
负债总计	1,462,502.28	-	-	12,176,767.09	13,639,269.37
利率敏感度缺口	18,020,257.67	27,005,643.10	11,986,581.81	-968,817.10	56,043,665.48
上年度末 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	972,289.73	-	-	-	972,289.73
结算备付金	308,120.68	-	-	-	308,120.68
存出保证金	7,692.58	-	-	-	7,692.58
交易性金融资产	24,562,692.47	4,317,078.83	3,553,277.41	7,527,413.12	39,960,461.83
应收申购款	-	-	-	158.88	158.88
资产总计	25,850,795.46	4,317,078.83	3,553,277.41	7,527,572.00	41,248,723.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	1.95	1.95
应付管理人报酬	-	-	-	27,412.60	27,412.60
应付托管费	-	-	-	7,832.15	7,832.15
应付清算款	-	-	-	502,497.37	502,497.37
卖出回购金融资产款	2,499,113.68	-	-	-	2,499,113.68
应付销售服务费	-	-	-	5,578.52	5,578.52

应交税费	-	-	-	84.79	84.79
其他负债	-	-	-	64,966.87	64,966.87
负债总计	2,499,113.68	-	-	608,374.25	3,107,487.93
利率敏感度缺口	23,351,681.78	4,317,078.83	3,553,277.41	6,919,197.75	38,141,235.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25个基点	430,436.44	126,606.38
	2. 市场利率上升 25个基点	-424,287.63	-124,829.76

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除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，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	11,207,880.39	20.00	7,527,413.12	19.74
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	11,207,880.39	20.00	7,527,413.12	19.74

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	508,983.81	327,936.09
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-508,983.81	-327,936.09

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	51,372,165.47	14,928,033.25
第二层次	6,200,179.24	25,032,428.58
第三层次	-	-
合计	57,572,344.71	39,960,461.83

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,207,880.39	16.08
	其中：股票	11,207,880.39	16.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,364,464.32	66.54

	其中：债券	46,364,464.32	66.54
	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	12,100,347.46	17.36
8	其他各项资产	10,242.68	0.01
9	合计	69,682,934.85	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	17,920.00	0.03
B	采矿业	409,531.00	0.73
C	制造业	6,451,537.11	11.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	246,185.00	0.44
E	建筑业	262,636.00	0.47
F	批发和零售业	208,844.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	488,065.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	836,653.38	1.49
J	金融业	1,671,002.00	2.98
K	房地产业	117,551.00	0.21
L	租赁和商务服务业	141,009.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	153,880.40	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	19,261.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,463.50	0.09
R	文化、体育和娱乐业	132,342.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	11,207,880.39	20.00

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	601318	中国平安	3,800	176,320.00	0.31
2	300750	宁德时代	740	169,304.60	0.30
3	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.30
4	000858	五粮液	800	130,856.00	0.23
5	601988	中国银行	28,100	109,871.00	0.20
6	601899	紫金矿业	9,200	104,604.00	0.19
7	002415	海康威视	3,100	102,641.00	0.18
8	601166	兴业银行	6,400	100,160.00	0.18
9	601816	京沪高铁	17,300	90,998.00	0.16
10	000333	美的集团	1,500	88,380.00	0.16
11	600309	万华化学	1,000	87,840.00	0.16
12	600276	恒瑞医药	1,800	86,220.00	0.15
13	601333	广深铁路	21,000	83,160.00	0.15
14	601012	隆基绿能	2,900	83,143.00	0.15
15	300146	汤臣倍健	3,300	79,134.00	0.14
16	600030	中信证券	4,000	79,120.00	0.14
17	601939	建设银行	12,500	78,250.00	0.14
18	688282	理工导航	1,358	78,152.90	0.14
19	601888	中国中免	700	77,371.00	0.14
20	601398	工商银行	16,000	77,120.00	0.14
21	600809	山西汾酒	400	74,028.00	0.13
22	000651	格力电器	2,000	73,020.00	0.13
23	002568	百润股份	2,000	72,700.00	0.13
24	600166	福田汽车	20,800	70,720.00	0.13
25	601211	国泰君安	5,000	69,950.00	0.12
26	000630	铜陵有色	24,100	69,649.00	0.12
27	002056	横店东磁	3,800	69,198.00	0.12
28	600563	法拉电子	500	68,650.00	0.12
29	300122	智飞生物	1,550	68,510.00	0.12
30	300059	东方财富	4,820	68,444.00	0.12
31	000629	钒钛股份	17,400	68,034.00	0.12
32	688009	中国通号	11,573	67,123.40	0.12
33	300628	亿联网络	1,900	66,633.00	0.12
34	600027	华电国际	9,800	65,562.00	0.12
35	300115	长盈精密	5,500	65,505.00	0.12
36	600637	东方明珠	8,300	64,906.00	0.12
37	000157	中联重科	9,600	64,800.00	0.12
38	002739	万达电影	5,100	63,954.00	0.11
39	688385	复旦微电	1,273	63,777.30	0.11
40	600369	西南证券	17,400	63,510.00	0.11

41	603712	七一二	2,100	63,441.00	0.11
42	603225	新凤鸣	5,700	62,985.00	0.11
43	000623	吉林敖东	3,900	62,556.00	0.11
44	002867	周大生	3,500	62,230.00	0.11
45	688772	珠海冠宇	3,086	62,182.90	0.11
46	688579	山大地纬	3,756	61,898.88	0.11
47	600827	百联股份	4,600	61,502.00	0.11
48	601233	桐昆股份	4,600	60,950.00	0.11
49	002273	水晶光电	5,000	59,700.00	0.11
50	002384	东山精密	2,300	59,570.00	0.11
51	300677	英科医疗	2,700	59,400.00	0.11
52	002236	大华股份	3,000	59,250.00	0.11
53	300693	盛弘股份	1,600	59,072.00	0.11
54	603885	吉祥航空	3,800	58,634.00	0.10
55	600436	片仔癀	200	57,272.00	0.10
56	688777	中控技术	912	57,255.36	0.10
57	300357	我武生物	1,700	57,171.00	0.10
58	603688	石英股份	500	56,920.00	0.10
59	300724	捷佳伟创	500	56,175.00	0.10
60	688006	杭可科技	1,834	55,881.98	0.10
61	002351	漫步者	2,700	55,836.00	0.10
62	688690	纳微科技	1,425	55,361.25	0.10
63	601111	中国国航	6,700	55,208.00	0.10
64	601225	陕西煤业	3,000	54,570.00	0.10
65	300751	迈为股份	320	54,201.60	0.10
66	600885	宏发股份	1,700	54,145.00	0.10
67	601766	中国中车	8,100	52,650.00	0.09
68	300699	光威复材	1,700	52,445.00	0.09
69	002050	三花智控	1,700	51,442.00	0.09
70	300124	汇川技术	800	51,368.00	0.09
71	601668	中国建筑	8,900	51,086.00	0.09
72	601658	邮储银行	10,300	50,367.00	0.09
73	600029	南方航空	8,300	50,049.00	0.09
74	000338	潍柴动力	4,000	49,840.00	0.09
75	002080	中材科技	2,400	49,248.00	0.09
76	600642	申能股份	7,000	48,930.00	0.09
77	688390	固德威	292	48,723.12	0.09
78	000166	申万宏源	10,400	48,048.00	0.09
78	002797	第一创业	8,400	48,048.00	0.09
79	601618	中国中冶	12,100	48,037.00	0.09
80	002439	启明星辰	1,600	47,616.00	0.08
81	601717	郑煤机	3,800	47,310.00	0.08
82	002624	完美世界	2,800	47,292.00	0.08

83	600153	建发股份	4,300	46,913.00	0.08
84	002049	紫光国微	500	46,625.00	0.08
85	601288	农业银行	13,200	46,596.00	0.08
86	300682	朗新科技	2,000	46,560.00	0.08
87	603993	洛阳钼业	8,700	46,371.00	0.08
88	600028	中国石化	7,200	45,792.00	0.08
89	002508	老板电器	1,800	45,522.00	0.08
90	600859	王府井	2,300	45,517.00	0.08
91	002736	国信证券	5,200	45,396.00	0.08
92	600325	华发股份	4,600	45,310.00	0.08
93	600329	达仁堂	1,000	44,890.00	0.08
94	000725	京东方 A	10,900	44,581.00	0.08
95	002180	纳思达	1,300	44,525.00	0.08
96	600026	中远海能	3,500	44,240.00	0.08
97	000581	威孚高科	2,800	44,100.00	0.08
98	600580	卧龙电驱	3,000	43,830.00	0.08
99	600837	海通证券	4,700	43,334.00	0.08
100	600588	用友网络	2,100	43,050.00	0.08
101	300257	开山股份	2,800	42,476.00	0.08
102	600299	安迪苏	5,300	42,241.00	0.08
103	000568	泸州老窖	200	41,914.00	0.07
104	000060	中金岭南	8,800	41,800.00	0.07
105	688187	时代电气	998	41,776.28	0.07
106	600362	江西铜业	2,200	41,756.00	0.07
107	000898	鞍钢股份	15,000	41,700.00	0.07
108	002938	鹏鼎控股	1,700	41,293.00	0.07
109	600009	上海机场	900	40,878.00	0.07
110	002129	TCL 中环	1,225	40,670.00	0.07
111	603707	健友股份	3,000	40,500.00	0.07
112	002155	湖南黄金	3,300	40,260.00	0.07
113	000301	东方盛虹	3,400	40,188.00	0.07
114	300026	红日药业	7,400	40,108.00	0.07
115	002410	广联达	1,220	39,637.80	0.07
116	002304	洋河股份	300	39,405.00	0.07
117	002532	天山铝业	6,500	38,935.00	0.07
118	601390	中国中铁	5,100	38,658.00	0.07
119	688213	思特威	752	38,457.28	0.07
120	603259	药明康德	600	37,386.00	0.07
121	600060	海信视像	1,500	37,125.00	0.07
122	300012	华测检测	1,900	37,050.00	0.07
123	600011	华能国际	4,000	37,040.00	0.07
124	600132	重庆啤酒	400	36,864.00	0.07
125	002153	石基信息	2,600	36,400.00	0.06

126	688358	祥生医疗	712	36,312.00	0.06
127	688208	道通科技	1,196	36,250.76	0.06
128	000001	平安银行	3,200	35,936.00	0.06
129	601611	中国核建	4,100	34,645.00	0.06
130	601456	国联证券	3,800	34,580.00	0.06
131	601669	中国电建	6,000	34,440.00	0.06
132	002430	杭氧股份	1,000	34,360.00	0.06
133	002563	森马服饰	5,500	34,210.00	0.06
134	601636	旗滨集团	3,900	33,618.00	0.06
135	600016	民生银行	8,900	33,375.00	0.06
136	300773	拉卡拉	1,900	33,136.00	0.06
137	600062	华润双鹤	1,900	33,098.00	0.06
138	600919	江苏银行	4,500	33,075.00	0.06
139	002271	东方雨虹	1,200	32,712.00	0.06
140	002475	立讯精密	1,000	32,450.00	0.06
141	600487	亨通光电	2,200	32,252.00	0.06
142	300144	宋城演艺	2,600	32,240.00	0.06
143	000750	国海证券	9,600	32,160.00	0.06
144	300015	爱尔眼科	1,730	32,091.50	0.06
145	002371	北方华创	100	31,765.00	0.06
146	601998	中信银行	5,300	31,694.00	0.06
147	688012	中微公司	200	31,290.00	0.06
148	688223	晶科能源	2,201	30,946.06	0.06
149	600546	山煤国际	2,100	30,387.00	0.05
150	300760	迈瑞医疗	100	29,980.00	0.05
151	300308	中际旭创	200	29,490.00	0.05
152	002368	太极股份	700	28,819.00	0.05
153	000932	华菱钢铁	6,000	28,620.00	0.05
154	601958	金钼股份	2,500	27,875.00	0.05
155	600038	中直股份	700	27,874.00	0.05
156	600426	华鲁恒升	900	27,567.00	0.05
157	600529	山东药玻	1,000	27,220.00	0.05
158	601231	环旭电子	1,800	26,928.00	0.05
159	605117	德业股份	180	26,919.00	0.05
160	601838	成都银行	2,200	26,862.00	0.05
161	600909	华安证券	5,700	26,619.00	0.05
162	688248	南网科技	690	26,489.10	0.05
163	002131	利欧股份	11,500	26,450.00	0.05
164	600486	扬农化工	300	26,226.00	0.05
165	002249	大洋电机	4,600	26,220.00	0.05
166	688521	芯原股份	364	26,178.88	0.05
167	002594	比亚迪	100	25,827.00	0.05
168	300347	泰格医药	400	25,816.00	0.05

169	002493	荣盛石化	2,200	25,608.00	0.05
170	601098	中南传媒	2,200	25,520.00	0.05
171	001227	兰州银行	8,900	25,454.00	0.05
172	601058	赛轮轮胎	2,200	25,058.00	0.04
173	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.04
174	600906	财达证券	3,400	24,480.00	0.04
175	600928	西安银行	6,600	23,232.00	0.04
176	688289	圣湘生物	1,371	23,087.64	0.04
177	002250	联化科技	2,200	23,012.00	0.04
178	603799	华友钴业	500	22,955.00	0.04
179	002027	分众传媒	3,300	22,473.00	0.04
180	300850	新强联	600	22,428.00	0.04
181	600801	华新水泥	1,800	22,230.00	0.04
182	000089	深圳机场	3,100	21,545.00	0.04
183	600352	浙江龙盛	2,300	21,505.00	0.04
184	600497	驰宏锌锗	4,200	21,084.00	0.04
185	600581	八一钢铁	5,200	21,060.00	0.04
186	000878	云南铜业	1,900	20,995.00	0.04
187	000538	云南白药	400	20,992.00	0.04
188	605305	中际联合	600	20,916.00	0.04
189	601728	中国电信	3,700	20,831.00	0.04
190	688318	财富趋势	208	20,793.76	0.04
191	600600	青岛啤酒	200	20,726.00	0.04
192	600435	北方导航	1,800	20,682.00	0.04
193	000776	广发证券	1,400	20,594.00	0.04
194	002372	伟星新材	1,000	20,540.00	0.04
195	600970	中材国际	1,600	20,400.00	0.04
196	601666	平煤股份	2,700	20,358.00	0.04
197	300058	蓝色光标	2,100	20,307.00	0.04
198	002142	宁波银行	800	20,240.00	0.04
199	600131	国网信通	1,000	20,190.00	0.04
200	002507	涪陵榨菜	1,100	20,141.00	0.04
201	002459	晶澳科技	480	20,016.00	0.04
202	600528	中铁工业	2,000	19,760.00	0.04
203	002673	西部证券	3,100	19,685.00	0.04
204	000887	中鼎股份	1,500	19,635.00	0.04
205	001979	招商蛇口	1,500	19,545.00	0.03
206	600115	中国东航	4,100	19,516.00	0.03
207	600763	通策医疗	200	19,372.00	0.03
208	002745	木林森	2,100	19,320.00	0.03
209	603568	伟明环保	1,100	19,261.00	0.03
210	603456	九洲药业	700	19,166.00	0.03
211	002025	航天电器	300	19,140.00	0.03

212	000703	恒逸石化	2,800	18,984.00	0.03
213	000997	新大陆	1,000	18,900.00	0.03
214	600415	小商品城	2,200	18,766.00	0.03
215	601615	明阳智能	1,100	18,568.00	0.03
216	601336	新华保险	500	18,385.00	0.03
217	688981	中芯国际	363	18,338.76	0.03
218	000999	华润三九	300	18,198.00	0.03
219	001914	招商积余	1,200	18,060.00	0.03
220	601118	海南橡胶	4,000	17,920.00	0.03
221	600755	厦门国贸	2,300	17,802.00	0.03
222	000987	越秀资本	2,800	17,780.00	0.03
223	300601	康泰生物	700	17,773.00	0.03
224	600900	长江电力	800	17,648.00	0.03
225	000069	华侨城 A	4,000	17,600.00	0.03
226	000800	一汽解放	2,100	17,577.00	0.03
227	601628	中国人寿	500	17,480.00	0.03
228	600315	上海家化	600	17,406.00	0.03
229	603392	万泰生物	260	17,360.20	0.03
230	600901	江苏金租	4,200	17,346.00	0.03
231	601991	大唐发电	5,200	17,212.00	0.03
232	002478	常宝股份	2,300	17,135.00	0.03
233	300872	天阳科技	1,100	17,094.00	0.03
234	688029	南微医学	206	16,801.36	0.03
235	600728	佳都科技	2,400	16,632.00	0.03
236	600956	新天绿能	1,900	16,568.00	0.03
237	601519	大智慧	2,300	16,468.00	0.03
238	002648	卫星化学	1,100	16,456.00	0.03
239	002242	九阳股份	1,100	16,445.00	0.03
240	002319	乐通股份	1,000	16,440.00	0.03
241	300868	杰美特	900	16,380.00	0.03
242	603127	昭衍新药	400	16,360.00	0.03
243	688088	虹软科技	382	16,330.50	0.03
244	600927	永安期货	1,000	16,260.00	0.03
245	688108	赛诺医疗	1,537	16,230.72	0.03
246	601872	招商轮船	2,800	16,212.00	0.03
247	300869	康泰医学	700	16,072.00	0.03
248	603317	天味食品	1,100	16,071.00	0.03
249	603369	今世缘	300	15,840.00	0.03
250	002901	大博医疗	500	15,540.00	0.03
251	002212	天融信	1,600	15,520.00	0.03
252	002599	盛通股份	1,700	15,385.00	0.03
253	600050	中国联通	3,200	15,360.00	0.03
254	600641	万业企业	800	15,272.00	0.03

255	603218	日月股份	800	15,192.00	0.03
256	300465	高伟达	1,500	14,895.00	0.03
257	688468	科美诊断	1,555	14,772.50	0.03
258	601699	潞安环能	900	14,688.00	0.03
259	300085	银之杰	1,200	14,112.00	0.03
260	688109	品茗科技	543	14,063.70	0.03
261	002116	中国海诚	1,100	14,058.00	0.03
262	301030	仕净科技	200	13,820.00	0.02
263	000661	长春高新	100	13,630.00	0.02
264	600157	永泰能源	9,500	13,490.00	0.02
265	603567	珍宝岛	900	13,464.00	0.02
266	301029	怡合达	300	13,404.00	0.02
267	688258	卓易信息	200	13,346.00	0.02
268	688005	容百科技	245	13,234.90	0.02
269	688551	科威尔	200	13,116.00	0.02
270	002533	金杯电工	1,600	13,056.00	0.02
271	601128	常熟银行	1,900	12,958.00	0.02
272	688126	沪硅产业	614	12,832.60	0.02
273	601688	华泰证券	900	12,393.00	0.02
274	600999	招商证券	900	12,213.00	0.02
275	002065	东华软件	1,700	12,002.00	0.02
276	600968	海油发展	3,900	11,973.00	0.02
277	300408	三环集团	400	11,740.00	0.02
278	601168	西部矿业	1,100	11,561.00	0.02
279	688327	云从科技	665	11,504.50	0.02
280	601868	中国能建	4,900	11,466.00	0.02
281	001289	龙源电力	500	11,250.00	0.02
282	601077	渝农商行	3,100	11,129.00	0.02
283	688315	诺禾致源	406	10,779.30	0.02
284	603808	歌力思	800	10,504.00	0.02
285	601990	南京证券	1,200	9,816.00	0.02
286	000786	北新建材	400	9,804.00	0.02
287	688320	禾川科技	200	9,644.00	0.02
288	601088	中国神华	300	9,225.00	0.02
289	000807	云铝股份	700	8,911.00	0.02
290	601186	中国铁建	900	8,865.00	0.02
291	600570	恒生电子	200	8,858.00	0.02
292	300866	安克创新	100	8,750.00	0.02
293	600640	国脉文化	700	8,407.00	0.02
294	300661	圣邦股份	100	8,213.00	0.01
295	300999	金龙鱼	200	7,998.00	0.01
296	600958	东方证券	800	7,760.00	0.01
297	000685	中山公用	1,000	7,570.00	0.01

298	002916	深南电路	100	7,537.00	0.01
299	600674	川投能源	500	7,525.00	0.01
300	600406	国电南瑞	320	7,392.00	0.01
301	000739	普洛药业	400	7,096.00	0.01
302	300413	芒果超媒	200	6,842.00	0.01
303	601607	上海医药	300	6,723.00	0.01
304	301117	佳缘科技	100	6,462.00	0.01
305	300130	新国都	200	5,666.00	0.01
306	600481	双良节能	400	5,592.00	0.01
307	002154	报喜鸟	1,000	5,520.00	0.01
308	601000	唐山港	1,500	5,295.00	0.01
309	601601	中国太保	200	5,196.00	0.01
310	601600	中国铝业	900	4,941.00	0.01
311	603606	东方电缆	100	4,903.00	0.01
312	000670	盈方微	700	4,326.00	0.01
313	688510	航亚科技	200	3,978.00	0.01
314	300182	捷成股份	600	3,786.00	0.01
315	603806	福斯特	100	3,719.00	0.01
316	605358	立昂微	100	3,673.00	0.01
317	300088	长信科技	600	3,618.00	0.01
318	002335	科华数据	100	3,595.00	0.01
319	601989	中国重工	700	3,374.00	0.01
320	600460	士兰微	100	3,027.00	0.01
321	600887	伊利股份	100	2,832.00	0.01
322	600959	江苏有线	800	2,704.00	0.00
323	601598	中国外运	500	2,330.00	0.00
324	000400	许继电气	100	2,305.00	0.00
325	300701	森霸传感	200	2,186.00	0.00
326	603598	引力传媒	200	2,092.00	0.00
327	301002	崧盛股份	100	2,064.00	0.00
328	300532	今天国际	100	2,056.00	0.00
329	300389	艾比森	100	2,037.00	0.00
330	605066	天正电气	200	1,882.00	0.00
331	002244	滨江集团	200	1,764.00	0.00
332	601126	四方股份	100	1,519.00	0.00
333	000617	中油资本	200	1,446.00	0.00
334	000155	川能动力	100	1,440.00	0.00
335	600183	生益科技	100	1,420.00	0.00
336	600863	内蒙华电	300	1,245.00	0.00
337	000975	银泰黄金	100	1,170.00	0.00
338	601881	中国银河	100	1,161.00	0.00
339	600039	四川路桥	100	981.00	0.00
340	600686	金龙汽车	100	814.00	0.00

341	601985	中国核电	100	705.00	0.00
342	002600	领益智造	100	691.00	0.00
342	600918	中泰证券	100	691.00	0.00
343	600488	津药药业	100	562.00	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	600519	贵州茅台	894,941.00	2.35
2	300750	宁德时代	664,795.00	1.74
3	601318	中国平安	354,749.00	0.93
4	601012	隆基绿能	323,165.00	0.85
5	688020	方邦股份	243,748.99	0.64
6	000001	平安银行	227,504.00	0.60
7	688308	欧科亿	221,143.92	0.58
8	601988	中国银行	217,267.00	0.57
9	000858	五粮液	217,064.00	0.57
10	002475	立讯精密	213,088.00	0.56
11	600166	福田汽车	210,207.00	0.55
12	601888	中国中免	199,785.00	0.52
13	300693	盛弘股份	198,440.00	0.52
14	300122	智飞生物	192,323.00	0.50
15	300059	东方财富	189,449.00	0.50
16	688425	铁建重工	188,672.51	0.49
17	600038	中直股份	186,770.00	0.49
18	300026	红日药业	182,511.00	0.48
19	600309	万华化学	182,365.00	0.48
20	688126	沪硅产业	181,250.83	0.48

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	600519	贵州茅台	711,355.00	1.87
2	300750	宁德时代	504,898.00	1.32
3	688020	方邦股份	275,638.70	0.72
4	601012	隆基绿能	232,446.00	0.61
5	688308	欧科亿	216,238.14	0.57

6	688425	铁建重工	201,169.85	0.53
7	688063	派能科技	193,947.47	0.51
8	600026	中远海能	190,754.00	0.50
9	601699	潞安环能	190,602.00	0.50
10	002475	立讯精密	190,420.00	0.50
11	601689	拓普集团	186,038.00	0.49
12	000001	平安银行	184,832.00	0.48
13	688126	沪硅产业	177,163.12	0.46
14	000988	华工科技	175,447.00	0.46
15	601318	中国平安	174,406.00	0.46
16	002714	牧原股份	172,595.00	0.45
17	000751	锌业股份	171,387.00	0.45
18	300014	亿纬锂能	170,896.00	0.45
19	605117	德业股份	166,271.00	0.44
20	688112	鼎阳科技	165,363.63	0.43

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	48,852,095.56
卖出股票收入（成交）总额	45,525,375.94

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	6,200,179.24	11.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	40,164,285.08	71.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,364,464.32	82.73

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	019694	23 国债 01	41,000	4,145,495.40	7.40
2	113056	重银转债	27,410	2,773,279.97	4.95
3	110077	洪城转债	16,210	2,336,562.25	4.17
4	019697	23 国债 04	20,000	2,054,683.84	3.67
5	132018	G 三峡 EB1	11,600	1,645,587.12	2.94

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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重银转债（代码：113056 SH）、G 三峡 EB1（代码：132018 SH）、华阳转债（代码：128125 SZ）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. 重庆银行股份有限公司

2023 年 3 月 16 日，重庆银行股份有限公司因内部制度不完善，违规经营被中国证券监督管理委员会重庆监管局警示。

2023 年 4 月 24 日，重庆银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被重庆市通信管理局、四川省通信管理局责令改正。

2. 中国长江三峡集团有限公司

2023 年 2 月 16 日，中国长江三峡集团有限公司因未依法履行职责、其他类污染防治类别、其他类环境违法行为被宁南生态环境保护综合行政执法大队责令改正。

3. 深圳市华阳国际工程设计股份有限公司

2022 年 8 月 15 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被广州市黄埔区城市管理和综合执法局罚款。

2022 年 12 月 2 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被深圳市坪山区住房和建设局罚款。

2023 年 2 月 17 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被佛山市顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

2023 年 2 月 20 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

2023 年 6 月 9 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

4. 深圳市华阳国际工程设计股份有限公司

2022 年 8 月 15 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被广州市黄埔区城市管理和综合执法局罚款。

2022 年 12 月 2 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被深圳市坪山区住房和建设局罚款。

2023 年 2 月 17 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被佛山市顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

2023 年 2 月 20 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

2023 年 6 月 9 日，深圳市华阳国际工程设计股份有限公司因未依法履行职责被顺德区住房城乡建设和水利局扣分。

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程

上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 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	10,173.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,242.68

7.11.4 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	113056	重银转债	2,773,279.97	4.95
2	110077	洪城转债	2,336,562.25	4.17
3	132018	G 三峡 EB1	1,645,587.12	2.94
4	113037	紫银转债	1,292,511.61	2.31
5	110075	南航转债	1,126,175.42	2.01
6	128125	华阳转债	1,121,367.03	2.00
7	123119	康泰转 2	1,120,693.63	2.00
8	123107	温氏转债	1,053,750.67	1.88
9	123127	耐普转债	950,116.44	1.70
10	127016	鲁泰转债	918,286.66	1.64
11	128124	科华转债	913,289.86	1.63
12	127062	垒知转债	867,248.67	1.55
13	127054	双箭转债	849,943.17	1.52
14	113653	永 22 转债	837,962.73	1.50
15	123100	朗科转债	836,801.49	1.49
16	113064	东材转债	764,165.08	1.36
17	113661	福 22 转债	749,280.17	1.34
18	113043	财通转债	736,106.65	1.31
19	113651	松霖转债	674,554.59	1.20
20	113519	长久转债	660,067.66	1.18
21	113650	博 22 转债	657,356.00	1.17
22	110076	华海转债	656,900.59	1.17
23	127051	博杰转债	602,535.61	1.08
24	113535	大业转债	585,306.24	1.04
25	127039	北港转债	565,545.06	1.01

26	127024	盈峰转债	559,855.11	1.00
27	127056	中特转债	559,818.37	1.00
28	110087	天业转债	559,583.62	1.00
29	123088	威唐转债	549,579.44	0.98
30	118018	瑞科转债	534,745.21	0.95
31	113561	正裕转债	534,536.76	0.95
32	110067	华安转债	515,030.62	0.92
33	113013	国君转债	512,832.39	0.92
34	128137	洁美转债	509,324.12	0.91
35	110060	天路转债	492,664.01	0.88
36	110062	烽火转债	487,826.06	0.87
37	127005	长证转债	483,018.26	0.86
38	113563	柳药转债	378,898.74	0.68
39	118027	宏图转债	354,072.82	0.63
40	110086	精工转债	298,540.39	0.53
41	118009	华锐转债	294,959.40	0.53
42	123101	拓斯转债	292,279.29	0.52
43	123172	漱玉转债	285,907.93	0.51
44	127072	博实转债	279,316.36	0.50
45	110063	鹰 19 转债	278,515.13	0.50
46	110090	爱迪转债	277,554.79	0.50
47	127061	美锦转债	251,714.12	0.45
48	123151	康医转债	241,353.20	0.43
49	123109	昌红转债	218,955.46	0.39
50	127044	蒙娜转债	177,152.13	0.32
51	123154	火星转债	165,361.24	0.30
52	113052	兴业转债	158,672.39	0.28
53	111008	沿浦转债	127,489.46	0.23
54	111007	永和转债	123,531.10	0.22
55	127074	麦米转 2	121,608.62	0.22
56	113588	润达转债	118,119.08	0.21
57	123156	博汇转债	81,739.80	0.15
58	118003	华兴转债	73,707.15	0.13
59	128131	崇达转 2	73,074.30	0.13
60	111005	富春转债	73,016.30	0.13
61	113045	环旭转债	71,367.86	0.13
62	118017	深科转债	51,754.11	0.09
63	123048	应急转债	48,653.85	0.09
64	123112	万讯转债	48,616.96	0.09

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 (%)
安信聚利增强债券 A	453	16,739.64	-	-	7,583,055.96	100.00
安信聚利增强债券 B	-	-	-	-	-	-
安信聚利增强债券 C	222	203,176.49	44,006,173.61	97.56	1,099,007.24	2.44
合计	650	81,058.83	44,006,173.61	83.52	8,682,063.20	16.48

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信聚利增强债券 A	0.94	0.00
	安信聚利增强债券 B	-	-
	安信聚利增强债券 C	-	-
	合计	0.94	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	安信聚利增强债券 A	0
	安信聚利增强债券 B	0

人持有本开放式基金	安信聚利增强债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信聚利增强债券 A	0
	安信聚利增强债券 B	0
	安信聚利增强债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信聚利增强债券 A	安信聚利增强债券 B	安信聚利增强债券 C
基金合同生效日（2019 年 4 月 15 日）基金份额总额	184,363,680.45	-	92,721,947.42
本报告期期初基金份额总额	9,990,618.77	-	26,201,109.01
本报告期基金总申购份额	40,288.46	-	54,306,900.91
减：本报告期基金总赎回份额	2,447,851.27	-	35,402,829.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,583,055.96	-	45,105,180.85

§ 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

本基金管理人于 2023 年 5 月 20 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第十六次会议审议通过，张翼飞先生自 2023 年 5 月 18 日起担任公司副总经理。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	94,377,471.50	100.00	68,073.86	100.00	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	新租
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	新租

浙商证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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、系统支持等服务作为交易单元的选择标准，由分管投资领导、投资部门、研究部门、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 (%)
东方证券	178,147,616.55	100.00	101,378,000.00	100.00	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
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基金 2022 年第 4 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	2023-01-19
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年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	2023-03-30
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2023 年第 1 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	2023-04-21
4	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-20
5	安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	13,776,052.39	-	-	13,776,052.39	26.15

产品特有风险

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信聚利增强债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信聚利增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信聚利增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信聚利增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人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

2023年8月29日