

安信价值回报三年持有期混合型证券投资  
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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47

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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	安信价值回报三年持有混合	
基金主代码	008954	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 26 日	
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	1,571,617,776.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信价值回报三年持有混合 A	安信价值回报三年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	008954	010667
报告期末下属分级基金的份额总额	1,569,168,719.78 份	2,449,056.35 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	资产配置策略方面，本基金的资产配置策略以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资策略方面，本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方法，选择内在价值被低估的股票构建投资组合。债券投资策略方面，通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，在确保资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。资产支持证券投资策略方面，本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*65%+中债综合指数收益率*30%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制

	度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	--------------------

### 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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	安信价值回报三年持有混合 A	安信价值回报三年持有混合 C
本期已实现收益	-18,618,747.03	-12,378.47
本期利润	-104,897,794.07	-150,427.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0502	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-4.40%	-5.51%

本期基金份额净值增长率	-5.23%	-5.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	123,782,046.42	161,169.97
期末可供分配基金份额利润	0.0789	0.0658
期末基金资产净值	1,692,950,766.20	2,610,226.32
期末基金份额净值	1.0789	1.0658
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	15.56%	-13.35%

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

安信价值回报三年持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.89%	1.42%	1.01%	0.62%	3.88%	0.80%
过去三个月	-5.54%	1.22%	-3.42%	0.58%	-2.12%	0.64%
过去六个月	-5.23%	1.16%	-0.23%	0.59%	-5.00%	0.57%
过去一年	-19.16%	1.39%	-9.54%	0.70%	-9.62%	0.69%
过去三年	3.09%	1.37%	-4.20%	0.83%	7.29%	0.54%
自基金合同生效起至今	15.56%	1.35%	-3.98%	0.85%	19.54%	0.50%

安信价值回报三年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	4.85%	1.42%	1.01%	0.62%	3.84%	0.80%
过去三个月	-5.66%	1.22%	-3.42%	0.58%	-2.24%	0.64%
过去六个月	-5.46%	1.16%	-0.23%	0.59%	-5.23%	0.57%
过去一年	-19.56%	1.39%	-9.54%	0.70%	-10.02%	0.69%
自基金合同生效起至今	-13.35%	1.37%	-14.51%	0.81%	1.16%	0.56%

注：根据《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×30%。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 65%、5%、30%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

安信价值回报三年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信价值回报三年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日。

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

3、根据基金管理人 2020 年 12 月 15 日《关于安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，自 2020 年 12 月 15 日起，本基金增加 C 类份额。C 类份额自 2021 年 1 月 7 日起有份额。

## § 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		
张明	本基金的基金经理，价值投资部总经理助理	2020 年 2 月 26 日	-	12 年	张明先生，管理学硕士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组任研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司价值投资部总经理助理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成

					长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；安信中国制造 2025 港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
陈一峰	本基金的基金经理，总经理助理兼研究总监兼价值投资部总经理	2020 年 2 月 26 日	-	15 年	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监兼价值投资部总经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
陈思	本基金的基金经理助理	2021 年 3 月 10 日	-	8 年	陈思女士，经济学硕士，历任安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理助理、权益投资部基金经理，现任价值投资部基金经理。现任安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2023 年上半年市场震荡分化，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板指数下跌 5.61%。分行业来看，通信、传媒、计算机等行业表现较好，商贸零售、房地产、美容护理等行业表现较差。

上半年国内经济总体处于弱复苏的过程中，制造业 PMI 数据有所回落，发电量数据和工业增加值总体同比小幅增长。地产销售冲高后二季度呈现边际走弱。餐饮旅游消费总体持续恢复，五一和端午节假日客流量数据基本已超过 2019 年的水平，但客单价的恢复相对偏慢。

物价方面，上半年 CPI 与 PPI 持续回落。上游大宗商品的价格表现分化，动力煤和布伦特原油价格总体回落，碳酸锂价格则是快速下跌后触底反弹，黄金价格表现较好。

流动性方面，十年期国债收益率总体小幅下行，M2 增速继续保持在 10% 以上，人民币汇率有

小幅贬值。

在具体选股策略方面，我们继续坚持自下而上地精选个股，基于尽量精确的企业基本面价值判断来优化组合配置。我们希望在各个细分领域找寻具有投资性价比的好公司。

本基金上半年总体小幅增加了电力设备、传媒互联网、银行等行业的配置，减少了建筑、医药、采掘行业的配置。未来在具体投资运作方面，我们会继续坚持自下而上精选个股，结合未来产业发展空间、企业盈利增速以及动态估值水平的变化，我们目前相对看好的投资机会，主要分布在电力设备、传媒互联网、食品饮料、银行、医药等板块。

#### 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回报三年持有混合 A 基金份额净值为 1.0789 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.23%；安信价值回报三年持有混合 C 基金份额净值为 1.0658 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.46%；同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断目前 A 股估值处于历史偏低的位置，已经反映了较多悲观预期。展望未来，中国经济的韧性还是比较强，后续预计各项政策工具还有很多可以发力的地方，不必过分悲观。我们认为目前市场有一批不错的投资标的可供布局，部分优秀公司可能有获得估值盈利双升的机会。

2023 上半年港股市场先涨后跌，总体震荡明显，但总体估值依然处于低位。目前 AH 溢价指数达到 140，依然处于近 10 年的高位，表明港股目前相比 A 股有一定的性价比，我们继续保持了一定比例的港股资产配置。目前我们在港股市场能找到一批估值合理且增长不错的公司，集中在传媒互联网、新能源、地产等行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经

验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	42,317,187.22	120,392,430.47
结算备付金		428,486.28	10,155,096.54
存出保证金		174,728.94	152,503.50
交易性金融资产	6.4.7.2	1,659,105,407.35	3,005,442,915.27
其中：股票投资		1,564,752,790.91	2,840,845,804.30
基金投资		-	-
债券投资		94,352,616.44	164,597,110.97
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		1,488,064.04	18,966,895.54
应收股利		5,141,852.90	-
应收申购款		131,663.47	43,115.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,708,787,390.20	3,155,152,956.61
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		157.17	7,659,826.93



应付赎回款		10,304,661.02	-
应付管理人报酬		2,157,212.24	4,010,863.41
应付托管费		359,535.37	668,477.23
应付销售服务费		1,078.35	1,169.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	403,753.53	896,843.09
负债合计		13,226,397.68	13,237,180.15
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,571,617,776.13	2,760,011,850.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	123,943,216.39	381,903,926.02
净资产合计		1,695,560,992.52	3,141,915,776.46
负债和净资产总计		1,708,787,390.20	3,155,152,956.61

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,571,617,776.13 份，其中安信价值回报三年持有混合 A 基金份额总额 1,569,168,719.78 份，基金份额净值 1.0789 元；安信价值回报三年持有混合 C 基金份额总额 2,449,056.35 份，基金份额净值 1.0658 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-83,948,035.95	117,896,190.52
1. 利息收入		259,363.26	263,164.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	255,796.14	263,164.75
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		3,567.12	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,209,697.28	32,727,020.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-32,639,836.32	-41,541,391.64
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	1,155,359.05	3,435,300.25
资产支持证券投资 收益	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	33,694,174.55	70,833,112.33
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	-86,417,096.49	84,906,004.83
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		21,100,186.04	29,847,136.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,928,166.63	25,420,668.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,988,027.70	4,236,778.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,793.86	3,655.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.20	7.11
8. 其他费用	6.4.7.19	177,197.65	186,027.63
<b>三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)</b>		-105,048,221.99	88,049,054.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以 “-”号填列)</b>		-105,048,221.99	88,049,054.49
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-105,048,221.99	88,049,054.49

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金

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）	2,760,011,850.44	-	381,903,926.02	3,141,915,776.46
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）	2,760,011,850.44	-	381,903,926.02	3,141,915,776.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,188,394,074.31	-	-257,960,709.63	-1,446,354,783.94
（一）、综合收益总额	-	-	-105,048,221.99	-105,048,221.99
（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）	-1,188,394,074.31	-	-152,912,487.64	-1,341,306,561.95
其中：1. 基金申购款	9,132,163.68	-	1,291,287.49	10,423,451.17
2. 基金赎回款	-1,197,526,237.99	-	-154,203,775.13	-1,351,730,013.12
（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）	1,571,617,776.13	-	123,943,216.39	1,695,560,992.52
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）	2,745,082,123.39	-	831,307,133.80	3,576,389,257.19

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）	2,745,082,123.39	-	831,307,133.80	3,576,389,257.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,243,388.77	-	90,248,464.07	99,491,852.84
（一）、综合收益总额	-	-	88,049,054.49	88,049,054.49
（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）	9,243,388.77	-	2,199,409.58	11,442,798.35
其中：1. 基金申购款	9,342,300.22	-	2,229,280.84	11,571,581.06
2. 基金赎回款	-98,911.45	-	-29,871.26	-128,782.71
（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）	2,754,325,512.16	-	921,555,597.87	3,675,881,110.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领

廖维坤

苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2019 年 11 月 27 日下发的证监许可[2019]2604 号文“关于准予安信价值回报三年持有期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《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2020 年 2 月 20 日至 2020 年 2 月 21 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（2020）验字第 60962175\_H05 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,602,517,990.39 份，其中认购资金利息折合 147,446.17 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 12 月 15 日发布的《关于安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》以及更新的《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本基金自 2020 年 12 月 15 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、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。在投资人申购时收取申购费用、赎回时不收取赎回费、且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；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时不收取赎回费，但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。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置基金代码，分别计算基金份额净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 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。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×65%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×30%

#### 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）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财



税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	42,317,187.22
等于：本金	42,312,695.35
加：应计利息	4,491.87
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	42,317,187.22

##### 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	1,746,232,248.88	-	1,564,752,790.91	-181,479,457.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	53,009,756.43	851,494.52	53,863,794.52	2,543.57
	银行间市场	39,897,800.00	476,821.92	40,488,821.92	114,200.00
	合计	92,907,556.43	1,328,316.44	94,352,616.44	116,743.57
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	1,839,139,805.31	1,328,316.44	1,659,105,407.35	-181,362,714.40
----	------------------	--------------	------------------	-----------------

### 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	290,157.59
其中：交易所市场	290,157.59
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	49,588.57
应付银行间账户维护费	4,500.00
合计	403,753.53

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

#### 安信价值回报三年持有混合 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	2,757,570,579.74	2,757,570,579.74
本期申购	9,124,378.03	9,124,378.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,197,526,237.99	-1,197,526,237.99
本期末	1,569,168,719.78	1,569,168,719.78

#### 安信价值回报三年持有混合 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	2,441,270.70	2,441,270.70
本期申购	7,785.65	7,785.65
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,449,056.35	2,449,056.35

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

单位：人民币元

##### 安信价值回报三年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	440,662,303.55	-59,069,236.07	381,593,067.48
本期利润	-18,618,747.03	-86,279,047.04	-104,897,794.07
本期基金份额交易产生的变动数	-174,942,816.74	22,029,589.75	-152,913,226.99
其中：基金申购款	1,408,750.27	-118,202.13	1,290,548.14
基金赎回款	-176,351,567.01	22,147,791.88	-154,203,775.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	247,100,739.78	-123,318,693.36	123,782,046.42

##### 安信价值回报三年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	360,331.02	-49,472.48	310,858.54
本期利润	-12,378.47	-138,049.45	-150,427.92
本期基金份额交易产生的变动数	1,080.28	-340.93	739.35
其中：基金申购款	1,080.28	-340.93	739.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,032.83	-187,862.86	161,169.97

#### 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	200,042.53
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	54,312.88	
其他	1,440.73	
合计	255,796.14	

#### 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	1,481,876,817.90
减：卖出股票成本总额	1,511,089,125.22
减：交易费用	3,427,529.00
买卖股票差价收入	-32,639,836.32

#### 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	1,267,800.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-112,440.95
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	1,155,359.05

##### 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	144,114,551.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	141,633,828.78
减：应计利息总额	2,593,148.98
减：交易费用	15.06
买卖债券差价收入	-112,440.95

#### 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	33,694,174.55
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	33,694,174.55

#### 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	-86,417,096.49
股票投资	-86,790,411.06
债券投资	373,314.57
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	-86,417,096.49

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	17,734.43
银行间账户维护费	9,000.00
证券组合费	41,367.28

合计	177,197.65
----	------------

#### 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

金额单位：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	
	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	761,971,817.56	42.71	722,613,368.73	43.07

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	609,577.46	45.47	96,918.86	33.40
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 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	571,697.42	45.61	376,221.96	66.78

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。

### 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	17,928,166.63	25,420,668.19
其中：支付销售机构的客户维护费	8,567,253.73	12,332,113.60

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。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,988,027.70	4,236,778.01

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% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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		
	安信价值回报三年持有 混合 A	安信价值回报三年持有 混合 C	合计
安信基金	-	4.32	4.32
招商银行	-	6,369.15	6,369.15
合计	-	6,373.47	6,373.47
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		
	安信价值回报三年持有 混合 A	安信价值回报三年持有 混合 C	合计
安信基金	-	3.86	3.86
招商银行	-	3,355.50	3,355.50
合计	-	3,359.36	3,359.36

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 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。



#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	安信价值回报三年持有混合 A	安信价值回报三年持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 2 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,964,614.38	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,964,614.38	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	安信价值回报三年持有混合 A	安信价值回报三年持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 2 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,964,614.38	-

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,964,614.38	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	-

注：本基金管理人运用固有资金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。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	42,317,187.22	200,042.53	134,391,075.71	220,441.03

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

本基金本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301305	朗坤	2023	6个月	新股锁	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

	环境	年 5 月 15 日		定							
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁 定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87		-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47		-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64		-
688343	云天励飞	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	43.92	50.67	24,961	1,096,287.12	1,264,773.87		-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17		-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40		-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁 定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32		-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	77,400	499,844.00	539,478.00	-

#### 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，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：无）。

##### 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	94,352,616.44	154,332,889.05
合计	94,352,616.44	154,332,889.05

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	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	10,264,221.92
合计	-	10,264,221.92

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	42,317,187.22	-	-	-	42,317,187.22
结算备付金	428,486.28	-	-	-	428,486.28
存出保证金	174,728.94	-	-	-	174,728.94
交易性金融资产	94,352,616.44	-	-	-1,564,752,790.91	1,659,105,407.35
应收股利	-	-	-	5,141,852.90	5,141,852.90
应收申购款	-	-	-	131,663.47	131,663.47
应收清算款	-	-	-	1,488,064.04	1,488,064.04
资产总计	137,273,018.88	-	-	-1,571,514,371.32	1,708,787,390.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,304,661.02	10,304,661.02
应付管理人报酬	-	-	-	2,157,212.24	2,157,212.24
应付托管费	-	-	-	359,535.37	359,535.37
应付清算款	-	-	-	157.17	157.17
应付销售服务费	-	-	-	1,078.35	1,078.35
其他负债	-	-	-	403,753.53	403,753.53
负债总计	-	-	-	13,226,397.68	13,226,397.68
利率敏感度缺口	137,273,018.88	-	-	-1,558,287,973.64	1,695,560,992.52
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	120,392,430.47	-	-	-	120,392,430.47
结算备付金	10,155,096.54	-	-	-	10,155,096.54
存出保证金	152,503.50	-	-	-	152,503.50
交易性金融资产	164,597,110.97	-	-	-2,840,845,804.30	3,005,442,915.27
应收申购款	-	-	-	43,115.29	43,115.29
应收清算款	-	-	-	18,966,895.54	18,966,895.54
资产总计	295,297,141.48	-	-	-2,859,855,815.13	3,155,152,956.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,010,863.41	4,010,863.41

应付托管费	-	-	-	668,477.23	668,477.23
应付清算款	-	-	-	7,659,826.93	7,659,826.93
应付销售服务费	-	-	-	1,169.49	1,169.49
其他负债	-	-	-	896,843.09	896,843.09
负债总计	-	-	-	13,237,180.15	13,237,180.15
利率敏感度缺口	295,297,141.48	-	-	-2,846,618,634.98	3,141,915,776.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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	58,035.86	198,940.25
	2. 市场利率上升 25 个基点	-57,926.09	-198,278.54

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	710,051,905.27	-	710,051,905.27
应收股利	-	5,141,852.90	-	5,141,852.90
资产合计	-	715,193,758.17	-	715,193,758.17
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	-	715,193,758.17	-	715,193,758.17
项目	上年度末			



	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	-	1,384,087,380.69	-	1,384,087,380.69
资产合计	-	1,384,087,380.69	-	1,384,087,380.69
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	-	1,384,087,380.69	-	1,384,087,380.69

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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. 所有外币相对人民币升值 5%	35,759,687.91	69,204,369.03
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-35,759,687.91	-69,204,369.03

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 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需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	1,564,752,790.91	92.29	2,840,845,804.30	90.42
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	1,564,752,790.91	92.29	2,840,845,804.30	90.42

#### 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%	101,586,150.39	174,110,705.23
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-101,586,150.39	-174,110,705.23

#### 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	1,562,602,017.91	2,839,913,926.90
第二层次	94,892,094.44	164,597,110.97

第三层次	1,611,295.00	931,877.40
合计	1,659,105,407.35	3,005,442,915.27

#### 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

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,564,752,790.91	91.57
	其中：股票	1,564,752,790.91	91.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,352,616.44	5.52
	其中：债券	94,352,616.44	5.52
	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	42,745,673.50	2.50
8	其他各项资产	6,936,309.35	0.41
9	合计	1,708,787,390.20	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 710,051,905.27 元，占净值比例 41.88%。

## 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	37,391,265.00	2.21
B	采矿业	906,090.60	0.05
C	制造业	573,233,896.16	33.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,265,989.06	3.55
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	539,478.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,373,173.95	0.08
J	金融业	149,337,571.10	8.81
K	房地产业	281,448.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	31,349,407.20	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	854,700,885.64	50.41

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	39,823,095.65	2.35
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	307,639,943.36	18.14
日常消费品	33,897,453.14	2.00
医疗保健	42,245,169.70	2.49
金融	871,558.76	0.05
信息技术	-	-
通讯业务	238,936,295.71	14.09

公用事业	-	-
房地产	46,638,388.95	2.75
合计	710,051,905.27	41.88

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	748,004	171,135,835.16	10.09
2	600519	贵州茅台	99,401	168,087,091.00	9.91
3	03690	美团-W	1,404,174	158,332,068.13	9.34
4	00700	腾讯控股	511,191	156,285,692.40	9.22
5	01211	比亚迪股份	640,500	147,632,047.50	8.71
6	002142	宁波银行	5,764,007	145,829,377.10	8.60
7	601012	隆基绿能	3,328,383	95,424,740.61	5.63
8	01024	快手-W	1,674,037	82,650,603.31	4.87
9	02359	药明康德	567,300	32,689,953.38	1.93
9	603259	药明康德	503,120	31,349,407.20	1.85
10	601668	中国建筑	10,497,883	60,257,848.42	3.55
11	600887	伊利股份	2,083,700	59,010,384.00	3.48
12	00688	中国海外发展	2,961,653	46,638,388.95	2.75
13	600486	扬农化工	503,842	44,045,867.64	2.60
14	01088	中国神华	1,739,867	38,418,735.71	2.27
15	002714	牧原股份	887,100	37,391,265.00	2.21
16	06186	中国飞鹤	8,432,553	33,897,453.14	2.00
17	600298	安琪酵母	542,600	19,647,546.00	1.16
18	02269	药明生物	276,000	9,555,216.32	0.56
19	600309	万华化学	80,700	7,088,688.00	0.42
20	000858	五粮液	21,500	3,516,755.00	0.21
21	002223	鱼跃医疗	80,400	2,893,596.00	0.17
22	601128	常熟银行	354,700	2,419,054.00	0.14
23	00883	中国海洋石油	136,000	1,404,359.94	0.08
23	600938	中国海油	50,005	906,090.60	0.05
24	01585	雅迪控股	102,000	1,675,827.73	0.10
25	688343	云天励飞	24,961	1,264,773.87	0.07
26	300059	东方财富	76,700	1,089,140.00	0.06
27	600176	中国巨石	63,800	903,408.00	0.05
28	03908	中金公司	68,800	871,558.76	0.05
29	601298	青岛港	77,400	539,478.00	0.03
30	002311	海大集团	6,700	313,828.00	0.02
31	002557	洽洽食品	7,100	295,005.00	0.02
32	600048	保利发展	21,600	281,448.00	0.02

33	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.02
34	603529	爱玛科技	5,100	164,322.00	0.01
35	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.01
36	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
37	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
38	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
39	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
40	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
41	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
42	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
43	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
44	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
45	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
46	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
47	301203	国泰环保	225	7,740.00	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	03690	美团-W	85,973,630.05	2.74
2	601012	隆基绿能	47,745,131.20	1.52
3	002142	宁波银行	28,457,171.40	0.91
4	600887	伊利股份	25,986,138.07	0.83
5	600298	安琪酵母	23,049,168.67	0.73
6	01211	比亚迪股份	11,532,120.71	0.37
7	601668	中国建筑	10,265,082.00	0.33
8	603259	药明康德	9,861,856.32	0.31
9	002714	牧原股份	9,047,761.20	0.29
10	00688	中国海外发展	8,689,837.43	0.28
11	600309	万华化学	6,946,266.00	0.22
12	300750	宁德时代	6,025,115.00	0.19
13	600486	扬农化工	5,736,848.00	0.18
14	000858	五粮液	3,639,207.11	0.12
15	01585	雅迪控股	2,956,721.74	0.09
16	601128	常熟银行	2,642,021.00	0.08
17	300699	光威复材	2,490,025.00	0.08
18	300059	东方财富	2,374,045.00	0.08
19	002223	鱼跃医疗	2,291,378.00	0.07
20	00883	中国海洋石油	1,531,322.24	0.05

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易

费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601668	中国建筑	156,550,213.11	4.98
2	300750	宁德时代	151,008,567.80	4.81
3	600519	贵州茅台	139,439,001.90	4.44
4	01088	中国神华	137,826,226.75	4.39
5	01211	比亚迪股份	134,969,958.14	4.30
6	00700	腾讯控股	121,326,119.33	3.86
7	02359	药明康德	108,163,683.67	3.44
8	01024	快手-W	91,167,359.14	2.90
9	06186	中国飞鹤	65,821,597.97	2.09
10	600486	扬农化工	50,935,873.32	1.62
11	002120	韵达股份	35,368,971.67	1.13
12	00688	中国海外发展	32,306,411.68	1.03
13	09696	天齐锂业	31,038,502.66	0.99
14	603444	吉比特	30,192,131.60	0.96
15	601012	隆基绿能	26,408,835.64	0.84
16	000661	长春高新	24,558,488.75	0.78
17	002142	宁波银行	22,166,517.00	0.71
18	600887	伊利股份	21,880,721.00	0.70
19	03690	美团-W	21,330,375.20	0.68
20	002714	牧原股份	15,631,911.20	0.50

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	306,818,233.26
卖出股票收入（成交）总额	1,481,876,817.90

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	53,863,794.52	3.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,488,821.92	2.39

	其中：政策性金融债	40,488,821.92	2.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	94,352,616.44	5.56

## 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	019679	22 国债 14	400,000	40,719,156.16	2.40
2	220308	22 进出 08	400,000	40,488,821.92	2.39
3	019694	23 国债 01	90,000	9,099,867.95	0.54
4	019688	22 国债 23	40,000	4,044,770.41	0.24

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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



### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

### 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除宁德时代（代码：300750 SZ）、腾讯控股（代码：00700 HG）、宁波银行（代码：002142 SZ）、中国建筑（代码：601668 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

##### 1. 宁德时代新能源科技股份有限公司

2023 年 2 月 25 日，宁德时代新能源科技股份有限公司因提供虚假资料证明文件被国家市场监督管理总局宁德市分局列入经营异常名录。

##### 2. 腾讯控股有限公司

2022 年 7 月 10 日，腾讯控股有限公司因未依法履行职责被国家市场监督管理总局罚款。

##### 3. 宁波银行股份有限公司

2022 年 9 月 9 日，宁波银行股份有限公司因未依法履行职责多次被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款。

2023 年 1 月 13 日，宁波银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款。

##### 4. 中国建筑股份有限公司

2022 年 8 月-2023 年 5 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被重庆市住房和城乡建设委员会、中国交通运输局衡水市分局处以罚款、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、国家税务总局如皋市税务局第一税务分局、中国交通运输局衡水市分局通知整改；因欠税被国家税务总局佛山市南海区税务局责令改正。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	174,728.94
2	应收清算款	1,488,064.04
3	应收股利	5,141,852.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	131,663.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,936,309.35

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (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 (%)
安信价值回报三年持有混合 A	18,066	86,857.56	4,150,460.13	0.26	1,565,018,259.65	99.74
安信价值回报三年持有混合 C	255	9,604.14	-	-	2,449,056.35	100.00
合计	18,299	85,885.45	4,150,460.13	0.26	1,567,467,316.00	99.74

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	安信价值回报三年持有混合 A	3,138,031.04	0.20
	安信价值回报三年持有混合 C	689.32	0.03
	合计	3,138,720.36	0.20

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信价值回报三年持有混合 A	>100
	安信价值回报三年持有混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	安信价值回报三年持有混合 A	>100
	安信价值回报三年持有混合 C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信价值回报三年持有混合 A	安信价值回报三年持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 2 月 26 日）基金份额总额	2,602,517,990.39	-
本报告期期初基金份额总额	2,757,570,579.74	2,441,270.70
本报告期基金总申购份额	9,124,378.03	7,785.65
减：本报告期基金总赎回份额	1,197,526,237.99	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,569,168,719.78	2,449,056.35

## § 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 (%)	
安信证券	2	761,971,817.56	42.71	609,577.46	45.47	-

东方证券	2	505,737,402.47	28.35	364,809.93	27.21	-
国海证券	2	498,344,040.01	27.93	355,108.54	26.49	新租
长江证券	2	16,409,731.70	0.92	10,138.10	0.76	-
浙商证券	2	1,489,671.00	0.08	1,074.45	0.08	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	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 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	85,229,606.50	64.76	-	-	-	-
国海证券	46,384,167.27	35.24	20,000,000.00	100.00	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

### 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 2023 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	2023-01-17
2	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

3	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增杭州银行股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2023-02-13
4	安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告	中国证券报	2023-02-23
5	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
6	安信基金管理有限责任公司关于 2023 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	2023-04-04
7	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
8	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
9	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
10	安信基金管理有限责任公司关于 2023 年香港佛诞日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-24

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

## 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