

# 安信新价值灵活配置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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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	安信新价值混合
基金主代码	003026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 19 日
报告期末基金份额总额	33,930,874.12 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超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金以定性研究为主，结合定量分析，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；固定收益类投资方面，本基金将灵活采用品种配置、久期配置、信用配置、回购策略、利率策略等，选择流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种；股票投资方面，本基金秉承价值投资理念，深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司，把握市场定价偏差带来的投资机会；此外，本基金将合理利用权证、股指期货等衍生工具做套保或套利投资，通过投资高质量的资产支持证券实现基金资产增值增厚。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）收益率
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，属于中等

	风险水平的投资品种。 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	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信新价值混合 A	安信新价值混合 C
下属分级基金的交易代码	003026	003027
报告期末下属分级基金的份额总额	5,694,734.80 份	28,236,139.32 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）	
	安信新价值混合 A	安信新价值混合 C
1. 本期已实现收益	-26,874.92	-123,335.25
2. 本期利润	260,077.42	1,263,542.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0437	0.0473
4. 期末基金资产净值	9,882,388.96	48,170,172.99
5. 期末基金份额净值	1.7354	1.7060

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

安信新价值混合 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	2.88%	0.48%	8.20%	0.76%	-5.32%	-0.28%
过去六个月	4.97%	0.39%	7.61%	0.61%	-2.64%	-0.22%
过去一年	8.03%	0.37%	6.60%	0.54%	1.43%	-0.17%

过去三年	13.11%	0.39%	-5.65%	0.54%	18.76%	-0.15%
过去五年	29.24%	0.37%	8.92%	0.58%	20.32%	-0.21%
自基金合同生效起至今	81.14%	0.36%	16.88%	0.57%	64.26%	-0.21%

安信新价值混合 C

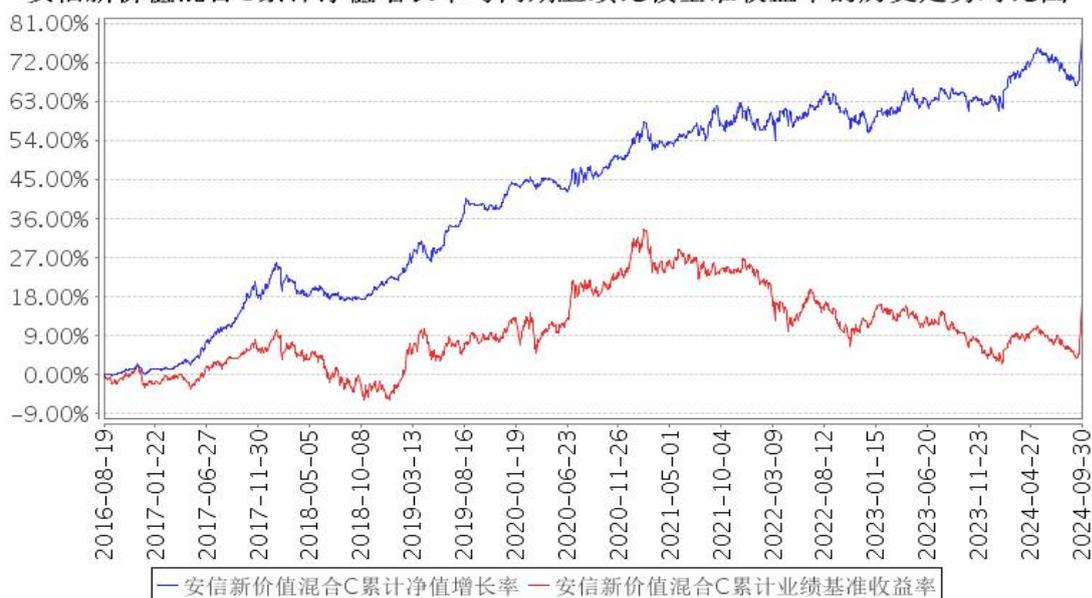
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.82%	0.48%	8.20%	0.76%	-5.38%	-0.28%
过去六个月	4.87%	0.39%	7.61%	0.61%	-2.74%	-0.22%
过去一年	7.82%	0.37%	6.60%	0.54%	1.22%	-0.17%
过去三年	12.43%	0.39%	-5.65%	0.54%	18.08%	-0.15%
过去五年	27.94%	0.37%	8.92%	0.58%	19.02%	-0.21%
自基金合同生效起至今	78.10%	0.36%	16.88%	0.57%	61.22%	-0.21%

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

安信新价值混合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



安信新价值混合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 2016 年 8 月 19 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		
梁冰哲	本基金的基金经理	2021 年 8 月 30 日	-	8 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、安信楚盈一年持有期混合型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	-	21 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、安信基金管理有限公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理

					<p>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、安信尊享添利利率债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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

回顾市场表现来看，3 季度以来上证指数上涨 12.44%，其中 9 月上涨 17.39%；中证转债指数

上涨 0.58%，但经历了较大幅度的波动；国债收益率下行 8bp 录得 2.15。

市场参与者对于未来国内经济景气度的评估仍然是影响大类资产表现最重要的因素。今年 7 月-8 月，受到天气原因、库存问题、短期经济结构转型等诸多因素的共同影响，这一时期市场参与者对于经济的信心偏弱，特别是对于当期经济的信心更弱。具体表现为商品市场出现较大幅度的下跌，长久期利率债持续上涨，受到短期经济周期影响较大的周期类股票出现了明显的调整。在市场普遍比较悲观的时刻，我们相对于市场要乐观一点，主要原因正如我们上次季报里所阐述的：我们认为市场容易将短期问题线性外推转化为对于经济长期悲观的理由，我们对此并不认可。我们一直认为目前经济的状态更多是周期性的原因，是 2020 年、2021 年经济繁荣周期之后出现的供需格局弱化所带来的结果，随着供需格局的改善，经济体自发具有再通胀的能力。如果能够政策助推下更快实现再通胀，那当然是一件更好的事情。

9 月的政治局会议提出“要全面客观冷静看待当前经济形势，正视困难、坚定信心，切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感”，从政策层面直面当前经济所面临的困难，有助于经济更快实现再通胀。政治局会议后，股票市场表现相对较好，债券市场表现相对较弱，反映了市场参与者对于经济前景评估的改变。

市场观点方面，我们认为可转债在此阶段仍然有比较明显的配置价值。如果股票市场能够有所修复，转债之前为人所诟病的信用风险问题将得到一定程度的化解。而股票市场修复的同时，转债所隐含的转股期权具有更大的价值。股票市场短期波动相对较大，我们着重选择其中质地良好、经营稳健、估值合理，能够受益于再通胀环境的公司；尽可能不受市场短期波动的影响。债券方面，我们认为从大类资产配置角度，暂时将以票息回报作为主要考量。

组合在 7-8 月份大幅增加可转债的仓位，主要原因是可转债整体隐含了太悲观的市场预期，甚至全部转债中位数的纯债溢价率都已经远远小于 0。股票方面，我们保持我们一贯的价值投资选股理念，但偏向于能够受益于再通胀环境的公司。债券部分，我们减少了中长债投资，主要原因是中长期国债也隐含了对经济太过悲观的预期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新价值混合 A 基金份额净值为 1.7354 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.88%；安信新价值混合 C 基金份额净值为 1.7060 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.82%；同期业绩比较基准收益率为 8.20%。

#### 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	11,010,610.00	18.69
	其中：股票	11,010,610.00	18.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,023,370.52	59.45
	其中：债券	35,023,370.52	59.45
	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	12,812,573.04	21.75
8	其他资产	65,252.82	0.11
9	合计	58,911,806.38	100.00

### 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	1,438,009.00	2.48
C	制造业	5,662,793.00	9.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	696,960.00	1.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	139,750.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,742,278.00	3.00
K	房地产业	688,092.00	1.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	455,532.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	187,196.00	0.32
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	11,010,610.00	18.97

### 5.2.2 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。

### 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	002078	太阳纸业	98,700	1,488,396.00	2.56
2	601988	中国银行	179,000	895,000.00	1.54
3	601899	紫金矿业	47,800	867,092.00	1.49
4	601398	工商银行	137,100	847,278.00	1.46
5	600309	万华化学	9,200	840,144.00	1.45
6	000598	兴蓉环境	96,000	696,960.00	1.20
7	600885	宏发股份	20,000	651,000.00	1.12
8	600985	淮北矿业	31,700	570,917.00	0.98
9	603259	药明康德	8,700	455,532.00	0.78
10	688036	传音控股	3,700	399,341.00	0.69

### 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	4,077,347.18	7.02
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）	30,946,023.34	53.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,023,370.52	60.33

### 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	113042	上银转债	32,370	3,673,286.41	6.33
2	113037	紫银转债	33,370	3,600,184.16	6.20
3	113052	兴业转债	32,680	3,577,130.42	6.16
4	019693	22 国债 28	27,000	2,752,831.23	4.74

5	113056	重银转债	23,350	2,511,311.69	4.33
---	--------	------	--------	--------------	------

## 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

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

## 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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

## 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上银转债（代码：113042 SH）、兴业转债（代码：113052 SH）、重银转债（代码：113056 SH）、G 三峡 EB2（代码：132026 SH）、中国银行（代码：601988 SH）、华海转债（代码：110076 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. 上海银行股份有限公司

2023 年 11 月 17 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款、责令改正。

2023 年 11 月 27 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局上海市分局罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 29 日，上海银行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上海监管局罚款。

2024 年 6 月 7 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款。

### 2. 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。

### 3. 重庆银行股份有限公司

2024 年 6 月 28 日，重庆银行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重庆监管局罚款。

### 4. 中国长江三峡集团有限公司

2024 年 4 月 30 日，中国长江三峡集团有限公司因涉嫌违反法律法规、噪声污染防治、违反夜间施工作业制度被安徽省六安市裕安区生态环境分局责令改正。

### 5. 中国银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，中国银行股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行警告、罚款、没收违法所得。

2024 年 1 月 5 日，中国银行股份有限公司因信息报送异常不及时整改被国家金融监督管理总局罚款。

2024 年 4 月 3 日，中国银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局北京市分局罚款、没收违法所得。

#### 6. 浙江华海药业股份有限公司

2024 年 4 月 19 日，浙江华海药业股份有限公司因违规使用募集资金被中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	65,252.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	65,252.82

### 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	113042	上银转债	3,673,286.41	6.33
2	113037	紫银转债	3,600,184.16	6.20
3	113052	兴业转债	3,577,130.42	6.16
4	113056	重银转债	2,511,311.69	4.33
5	132026	G 三峡 EB2	2,386,079.08	4.11
6	110082	宏发转债	1,496,186.99	2.58
7	110076	华海转债	892,843.51	1.54
8	118032	建龙转债	762,103.58	1.31
9	113054	绿动转债	733,222.76	1.26
10	113065	齐鲁转债	710,974.83	1.22
11	113021	中信转债	587,460.33	1.01
12	123087	明电转债	577,957.55	1.00

13	113653	永 22 转债	474,939.73	0.82
14	118028	会通转债	437,421.44	0.75
15	127069	小熊转债	360,191.34	0.62
16	123050	聚飞转债	343,969.58	0.59
17	127105	龙星转债	337,212.11	0.58
18	128074	游族转债	331,239.00	0.57
19	113654	永 02 转债	316,424.85	0.55
20	123211	阳谷转债	314,702.47	0.54
21	111018	华康转债	301,981.85	0.52
22	123117	健帆转债	285,086.37	0.49
23	118035	国力转债	280,485.95	0.48
24	128125	华阳转债	279,110.86	0.48
25	113609	永安转债	259,972.64	0.45
26	118018	瑞科转债	249,715.12	0.43
27	128141	旺能转债	243,410.54	0.42
28	118003	华兴转债	235,709.77	0.41
29	110075	南航转债	231,781.00	0.40
30	127017	万青转债	227,473.74	0.39
31	113563	柳药转债	221,097.65	0.38
32	110089	兴发转债	210,747.48	0.36
33	127027	能化转债	184,542.79	0.32
34	123240	楚天转债	156,002.34	0.27
35	118040	宏微转债	151,441.71	0.26
36	123145	药石转债	149,628.83	0.26
37	110062	烽火转债	146,985.02	0.25
38	127087	星帅转 2	145,308.24	0.25
39	113549	白电转债	141,928.86	0.24
40	113662	豪能转债	120,010.13	0.21
41	118030	睿创转债	115,402.23	0.20
42	123218	宏昌转债	114,916.87	0.20
43	127086	恒邦转债	114,573.42	0.20
44	123119	康泰转 2	114,539.47	0.20
45	113069	博 23 转债	111,245.47	0.19
46	123194	百洋转债	97,163.45	0.17
47	123188	水羊转债	95,862.47	0.17
48	123193	海能转债	94,364.68	0.16
49	127074	麦米转 2	89,145.47	0.15
50	123107	温氏转债	81,240.39	0.14
51	123212	立中转债	75,979.56	0.13
52	127062	垒知转债	73,672.37	0.13
53	123090	三诺转债	66,776.47	0.12
54	128128	齐翔转 2	59,497.45	0.10

55	123229	艾录转债	58,606.90	0.10
56	118004	博瑞转债	58,589.65	0.10
57	113631	皖天转债	57,825.01	0.10
58	123059	银信转债	55,606.91	0.10
59	123113	仙乐转债	52,105.18	0.09
60	118025	奕瑞转债	46,219.23	0.08
61	123170	南电转债	38,080.74	0.07
62	128137	洁美转债	31,079.22	0.05
63	123199	山河转债	29,596.23	0.05
64	123233	凯盛转债	25,388.53	0.04
65	123108	乐普转 2	17,900.70	0.03
66	123203	明电转 02	17,765.81	0.03

### 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	安信新价值混合 A	安信新价值混合 C
报告期期初基金份额总额	5,756,952.34	27,771,162.53
报告期期间基金总申购份额	724,888.40	4,788,915.40
减：报告期期间基金总赎回份额	787,105.94	4,323,938.61
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	5,694,734.80	28,236,139.32

## § 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

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	20240701-20240930	16,144,656.12	-	-	16,144,656.12	47.58
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

## 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新价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新价值灵活配置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。

### 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