

安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	15
<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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
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	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43

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 .....	43
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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信鑫安得利混合	
基金主代码	001399	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 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	
报告期末基金份额总额	129,450,648.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信鑫安得利混合 A	安信鑫安得利混合 C
下属分级基金的交易代码	001399	001400
报告期末下属分级基金的份额总额	61,146,243.37 份	68,304,404.89 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，通过多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。资产配置上，考虑经济环境、政策取向、资金供求状况和流动性因素，分析类别资产预期收益和预期风险，根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整；固定收益投资方面，灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略；股票投资上，坚持价值投资理念，重点发掘出价值被市场低估的股票；此外，本基金还辅助性采用衍生品投资策略、风险管理策略和资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率 +3.00%
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。

## 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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	朱广科
	联系电话	0755-82509999	0574-87050338
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		4008-088-088	0574-83895886
传真		0755-82799292	0574-89103213
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		518026	315100
法定代表人		刘入领	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

# § 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	安信鑫安得利混合 A	安信鑫安得利混合 C
本期已实现收益	1,470,980.12	774,395.56
本期利润	2,180,013.80	964,921.02
加权平均基金份 额本期利润	0.0417	0.0211
本期加权平均净	2.89%	1.50%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	3.06%	2.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	20,640,777.88	20,872,816.40
期末可供分配基金份额利润	0.3376	0.3056
期末基金资产净值	86,628,403.69	94,512,879.97
期末基金份额净值	1.4167	1.3837
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	73.32%	69.22%

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

安信鑫安得利混合 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	0.05%	0.05%	0.37%	0.01%	-0.32%	0.04%
过去三个月	0.87%	0.05%	1.12%	0.01%	-0.25%	0.04%
过去六个月	3.06%	0.08%	2.24%	0.02%	0.82%	0.06%
过去一年	3.93%	0.12%	4.51%	0.01%	-0.58%	0.11%
过去三年	9.37%	0.27%	13.51%	0.01%	-4.14%	0.26%

自基金合同生效起 至今	73.32%	0.27%	41.03%	0.01%	32.29%	0.26%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

安信鑫安得利混合 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	0.04%	0.06%	0.37%	0.01%	-0.33%	0.05%
过去三个月	0.81%	0.05%	1.12%	0.01%	-0.31%	0.04%
过去六个月	2.96%	0.08%	2.24%	0.02%	0.72%	0.06%
过去一年	3.73%	0.12%	4.51%	0.01%	-0.78%	0.11%
过去三年	8.74%	0.27%	13.51%	0.01%	-4.77%	0.26%
自基金合同生效起 至今	69.22%	0.27%	41.03%	0.01%	28.19%	0.26%

注：本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率 +3.00%。

### 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

安信鑫安得利混合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





安信鑫安得利混合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 2015 年 6 月 5 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，国投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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 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、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 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		
应隽	本基金的基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	17 年	应隽女士，管理学硕士，历任中国农业银行股份有限公司金融市场部投资经理，东兴证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信宏盈 18 个月持有期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、安信鑫安得利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的基金经理。
张明	本基金的基金经理，价值投资部副总经理	2022 年 6 月 23 日	-	13 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、价值投资部总经理助理。现任安信基金管理有限责任公司价值投资部副总经理。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、安信红利精选混合型证券投资基金的基金经理。
宛晴	本基金的基金经理助理	2023 年 10 月 11 日	-	11 年	宛晴女士，工商管理硕士，历任东兴证券股份有限公司资产管理业务总部交易员、交易主管、投资经理助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信新目标灵活配置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、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信鑫安得利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、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理；安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）、安信华享纯债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。

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

我们的股票投资一直坚持自下而上的投资思路，在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间和行业竞争格局的背景下，结合估值水平，在“好价格”下买入并持有“好公司”，长期获得企业内在价值增长的收益。

2024 年上半年，经济数据总体前高后低，近期 PMI、发电量和社零数据显示国内经济增长动能边际有所减弱。上半年，国内地产销售继续下行但边际有降幅改善，核心城市二手房以价换量贡献明显，这主要得益于 5 月中旬以后核心城市限购限贷政策的放松。展望下半年，由于基数效应，地产销售可能继续改善。

上半年权益市场震荡分化，中证红利、沪深 300 指数表现相对较好，创业板指、中证 500 指数表现较弱，微盘股指数跌幅明显。分行业来看，银行、煤炭、公用事业、家电、石油石化等行业表现较好，计算机、商贸零售、社服、传媒、医药等行业表现较差。

具体来看，我们继续看好低估值、高盈利、高股息板块的投资机会，主要集中在银行、煤炭、建筑建材、纺织服饰、交运、家电等行业的公司。一些成长板块的公司经过前期调整也进入了观察区间，但需要注意这些板块公司未来盈利可能低于预期的风险，结合估值我们会比较谨慎地逐步提高观察力度。

债券市场方面，上半年资金面延续宽松，受市场对经济的预期偏弱、政府债供给偏慢、禁止“手工补息”后部分资金转向债券市场等因素影响，债券配置需求较强，收益率大幅下行至历史低位，信用利差明显收窄。本基金债券仓位仍以利率债和优质信用债为主要投资方向，一季度维持偏高久期，获取了一定的资本利得收益；二季度适当降低了久期，并择机进行了债券波段交易。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信鑫安得利混合 A 基金份额净值为 1.4167 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.06%;安信鑫安得利混合 C 基金份额净值为 1.3837 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.96%;同期业绩比较基准收益率为 2.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面,今年以来市场指数震荡分化,我们维持年初的判断,认为当下依然很可能是未来 3-5 年股票投资很好的时点。无论是沪深 300 指数还是中证红利指数的估值依然处于历史相对低位。上半年市场大幅波动过程中,我们积极坚持自下而上找寻优质股票错误定价的机会。自下而上来看,我们发现无论 A 股还是港股,多个行业均有十分优秀的公司,其竞争优势依然显著,市场份额有机会持续提升,这一部分企业的投资价值值得我们把握,例如银行、纺织服饰、煤炭、建筑建材、交运、家电等行业的优秀公司。

近期由于地产政策的调整,特别是核心一线城市的限购限贷政策放松,我们提高了地产为代表的顺周期板块的关注度,但后续全国范围的地产销售企稳仍然具有不确定性,我们总体策略还是密切保持跟踪,不做过早预判。

再次,上半年小市值股票下跌明显并且中间伴随大幅波动,我们从自下而上研究企业价值的角度,对部分小盘价值股票也有关注。关键是从业绩增长确定性的角度,找到一些未来经营业绩能持续增长的公司,如果在估值性价比明显占优的情况下,我们会提高关注力度。

债券方面,美联储降息有望在下半年落地,对其他国家货币政策产生的制约会大大减弱。国内方面,李强总理在达沃斯论坛强调“固本培元”的政策思路,我们预计,下半年可能会有更加积极的财政和货币政策出台,并仍然坚持高质量发展的方向。下半年资金面仍以宽松为主,利率债有供给压力,相对而言信用债的供需格局更为有利。在债券收益率整体处于较低位置的情况下,后续震荡幅度或将加大,我们将视资金情况动态调整产品杠杆,维持一定的交易性仓位。

#### 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

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 7,343,934.38 元，其中本基金 A 类分配金额为 4,061,374.62 元，C 类分配金额为 3,282,559.76 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 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

本报告期内，本托管人在安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,105,918.69	124,058.73
结算备付金		537,527.33	7,943.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	201,913,080.20	54,155,329.53
其中：股票投资		8,596,705.06	6,806,957.38
基金投资		-	-
债券投资		193,316,375.14	47,348,372.15
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	4,170,000.00	21,303,105.66
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		466,023.32	5,039.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		213,192,549.54	75,595,476.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		25,031,142.33	-
应付清算款		-	-



应付赎回款		6,790,315.56	92,273.43
应付管理人报酬		126,188.99	62,446.63
应付托管费		15,773.63	7,805.83
应付销售服务费		17,382.62	9,182.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,955.81	3,775.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	68,506.94	152,220.00
负债合计		32,051,265.88	327,703.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	129,450,648.26	52,887,738.24
未分配利润	6.4.7.8	51,690,635.40	22,380,035.54
净资产合计		181,141,283.66	75,267,773.78
负债和净资产总计		213,192,549.54	75,595,476.79

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 129,450,648.26 份，其中安信鑫安得利混合 A 基金份额总额 61,146,243.37 份，基金份额净值 1.4167 元；安信鑫安得利混合 C 基金份额总额 68,304,404.89 份，基金份额净值 1.3837 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,902,150.88	2,702,337.44
1. 利息收入		319,273.73	178,652.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	45,809.21	23,480.91
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		273,464.52	155,171.23
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,508,846.22	1,024,549.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	51,767.94	289,040.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,242,473.89	506,191.97
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
投资收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-854.00	-
股利收益	6.4.7.15	215,458.39	229,316.96
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	899,559.14	1,248,594.64
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	174,471.79	250,541.24
<b>减：二、营业总支出</b>		757,216.06	447,376.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	548,444.98	299,797.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,555.60	37,474.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	62,230.81	27,596.79
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,224.24	260.82
其中：卖出回购金融资产支出		10,224.24	260.82
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,446.45	848.05
8. 其他费用	6.4.7.19	66,313.98	81,398.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,144,934.82	2,254,960.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,144,934.82	2,254,960.77
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,144,934.82	2,254,960.77

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	52,887,738.24	-	22,380,035.54	75,267,773.78
二、本期期初净	52,887,738.24	-	22,380,035.54	75,267,773.78

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	76,562,910.02	-	29,310,599.86	105,873,509.88
(一)、综合收益总额	-	-	3,144,934.82	3,144,934.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	76,562,910.02	-	33,509,599.42	110,072,509.44
其中：1. 基金申购款	235,444,198.91	-	99,535,501.90	334,979,700.81
2. 基金赎回款	-158,881,288.89	-	-66,025,902.48	-224,907,191.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-7,343,934.38	-7,343,934.38
四、本期期末净资产	129,450,648.26	-	51,690,635.40	181,141,283.66
项目	上年度可比期间			
	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	106,169,356.21	-	47,083,404.59	153,252,760.80
二、本期期初净资产	106,169,356.21	-	47,083,404.59	153,252,760.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-69,192,291.54	-	-29,098,124.06	-98,290,415.60
(一)、综合收益总额	-	-	2,254,960.77	2,254,960.77
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-69,192,291.54	-	-31,353,084.83	-100,545,376.37
其中：1. 基金申购款	8,764,204.01	-	4,019,552.05	12,783,756.06
2. 基金赎回款	-77,956,495.55	-	-35,372,636.88	-113,329,132.43

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	36,977,064.67	-	17,985,280.53	54,962,345.20

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

安信鑫安得利灵活配置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”）2015 年 5 月 18 日下发的证监许可[2015]924 号文“关于准予安信鑫安得利灵活配置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《安信鑫安得利灵活配置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 2015 年 6 月 1 日至 2015 年 6 月 2 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(2015)验字 60962175\_H64 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,495,462,744.08 份，其中认购资金利息折合 72,200.06 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，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。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

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上市的股票、存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（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：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货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、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率 +3.00%。

#### 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

## （2）增值税及附加

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## （3）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。

(4) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,862,404.04
等于：本金	5,861,569.06
加：应计利息	834.98
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	243,514.65
等于：本金	243,072.83
加：应计利息	441.82
减：坏账准备	-
合计	6,105,918.69

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	8,706,410.17	-	8,596,705.06	-109,705.11	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	65,078,230.80	629,097.71	65,713,141.01	5,812.50
	银行间市场	125,648,553.59	1,176,134.13	127,603,234.13	778,546.41
	合计	190,726,784.39	1,805,231.84	193,316,375.14	784,358.91
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	199,433,194.56	1,805,231.84	201,913,080.20	674,653.80	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,170,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,170,000.00	-



#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本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

本基金于本期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,922.88
其中：交易所市场	-
银行间市场	6,922.88
应付利息	-
应付信息披露费	39,781.56
应付审计费	12,432.42
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	68,506.94

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信鑫安得利混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,187,807.08	26,187,807.08
本期申购	51,683,826.99	51,683,826.99
本期赎回（以“-”号填列）	-16,725,390.70	-16,725,390.70
本期末	61,146,243.37	61,146,243.37

##### 安信鑫安得利混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,699,931.16	26,699,931.16
本期申购	183,760,371.92	183,760,371.92
本期赎回（以“-”号填列）	-142,155,898.19	-142,155,898.19
本期末	68,304,404.89	68,304,404.89

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信鑫安得利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,780,129.38	1,725,495.48	11,505,624.86
本期期初	9,780,129.38	1,725,495.48	11,505,624.86
本期利润	1,470,980.12	709,033.68	2,180,013.80
本期基金份额交易产生的变动数	13,451,043.00	2,406,853.28	15,857,896.28
其中：基金申购款	19,827,264.15	3,732,914.48	23,560,178.63
基金赎回款	-6,376,221.15	-1,326,061.20	-7,702,282.35
本期已分配利润	-4,061,374.62	-	-4,061,374.62
本期末	20,640,777.88	4,841,382.44	25,482,160.32

安信鑫安得利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,132,659.19	1,741,751.49	10,874,410.68
本期期初	9,132,659.19	1,741,751.49	10,874,410.68
本期利润	774,395.56	190,525.46	964,921.02
本期基金份额交易产生的变动数	14,248,321.41	3,403,381.73	17,651,703.14
其中：基金申购款	61,634,326.09	14,340,997.18	75,975,323.27
基金赎回款	-47,386,004.68	-10,937,615.45	-58,323,620.13
本期已分配利润	-3,282,559.76	-	-3,282,559.76
本期末	20,872,816.40	5,335,658.68	26,208,475.08

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	7,595.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,775.92
结算备付金利息收入	30,437.72
其他	-
合计	45,809.21

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,482,137.00

减：卖出股票成本总额	3,421,960.29
减：交易费用	8,408.77
买卖股票差价收入	51,767.94

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,436,323.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	806,150.88
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	2,242,473.89

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	281,633,616.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,546,589.02
减：应计利息总额	3,271,677.55
减：交易费用	9,199.25
买卖债券差价收入	806,150.88

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	-854.00

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	215,458.39
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	215,458.39

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	899,559.14
股票投资	204,734.97
债券投资	694,824.17
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	899,559.14

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	132,515.23
基金转换费收入	41,956.56
合计	174,471.79

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	12,432.42
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	14,100.00

合计	66,313.98
----	-----------

#### 6.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 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

本基金的基金管理人于 2024 年 7 月 2 日宣告 2024 年度第二次分红，向截至 2024 年 7 月 3 日止在本基金注册登记人安信基金管理有限责任公司登记在册的本基金份额持有人派发红利。A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.609 元，C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.595 元。

截至本财务报表批准报出日，除上述事项外，本基金无其他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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	548,444.98	299,797.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,296.96	55,799.33
应支付基金管理人的净管理费	456,148.02	243,998.54

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的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	68,555.60	37,474.69

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的基金资产净值 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信鑫安得利混合 A	安信鑫安得利混合 C	合计
安信基金	-	21,476.09	21,476.09
国投证券	-	16.80	16.80
宁波银行	-	126.37	126.37
合计	-	21,619.26	21,619.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	安信鑫安得利混合 A	安信鑫安得利混合 C	合计
安信基金	-	14,208.93	14,208.93
国投证券	-	5.43	5.43
宁波银行	-	129.49	129.49
合计	-	14,343.85	14,343.85

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 类基金份额销售服务费年费率为 0.20%。本基金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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
宁波银行	5,862,404.04	7,595.57	214,547.99	11,520.92

注：本基金的活期银行存款由托管人宁波银行保管，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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

安信鑫安得利混合 A							
序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024年4月24日	2024年4月24日	0.6650	3,982,221.75	79,152.87	4,061,374.62	-
合计	-	-	0.6650	3,982,221.75	79,152.87	4,061,374.62	-
安信鑫安得利混合 C							
序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024年4月24日	2024年4月24日	0.6500	3,133,995.49	148,564.27	3,282,559.76	-



	日	日					
合计	-	-	0.6500	3,133,995.49	148,564.27	3,282,559.76	-

#### 6.4.12 期末（2024 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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本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 2024 年 6 月 30 日止，本基金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 25,031,142.33 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
240004	24 付息国债 04	2024 年 7 月 1 日	101.83	200,000	20,365,983.52
240205	24 国开 05	2024 年 7 月 1 日	103.94	58,000	6,028,375.79
合计				258,000	26,394,359.31

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无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，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

本基金于本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割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 2024 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 77.28%（2023 年 12 月 31 日：45.04%）。

##### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,067,409.23	15,097,584.91
合计	18,067,409.23	15,097,584.91

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	109,458,819.46	8,982,425.65
AAA 以下	9,504,712.98	14,044,703.93
未评级	56,285,433.47	9,223,657.66
合计	175,248,965.91	32,250,787.24

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。货币资金、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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,105,918.69	-	-	-	6,105,918.69
结算备付金	537,527.33	-	-	-	537,527.33
交易性金融资产	32,375,151.85	93,010,274.14	67,930,949.15	8,596,705.06	201,913,080.20
买入返售金融资产	4,170,000.00	-	-	-	4,170,000.00
应收申购款	-	-	-	466,023.32	466,023.32
资产总计	43,188,597.87	93,010,274.14	67,930,949.15	9,062,728.38	213,192,549.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,790,315.56	6,790,315.56
应付管理人报酬	-	-	-	126,188.99	126,188.99
应付托管费	-	-	-	15,773.63	15,773.63
卖出回购金融资产款	25,031,142.33	-	-	-	25,031,142.33
应付销售服务费	-	-	-	17,382.62	17,382.62
应交税费	-	-	-	1,955.81	1,955.81
其他负债	-	-	-	68,506.94	68,506.94
负债总计	25,031,142.33	-	-	7,020,123.55	32,051,265.88
利率敏感度缺口	18,157,455.54	93,010,274.14	67,930,949.15	2,042,604.83	181,141,283.66
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	124,058.73	-	-	-	124,058.73

结算备付金	7,943.61	-	-	-	7,943.61
交易性金融资产	32,190,140.02	6,963,846.70	8,194,385.43	6,806,957.38	54,155,329.53
买入返售金融资产	21,303,105.66	-	-	-	21,303,105.66
应收申购款	-	-	-	5,039.26	5,039.26
资产总计	53,625,248.02	6,963,846.70	8,194,385.43	6,811,996.64	75,595,476.79
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	92,273.43	92,273.43
应付管理人报酬	-	-	-	62,446.63	62,446.63
应付托管费	-	-	-	7,805.83	7,805.83
应付销售服务费	-	-	-	9,182.11	9,182.11
应交税费	-	-	-	3,775.01	3,775.01
其他负债	-	-	-	152,220.00	152,220.00
负债总计	-	-	-	327,703.01	327,703.01
利率敏感度缺口	53,625,248.02	6,963,846.70	8,194,385.43	6,484,293.63	75,267,773.78

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		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,902,931.67	430,023.67
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,866,231.03	-409,225.42

#### 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。本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货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、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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	8,596,705.06	4.75	6,806,957.38	9.04
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	8,596,705.06	4.75	6,806,957.38	9.04

#### 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		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		345,855.45
2. 沪深 300 指数下降 5%		-345,855.45	-285,710.91

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	16,381,331.44	19,949,616.30
第二层次	185,531,748.76	34,205,713.23
第三层次	-	-
合计	201,913,080.20	54,155,329.53

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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	8,596,705.06	4.03
	其中：股票	8,596,705.06	4.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,316,375.14	90.68
	其中：债券	193,316,375.14	90.68
	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	4,170,000.00	1.96
	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	6,643,446.02	3.12
8	其他各项资产	466,023.32	0.22
9	合计	213,192,549.54	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	-	-
B	采矿业	546,280.00	0.30
C	制造业	4,315,123.80	2.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	408,870.00	0.23
F	批发和零售业	611,714.26	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	243,680.00	0.13
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	1,760,737.00	0.97
K	房地产业	297,840.00	0.16
L	租赁和商务服务业	122,600.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	289,860.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	8,596,705.06	4.75

### 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	601668	中国建筑	77,000	408,870.00	0.23
2	600585	海螺水泥	16,000	377,440.00	0.21
3	601939	建设银行	50,000	370,000.00	0.20
4	601398	工商银行	60,000	342,000.00	0.19
5	000858	五粮液	2,500	320,100.00	0.18
6	600036	招商银行	9,300	317,967.00	0.18
7	002867	周大生	24,021	313,714.26	0.17
8	601088	中国神华	7,000	310,590.00	0.17
9	600048	保利发展	34,000	297,840.00	0.16
10	600612	老凤祥	5,000	290,950.00	0.16
11	600919	江苏银行	39,000	289,770.00	0.16
12	002508	老板电器	13,000	287,300.00	0.16
13	300750	宁德时代	1,560	280,846.80	0.16
14	600309	万华化学	3,300	266,838.00	0.15
15	600176	中国巨石	24,000	265,200.00	0.15
16	601288	农业银行	55,000	239,800.00	0.13
17	601699	潞安环能	13,000	235,690.00	0.13
18	600729	重庆百货	10,000	223,600.00	0.12
19	000513	丽珠集团	5,500	204,655.00	0.11
20	600233	圆通速递	12,000	187,800.00	0.10
21	600373	中文传媒	12,000	178,080.00	0.10
22	002233	塔牌集团	24,000	175,440.00	0.10
23	000333	美的集团	2,600	167,700.00	0.09
24	000786	北新建材	5,000	148,300.00	0.08
25	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.08
26	000792	盐湖股份	8,000	139,600.00	0.08
27	002078	太阳纸业	9,000	125,550.00	0.07
28	600801	华新水泥	9,000	123,750.00	0.07
29	002818	富森美	10,000	122,600.00	0.07
30	603218	日月股份	11,000	112,970.00	0.06
31	601098	中南传媒	9,000	111,780.00	0.06

32	603365	水星家纺	7,000	109,550.00	0.06
33	600019	宝钢股份	16,000	106,400.00	0.06
34	601825	沪农商行	15,000	100,800.00	0.06
35	601077	渝农商行	20,000	100,400.00	0.06
36	000581	威孚高科	6,000	97,680.00	0.05
37	605338	巴比食品	7,000	92,750.00	0.05
38	603279	景津装备	4,000	86,760.00	0.05
39	603886	元祖股份	5,000	75,300.00	0.04
40	301177	迪阿股份	4,000	74,400.00	0.04
41	002007	华兰生物	4,500	71,055.00	0.04
42	600012	皖通高速	4,000	55,880.00	0.03
43	600398	海澜之家	6,000	55,440.00	0.03
44	000726	鲁泰 A	8,000	52,960.00	0.03
45	603896	寿仙谷	2,000	46,940.00	0.03
46	603517	绝味食品	3,000	46,200.00	0.03
47	000708	中信特钢	3,000	40,710.00	0.02

## 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	601699	潞安环能	332,606.00	0.44
2	600919	江苏银行	315,240.00	0.42
3	600729	重庆百货	268,521.00	0.36
4	000858	五粮液	217,356.00	0.29
5	002233	塔牌集团	212,250.00	0.28
6	600309	万华化学	202,409.00	0.27
7	600373	中文传媒	184,938.00	0.25
8	600176	中国巨石	180,940.00	0.24
9	601398	工商银行	177,350.00	0.24
10	600048	保利发展	172,714.00	0.23
11	601668	中国建筑	159,720.00	0.21
12	002867	周大生	147,906.00	0.20
13	000786	北新建材	143,956.00	0.19
14	603218	日月股份	139,329.00	0.19
15	603365	水星家纺	128,173.00	0.17
16	600801	华新水泥	123,265.00	0.16
17	600036	招商银行	109,197.00	0.15
18	605338	巴比食品	103,686.00	0.14
19	601825	沪农商行	103,200.00	0.14
20	000581	威孚高科	102,922.00	0.14

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	278,260.00	0.37
2	600048	保利发展	268,467.00	0.36
3	002508	老板电器	225,325.00	0.30
4	002867	周大生	197,118.00	0.26
5	601939	建设银行	176,020.00	0.23
6	000333	美的集团	174,031.00	0.23
7	600519	贵州茅台	171,810.00	0.23
8	002078	太阳纸业	158,644.00	0.21
9	601318	中国平安	152,946.00	0.20
10	601088	中国神华	136,773.00	0.18
11	002372	伟星新材	130,081.00	0.17
12	600036	招商银行	128,226.00	0.17
13	600276	恒瑞医药	104,815.00	0.14
14	601186	中国铁建	99,770.00	0.13
15	601009	南京银行	99,000.00	0.13
16	002727	一心堂	98,051.00	0.13
17	600585	海螺水泥	96,673.00	0.13
18	601012	隆基绿能	85,912.00	0.11
19	002415	海康威视	85,825.00	0.11
20	601398	工商银行	85,740.00	0.11

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	5,006,973.00
卖出股票收入（成交）总额	3,482,137.00

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	42,933,314.45	23.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	97,389,665.02	53.76

	其中：政策性金融债	10,393,751.37	5.74
4	企业债券	20,945,585.83	11.56
5	企业短期融资券	6,968,060.03	3.85
6	中期票据	17,295,123.43	9.55
7	可转债（可交换债）	7,784,626.38	4.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,316,375.14	106.72

## 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	240004	24 附息国债 04	200,000	20,365,983.52	11.24
2	240205	24 国开 05	100,000	10,393,751.37	5.74
3	212380008	23 交行债 01	100,000	10,361,443.72	5.72
4	2328021	23 兴业银行 小微债 01	100,000	10,324,219.67	5.70
5	2320006	23 广州银行 绿色债 01	100,000	10,269,816.44	5.67

## 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。

## 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

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，力求实现所资产的长期稳定增值。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本期通过国债期货对持仓的长久期债券进行套期保值，符合既定的投资策略和投资目标。

## 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 23 交行债 01（代码：212380008 CY）、23 兴业银行小微债 01（代码：2328021 CY）、23 广州银行绿色债 01（代码：2320006 CY）、22 中证 01（代码：185360 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. 交通银行股份有限公司

2024 年 6 月 21 日，交通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。

#### 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。

#### 3. 广州银行股份有限公司

2023 年 8 月 31 日，广州银行股份有限公司因违反反洗钱法、违规经营被中国人民银行广东省分行警告、罚款。

2023 年 11 月 22 日，广州银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局广东监管局罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 27 日，广州银行股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市税务局第三税务分局采取行政监管措施。

#### 4. 中信证券股份有限公司

2023 年 7 月 13 日，中信证券股份有限公司因违规经营被中国证券监督管理委员会深圳监管局监管警示。

2023 年 8 月 29 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所书面警示。

2023 年 9 月 25 日，中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监管警示、

书面警示。

2023 年 9 月 28 日，中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监管约谈。

2024 年 1 月 12 日，中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监管警示。

2024 年 4 月 13 日，中信证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2024 年 4 月 19 日，中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警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2024 年 4 月 30 日，中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监管罚款、没收违法所得。

2024 年 4 月 30 日，中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 5 月 10 日，中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。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	466,023.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	466,023.32

### 7.12.4 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	110064	建工转债	2,454,840.16	1.36
2	127059	永东转 2	1,915,453.97	1.06
3	127024	盈峰转债	706,127.29	0.39
4	123126	瑞丰转债	661,199.34	0.37
5	127022	恒逸转债	613,251.45	0.34
6	113046	金田转债	416,528.22	0.23
7	110059	浦发转债	409,121.62	0.23
8	110081	闻泰转债	396,408.99	0.22
9	113048	晶科转债	211,695.34	0.12

### 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 (%)
安信鑫安得利混合 A	480	127,388.01	49,927,567.67	81.65	11,218,675.70	18.35
安信鑫安得利混合 C	2,345	29,127.68	0.00	0.00	68,304,404.89	100.00
合计	2,795	46,315.08	49,927,567.67	38.57	79,523,080.59	61.43

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	安信鑫安得利混合 A	6.80	0.00

理人所有从业人员持有本基金	安信鑫安得利混合 C	20.91	0.00
	合计	27.71	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持有本开放式基金	安信鑫安得利混合 A	0
	安信鑫安得利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信鑫安得利混合 A	0
	安信鑫安得利混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信鑫安得利混合 A	安信鑫安得利混合 C
基金合同生效日 (2015年6月5日) 基金份额总额	565,463,288.15	1,929,999,455.93
本报告期期初基金份额总额	26,187,807.08	26,699,931.16
本报告期基金总申购份额	51,683,826.99	183,760,371.92
减：本报告期基金总赎回份额	16,725,390.70	142,155,898.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	61,146,243.37	68,304,404.89



## § 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

本报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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、基金托管人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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已完成整改
其他	无

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
开源证券	2	8,489,110.00	100.00	6,123.24	100.00	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金管理人制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序规定。基金管理人综合考虑券商的研究能力后，确定证券公司的选择，并与被选择的证券公司签订协议。

#### 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 (%)
开源证券	192,001,095.40	100.00	2,523,420,000.00	100.00	-	-

### 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提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日
2	关于恢复安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券日报	2024 年 1 月 5 日
3	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 19 日
5	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中航证券有限公	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日

	司为基金销售服务机构的公告		
6	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麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
7	关于暂停安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券日报	2024 年 3 月 22 日
8	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年年度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 28 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 19 日
11	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
12	关于安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第一次分红的公告	证券日报	2024 年 4 月 23 日
13	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 26 日
14	关于恢复安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券日报	2024 年 5 月 10 日
15	关于暂停安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券日报	2024 年 6 月 21 日

## § 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	20240101-20240109	20,363,833.83	-	20,363,833.83	-	-
	2	20240320-20240320	-	20,778,446.11	20,778,446.11	-	-
	3	20240312-20240320	-	20,888,455.65	20,888,455.65	-	-

	4	20240418-20240510	-	27,849,335.10	27,849,335.10	-	-
	5	20240108-20240321-20240630	-	47,758,912.02	-	47,758,912.02	36.89

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鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信鑫安得利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。

12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

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

2024 年 8 月 29 日