

安信民安回报一年持有期混合型证券投资  
基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信民安回报一年持有混合
基金主代码	012701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 7 日
报告期末基金份额总额	555,633,978.52 份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略方面，本基金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，重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，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，在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间、行业竞争格局的背景下，结合估值水平，注重安全边际，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，本基金将采取自上而下的投资策略，通过对国内外宏观经济态势及其引致的财政货币政策变化、收益率曲线变化、未来市场利率趋势及市场信用环境变化等因素的综合深入分析，从而确定债券的配置数量与结构。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。投资的原则是控制投资风险、

	稳健增值。资产支持证券投资策略方面，本基金将通过对宏观经济形势、提前偿还率、资产池结构、资产池质量以及资产池资产所属行业景气度等因素的研究，预测资产池未来的现金流特征，并通过详查标的证券的发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。	
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经汇率调整后）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012701	012702
报告期末下属分级基金的份额总额	122,107,573.97 份	433,526,404.55 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	624,330.64	2,095,671.23
2. 本期利润	5,083,903.45	18,703,020.43
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0377	0.0402
4. 期末基金资产净值	143,978,708.94	511,037,081.69
5. 期末基金份额净值	1.1791	1.1788

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

#### 3.2 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

安信民安回报一年持有混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.10%	0.59%	2.67%	0.18%	1.43%	0.41%
过去六个月	8.70%	0.49%	3.80%	0.15%	4.90%	0.34%
过去一年	7.93%	0.42%	4.93%	0.15%	3.00%	0.27%
过去三年	17.00%	0.40%	3.51%	0.17%	13.49%	0.23%
自基金合同生效起至今	17.91%	0.40%	2.88%	0.17%	15.03%	0.23%

安信民安回报一年持有混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.09%	0.59%	2.67%	0.18%	1.42%	0.41%
过去六个月	8.70%	0.49%	3.80%	0.15%	4.90%	0.34%
过去一年	7.92%	0.42%	4.93%	0.15%	2.99%	0.27%
过去三年	16.97%	0.40%	3.51%	0.17%	13.46%	0.23%
自基金合同生效起至今	17.88%	0.40%	2.88%	0.17%	15.00%	0.23%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信民安回报一年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信民安回报一年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 9 月 7 日。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张翼飞	本基金的基金经	2021 年 9 月 7 日	-	14 年	张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部财务主管，上海

	理，公司首席投资官（CIO）			市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部总经理、公司总经理助理、公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司首席投资官（混合资产 CIO）。现任安信永鑫增强债券型证券投资基金的基金经理助理；安信稳健增值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、安信民稳增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、安信稳健聚申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、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金的基金经理。
--	----------------	--	--	--

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益部分，本报告期内，虽然经济基本面面临比较大的挑战，但我们始终认为，当前权益市场的调整幅度，已经明显超过了基本面所需要体现的水平。权益市场被显著低估的标的也已经非常之多。期间，我们始终持有了基金合同所允许的较高的权益仓位。

港股部分，我们认为，美联储降息的动作，非常有利于收窄港币和人民币利差，非常有利于改善港股的估值基础，从而非常有利于改善港股相对于 A 股的折价程度。期间，在基金合同的许可范围内，我们也持有了较大比例的港股。

转债部分，本季度转债市场一度大幅调整，在纯债收益率屡创历史新低的情况下，转债市场的加权平均到期收益率几乎达到历史极值，并显著高于纯债收益率。我们认为，考虑到转债内涵的期权价值不可能为负，诸多转债的价格应该是被显著低估了，转债市场具有罕见的投资价值。期间，我们在基金合同允许的范围内，尽可能多的持有了经过认真筛选的转债资产。

纯债部分，本季度债券市场一度持续走强，各关键期限收益率几乎都大幅刷新了历史新低。长期来说，我们仍然倾向于人民币会有一定幅度的温和通胀。我们认为，长债收益率对长期温和通胀的可能性定价严重不足。纯债部分，我们倾向于尽可能低的仓位、相对较短的久期、尽可能高的信用评级，甚至一度持有了一定的国债期货空头。

本报告期末，权益市场、转债市场出现了大幅上涨。但是，从 2022 年初本轮地产政策启动至今的效果来看，大经济体的惯性不可小觑。我们认为，从政策出台到基本面见底回升也许尚需时日，短期市场行情的大幅上涨相对于尚待验证的基本面修复来说，也许走的太快了。随着价格的上涨，投资价值的突出程度有所下降。我们在季度末最后的上涨行情中，对权益和转债持仓做了一定幅度的止盈。

事后来看，我们在报告期内对于 A 股、港股、转债、纯债的看法大致是正确的，也从中有了很好的获益，净值创出了新高。但是，报告期内，股票、转债、纯债的走势一度大幅偏离我们对市场的判断，这种偏离也在不断提示我们，去反复检视所秉持的观点是否站得住脚。持有上述头寸的过程，实际上也是不断检视、批判底层逻辑的过程。

报告期内的遗憾在于，期间可转债市场前所未有的大跌，打破了我们组合风险预算的假设——我们之前认为，可转债是信用纯债和股票期权的综合体，由于期权价值不可能为负，所以可转债价格不太可能大面积跌破纯债价值。虽然后期发生了大幅的、非常迅速的修复，但是期间可

转债市场的大幅波动，打破了我们之前的风险预算假设，叠加权益市场的下跌，导致我们的基金净值刷新了最大回撤，虽然本季度总体收益还是不错的，但是期间的波动，还是会给信任我们的投资人带来困扰。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信民安回报一年持有混合 A 基金份额净值为 1.1791 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.10%；安信民安回报一年持有混合 C 基金份额净值为 1.1788 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.09%；同期业绩比较基准收益率为 2.67%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	181,855,117.37	26.03
	其中：股票	181,855,117.37	26.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	434,416,509.86	62.18
	其中：债券	434,416,509.86	62.18
	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	32,994,304.11	4.72
	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	7,447,178.11	1.07
8	其他资产	41,925,382.75	6.00
9	合计	698,638,492.20	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 85,825,395.04 元，占净值比例 13.10%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-



B	采矿业	34,264,088.03	5.23
C	制造业	33,037,999.28	5.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	983,032.00	0.15
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,803.34	0.02
J	金融业	25,285,619.00	3.86
K	房地产业	2,330,639.00	0.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,541.68	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	96,029,722.33	14.66

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	34,893,456.49	5.33
原材料	19,317,219.20	2.95
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	5,052,296.51	0.77
医疗保健	-	-
金融	814,045.83	0.12
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	25,748,377.01	3.93
合计	85,825,395.04	13.10

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00688	中国海外发展	1,793,500	25,748,377.01	3.93

2	00883	中国海洋石油	1,280,362	22,422,674.72	3.42
2	600938	中国海油	65,300	1,962,265.00	0.30
3	600585	海螺水泥	452,700	11,833,578.00	1.81
3	00914	海螺水泥	146,257	3,013,757.34	0.46
4	03323	中国建材	4,697,275	14,486,968.23	2.21
5	000333	美的集团	164,600	12,519,476.00	1.91
6	03668	兖煤澳大利亚	424,200	12,470,781.77	1.90
7	601699	潞安环能	645,200	11,387,780.00	1.74
8	600036	招商银行	283,200	10,651,152.00	1.63
9	000983	山西焦煤	1,045,100	9,991,156.00	1.53
10	002142	宁波银行	302,200	7,766,540.00	1.19

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	317,923,905.30	48.54
	其中：政策性金融债	53,463,668.04	8.16
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）	116,492,604.56	17.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	434,416,509.86	66.32

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	149558	21 国信 06	500,000	51,339,586.30	7.84
2	2420013	24 北京银行 01	500,000	50,951,624.66	7.78
3	180401	18 农发 01	400,000	41,807,409.84	6.38
4	2228037	22 交通银行小微债 01	400,000	40,531,561.64	6.19
5	185393	22 招证 G2	400,000	40,362,597.26	6.16

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-2,768,561.18
国债期货投资本期公允价值变动（元）					1,450,925.12

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金运用国债期货工具调节组合的期限结构以及久期水平。报告期内，产品择机通过国债期货交易，管理产品的利率风险，符合既定的投资策略和投资目标。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

## 在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除 21 国信 06（代码：149558 SZ）、24 北京银行 01（代码：2420013 CY）、22 招证 G2（代码：185393 SH）、24 光大银行债 01（代码：212480005 CY）、兴业转债（代码：113052 SH）、22 银河 G1（代码：185727 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. 国信证券股份有限公司

2024 年 1 月 4 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 4 月 19 日，国信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024 年 5 月 6 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函。

2024 年 5 月 10 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函。

2024 年 7 月 5 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局责令改正、限制从事相关经营活动。

2024 年 8 月 26 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证券交易所监管执行部出具警示函。

### 2. 北京银行股份有限公司

2024 年 2 月 6 日，北京银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局北京监管局罚款。

### 3. 招商证券股份有限公司

2024 年 2 月 2 日，招商证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会安徽监管局出具警示函。

2024 年 2 月 9 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局责令合规检查与报告。

2024 年 4 月 30 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所通报批评。

2024 年 8 月 16 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024 年 9 月 5 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会北京监管局口头警示。

4. 中国光大银行股份有限公司

2024 年 5 月 23 日，中国光大银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

5. 兴业银行股份有限公司

2023 年 10 月 31 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2024 年 1 月 22 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2024 年 7 月 25 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局福建监管局罚款。

6. 中国银河证券股份有限公司

2024 年 1 月 2 日，中国银河证券股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局北京监管局出具警示函。

2024 年 2 月 8 日，中国银河证券股份有限公司因未依法履行职责被中国人民银行罚款。

2024 年 4 月 16 日，中国银河证券股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局北京监管局出具警示函。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,172.43
2	应收证券清算款	40,793,750.54
3	应收股利	1,006,042.68
4	应收利息	-
5	应收申购款	65,417.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	41,925,382.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	24,697,305.26	3.77

2	110085	通 22 转债	7,698,635.28	1.18
3	113053	隆 22 转债	5,841,064.66	0.89
4	110079	杭银转债	5,176,903.88	0.79
5	113050	南银转债	3,368,868.67	0.51
6	113059	福莱转债	3,283,756.95	0.50
7	127040	国泰转债	2,758,116.58	0.42
8	127056	中特转债	2,395,339.71	0.37
9	127073	天赐转债	2,390,810.11	0.37
10	113661	福 22 转债	2,201,229.65	0.34
11	113062	常银转债	1,976,902.73	0.30
12	127089	晶澳转债	1,919,389.82	0.29
13	118034	晶能转债	1,913,701.56	0.29
14	118024	冠宇转债	1,802,543.74	0.28
15	113655	欧 22 转债	1,589,372.13	0.24
16	110089	兴发转债	1,555,094.56	0.24
17	113048	晶科转债	1,534,836.30	0.23
18	110093	神马转债	1,480,172.90	0.23
19	127032	苏行转债	1,381,678.24	0.21
20	113044	大秦转债	1,337,215.70	0.20
21	123149	通裕转债	1,267,159.86	0.19
22	113065	齐鲁转债	1,254,460.40	0.19
23	111010	立昂转债	1,252,784.49	0.19
24	110082	宏发转债	1,241,092.10	0.19
25	127024	盈峰转债	1,218,901.46	0.19
26	127066	科利转债	1,107,172.94	0.17
27	113623	凤 21 转债	1,079,664.30	0.16
28	118042	奥维转债	990,552.15	0.15
29	113666	爱玛转债	989,669.28	0.15
30	123169	正海转债	989,137.10	0.15
31	127027	能化转债	985,815.67	0.15
32	110076	华海转债	932,934.78	0.14
33	113682	益丰转债	920,787.70	0.14
34	113047	旗滨转债	919,242.92	0.14
35	113605	大参转债	841,982.79	0.13
36	111018	华康转债	841,552.37	0.13
37	113677	华懋转债	799,108.52	0.12
38	113644	艾迪转债	782,106.55	0.12
39	113636	甬金转债	750,701.34	0.11
40	113659	莱克转债	749,087.72	0.11
41	113679	芯能转债	741,647.77	0.11
42	123215	铭利转债	725,851.70	0.11
43	127091	科数转债	711,541.21	0.11

44	127085	韵达转债	707,227.42	0.11
45	123174	精锻转债	683,259.13	0.10
46	123115	捷捷转债	674,015.78	0.10
47	123210	信服转债	667,562.39	0.10
48	118005	天奈转债	656,253.47	0.10
49	113650	博 22 转债	644,463.37	0.10
50	123165	回天转债	622,267.83	0.10
51	127016	鲁泰转债	609,433.05	0.09
52	113641	华友转债	609,148.80	0.09
53	128131	崇达转 2	608,777.19	0.09
54	118032	建龙转债	588,679.25	0.09
55	123233	凯盛转债	529,097.05	0.08
56	127082	亚科转债	521,118.26	0.08
57	113640	苏利转债	512,683.51	0.08
58	123151	康医转债	501,385.36	0.08
59	113681	镇洋转债	500,892.18	0.08
60	127031	洋丰转债	478,009.70	0.07
61	123119	康泰转 2	452,373.07	0.07
62	118028	会通转债	443,043.82	0.07
63	127017	万青转债	439,259.63	0.07
64	113675	新 23 转债	436,050.32	0.07
65	123211	阳谷转债	408,660.41	0.06
66	123235	亿田转债	406,109.37	0.06
67	123236	家联转债	366,019.74	0.06
68	127026	超声转债	360,215.51	0.05
69	118038	金宏转债	351,644.53	0.05
70	113676	荣 23 转债	338,312.45	0.05
71	110094	众和转债	332,849.18	0.05
72	123091	长海转债	314,963.26	0.05
73	123117	健帆转债	310,581.90	0.05
74	123114	三角转债	300,394.36	0.05
75	118041	星球转债	296,071.41	0.05
76	127074	麦米转 2	240,933.70	0.04
77	127044	蒙娜转债	234,813.73	0.04
78	127076	中宠转 2	230,937.92	0.04
79	128130	景兴转债	227,459.51	0.03
80	113664	大元转债	223,488.36	0.03
81	113616	韦尔转债	220,720.15	0.03
82	127054	双箭转债	202,205.95	0.03
83	113674	华设转债	200,781.90	0.03
84	113671	武进转债	183,017.96	0.03
85	123237	佳禾转债	139,828.06	0.02

86	118013	道通转债	124,885.28	0.02
87	123120	隆华转债	92,685.62	0.01
88	111011	冠盛转债	60,107.09	0.01
89	123101	拓斯转债	23,318.79	0.00
90	123108	乐普转 2	15,794.73	0.00
91	123178	花园转债	4,909.56	0.00

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信民安回报一年持有混合 A	安信民安回报一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	147,169,366.97	498,565,111.60
报告期期间基金总申购份额	2,395,055.09	2,432,512.59
减：报告期期间基金总赎回份额	27,456,848.09	67,471,219.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	122,107,573.97	433,526,404.55

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

### 9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2024 年 10 月 24 日