

安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资 基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 安信稳健回报 6 个月混合 |
| 基金主代码 | 010819 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 252,238,606.38 份 |
| 投资目标 | 本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 资产配置方面，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。股票投资方面，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，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，在确保资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。此外，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 |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 具进行投资，并在严格控制风险的情况下适当投资于资产支持证券。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×10%+中债综合指数收益率×75% | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信稳健回报 6 个月混合 A | 安信稳健回报 6 个月混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010819 | 010820 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 175,284,722.42 份 | 76,953,883.96 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| | 安信稳健回报 6 个月混合 A | 安信稳健回报 6 个月混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 6,710,082.49 | 2,834,757.12 |
| 2. 本期利润 | 7,621,676.10 | 3,282,042.62 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0355 | 0.0342 |
| 4. 期末基金资产净值 | 185,280,379.23 | 80,965,232.75 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0570 | 1.0521 |

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

安信稳健回报 6 个月混合 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 | 3.48% | 0.25% | -1.90% | 0.31% | 5.38% | -0.06% |
| 过去六个月 | 5.72% | 0.22% | -1.01% | 0.26% | 6.73% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.70% | 0.28% | 0.30% | 0.29% | 5.40% | -0.01% |

安信稳健回报 6 个月混合 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 | 3.32% | 0.25% | -1.90% | 0.31% | 5.22% | -0.06% |
| 过去六个月 | 5.40% | 0.22% | -1.01% | 0.26% | 6.41% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.21% | 0.28% | 0.30% | 0.29% | 4.91% | -0.01% |

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

安信稳健回报6个月混合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



安信稳健回报6个月混合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、本基金合同生效日为2020年12月22日，截止至报告期末本基金合同生效未满一年。

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 | | |
| 钟光正 | 本基金的基金经理，固定收益投资总监 | 2020年12月22日 | - | 17年 | 钟光正先生，经济学硕士。历任广东发展银行总行资金部交易员，招商银行股份有限公司总行资金交易部交易员，长城基金管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理；现任安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信稳健回报6个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 潘巍 | 本基金的基金经理 | 2020年12月22日 | - | 12年 | 潘巍先生，理学硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、信用研究员，中华联合保险控股股份有限公司债 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 券投资经理, 华夏基金管理有限公司专户投资经理, 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。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、的基金经理; 现任安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、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

2021 年三季度国内经济走势逐渐转弱。一方面地产产业链持续走弱，部分房企在紧缩政策之下，开始出现债务危机。目前还需要“稳预期”的政策进一步强化，从而缓和“硬着陆”的风险。另一方面，在供需两端共同作用下，大宗商品价格持续大幅上涨，对中下游企业盈利造成挤压，也增加了通胀预期。我们认为经济层面开始呈现出滞胀的局面，货币政策受限较多。整体而言，未来财政政策的必要性会更大，对合理性的要求也会更高。

在理财资金外溢的环境下，资本市场的流动性始终比较宽裕。在三季度 9 月中旬之前，周期类板块获得了较大的超额收益，但随着通胀预期的不断加剧，周期类板块个股并没有跟随商品继续上涨，反而出现了下跌；相应地，前期表现较差的大盘蓝筹获得了资金的青睐，企稳反弹。资金开始呈现出对未来经济不确定性的防御性心态。

在三季度，本基金严控信用风险，以利率债、中高等级信用债为主，保证组合资产的流动性和变现能力，维持了中低久期。权益方面，在 9 月底进行了适度减仓以降低波动风险，风格方面降低了中小盘个股的权重，力争在控制回撤的基础上获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.0570 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.48%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.0521 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.32%；同期业绩比较基准收益率为-1.90%。

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 | 49,854,990.04 | 15.08 |
| | 其中：股票 | 49,854,990.04 | 15.08 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 267,518,147.30 | 80.90 |
| | 其中：债券 | 267,518,147.30 | 80.90 |
| | 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 | 3,800,000.00 | 1.15 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,559,197.50 | 1.68 |
| 8 | 其他资产 | 3,945,714.40 | 1.19 |
| 9 | 合计 | 330,678,049.24 | 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 157,448.34 元，占净值比例 0.06%。

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 | 2,501,933.48 | 0.94 |
| C | 制造业 | 14,998,404.40 | 5.63 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,543,801.47 | 3.96 |
| E | 建筑业 | 6,348,114.41 | 2.38 |
| F | 批发和零售业 | 10,616.76 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,593,747.74 | 0.97 |
| J | 金融业 | 10,736,300.00 | 4.03 |
| K | 房地产业 | 797,350.00 | 0.30 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,391.91 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,124,170.85 | 0.42 |
| 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 | 29,710.68 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 49,697,541.70 | 18.67 |

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（%） |
|----------|------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 157,448.34 | 0.06 |
| 合计 | 157,448.34 | 0.06 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 6,299,875.22 | 2.37 |
| 2 | 601668 | 中国建筑 | 1,220,000 | 5,856,000.00 | 2.20 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 600,000 | 2,796,000.00 | 1.05 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 110,000 | 2,420,000.00 | 0.91 |
| 5 | 600674 | 川投能源 | 125,000 | 1,796,250.00 | 0.67 |
| 6 | 601577 | 长沙银行 | 200,000 | 1,656,000.00 | 0.62 |
| 7 | 601658 | 邮储银行 | 250,000 | 1,270,000.00 | 0.48 |
| 8 | 603195 | 公牛集团 | 7,400 | 1,208,050.00 | 0.45 |
| 9 | 601225 | 陕西煤业 | 70,000 | 1,036,000.00 | 0.39 |
| 10 | 601688 | 华泰证券 | 60,000 | 1,019,400.00 | 0.38 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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 | 9,001,292.30 | 3.38 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 28,138,318.20 | 10.57 |
| | 其中：政策性金融债 | 6,062,918.20 | 2.28 |
| 4 | 企业债券 | 157,525,104.70 | 59.17 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 34,841,000.00 | 13.09 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 20,169,885.70 | 7.58 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | 17,842,546.40 | 6.70 |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 267,518,147.30 | 100.48 |

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 | 143276 | 17 川电 01 | 200,000 | 20,458,000.00 | 7.68 |
| 2 | 143244 | 17 光大 02 | 200,000 | 20,328,000.00 | 7.64 |
| 3 | 101801317 | 18 鲁高速 | 200,000 | 20,178,000.00 | 7.58 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| | | MTN003 | | | |
| 4 | 122659 | 12 石油 06 | 200,000 | 20,172,000.00 | 7.58 |
| 5 | 152265 | G19 广铁 3 | 200,000 | 20,088,000.00 | 7.54 |

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 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。

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 12 石油 06（证券代码：122659 SH）、浦发转债（证券代码：110059 SH）、20 海通 01（证券代码：163148 SH）、G19 广铁 3（证券代码：152265 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。

2021 年 1 月 19 日，中国石油天然气集团有限公司因涉嫌违反法律法规被武山县市场监管局罚款【（天武）市监行罚[2020]124 号】。

2021 年 4 月 30 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被上海银保监局通知整改，罚款 760 万元【沪银保监罚决字（2021）29 号】。

2021 年 7 月 16 日，上海浦东发展银行股份有限公司因逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款 6920 万元【银保监罚决字（2021）27 号】。

2020 年 12 月 30 日，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证监会警示。

2021 年 1 月 8 日，海通证券股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则、内控管理不到位被中国银行间市场交易商协会警告，通知整改。

2021 年 9 月 9 日，海通证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证监会立案调查【证监立案字 0152021022 号、证监调查字 0152021061 号】。

2021 年 9 月 29 日，海通证券股份有限公司因未履行职责被重庆证监局没收违法所得，整改通知，罚款 400 万元【重庆证监局处罚字[2021]5 号】。

2021 年，海通证券股份有限公司因未依法履行职责、内部制度不完善被上海证监局诫勉谈话、警示、暂停或取消相关资格【沪证监决[2021]40 号、沪证监决[2021]41 号】。

2021 年 5 月 6 日，广州地铁集团有限公司因违反交通法规被广东省交通行政执法局整改通知、罚款 3 万元【粤穗交罚[2021]GS20210112001 号】。

2021 年 6 月，广州地铁集团有限公司因未依法履行职责被广州市规划和自然资源局没收违法所得，罚款 14.45 万元、28.79 万元、184.24 万元、1.81 万元、53.68 万元、2.38 万元、2.50 万元、0.60 万元、10.02 万元、0.60 万元、0.36 万元、2.73 万元、32.11 万元、2.56 万元【云国土行处[2019]509 号、穗规划资源番资罚（2021）27 号、穗规划资源番资罚（2021）28 号、穗规

划资源番资罚（2021）30 号、穗规划资源番资罚（2021）29 号、穗规划资源黄资罚（2020）193 号、穗规划资源黄资罚（2020）194 号、穗规划资源从资罚（2021）10001 号、穗荔规划资源资罚（2021）1 号、穗规划资源从资罚（2021）10001 号、穗规划资源云资罚（2021）02000002 号、穗规划资源云资罚（2021）02000003 号、粤穗交运罚（2021）GS20210112001 号、穗综海处字（2020）第 1500048 号、穗规划资源海资罚（2020）23 号】。

2021 年 8 月 24 日，广州地铁集团有限公司因未依法履行职责被广州市规划和自然资源局没收违法所得，罚款 31.57 万元【穗规划资源黄资罚（2021）96 号】。

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,722,004.89 |
| 5 | 应收申购款 | 223,709.51 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,945,714.40 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 10,391,000.00 | 3.90 |
| 2 | 132004 | 15 国盛 EB | 3,376,934.40 | 1.27 |
| 3 | 132011 | 17 浙报 EB | 2,519,230.00 | 0.95 |
| 4 | 113042 | 上银转债 | 1,356,019.80 | 0.51 |
| 5 | 128130 | 景兴转债 | 371,670.00 | 0.14 |
| 6 | 128081 | 海亮转债 | 311,000.00 | 0.12 |
| 7 | 110043 | 无锡转债 | 177,300.00 | 0.07 |
| 8 | 127020 | 中金转债 | 173,652.00 | 0.07 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|----------------|--------------|----------|
|----|------|------|----------------|--------------|----------|

| | | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|------|
| 1 | 600905 | 三峡能源 | 6,299,875.22 | 2.37 | 新股锁定 |
|---|--------|------|--------------|------|------|

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 | 安信稳健回报 6 个月混合 A | 安信稳健回报 6 个月混合 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 286,723,906.21 | 135,342,316.76 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,497,601.82 | 827,850.72 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 115,936,785.61 | 59,216,283.52 |
| 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 | 175,284,722.42 | 76,953,883.96 |

§ 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稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健回报 6 个月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

2021 年 10 月 26 日