

安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 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

报告送出日期：2026 年 7 月 20 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约定，于 2026 年 7 月 17 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                         |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                                                                                                                                                                                          |
| 报告期末基金份额总额 | 99,695,661.34 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       | 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。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 | 47,244,813.94 份                                                            | 52,450,847.40 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（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |               |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
|                 | 安信鑫安得利混合 A                            | 安信鑫安得利混合 C    |
| 1. 本期已实现收益      | 210,170.81                            | 465,542.42    |
| 2. 本期利润         | -344,507.34                           | -406,680.76   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0107                               | -0.0055       |
| 4. 期末基金资产净值     | 54,550,738.69                         | 58,916,894.55 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1546                                | 1.1233        |

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

安信鑫安得利混合 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 | -0.65% | 0.08%     | 1.12%      | 0.01%         | -1.77% | 0.07% |
| 过去六个月 | -0.07% | 0.08%     | 2.23%      | 0.02%         | -2.30% | 0.06% |
| 过去一年  | 0.28%  | 0.07%     | 4.50%      | 0.01%         | -4.22% | 0.06% |
| 过去三年  | 7.48%  | 0.09%     | 13.51%     | 0.01%         | -6.03% | 0.08% |

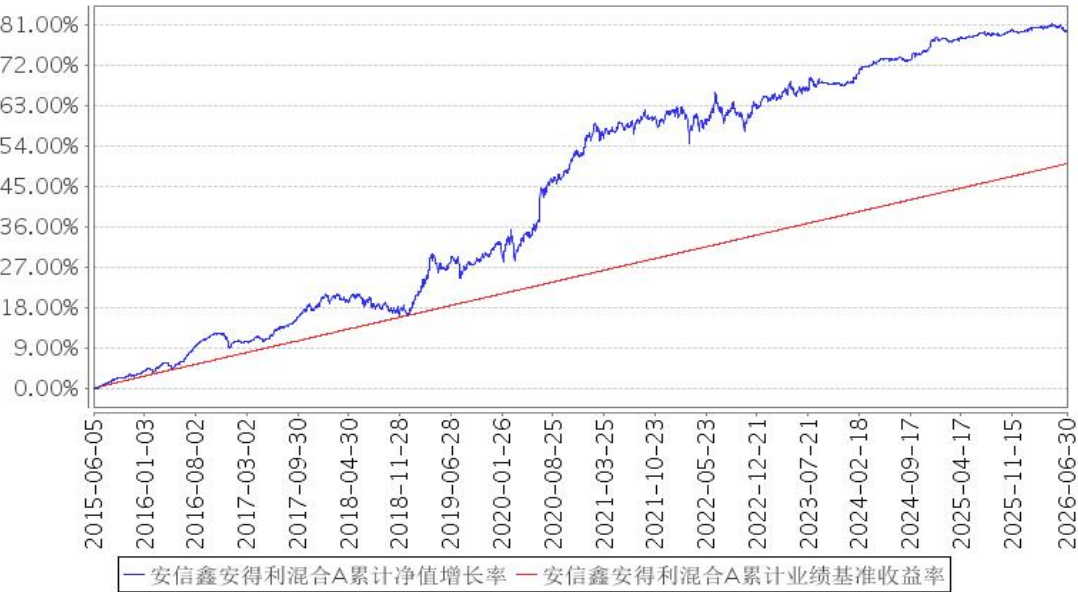
|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年           | 13.11% | 0.21% | 22.51% | 0.01% | -9.40% | 0.20% |
| 过去七年           | 39.68% | 0.26% | 31.52% | 0.01% | 8.16%  | 0.25% |
| 过去十年           | 66.89% | 0.26% | 45.02% | 0.01% | 21.87% | 0.25% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 79.24% | 0.25% | 50.03% | 0.01% | 29.21% | 0.24% |

安信鑫安得利混合 C

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③     | ②－④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -0.70% | 0.08%         | 1.12%          | 0.01%                 | -1.82%  | 0.07% |
| 过去六个月          | -0.16% | 0.08%         | 2.23%          | 0.02%                 | -2.39%  | 0.06% |
| 过去一年           | 0.10%  | 0.07%         | 4.50%          | 0.01%                 | -4.40%  | 0.06% |
| 过去三年           | 6.85%  | 0.09%         | 13.51%         | 0.01%                 | -6.66%  | 0.08% |
| 过去五年           | 12.02% | 0.21%         | 22.51%         | 0.01%                 | -10.49% | 0.20% |
| 过去七年           | 37.79% | 0.26%         | 31.52%         | 0.01%                 | 6.27%   | 0.25% |
| 过去十年           | 63.53% | 0.26%         | 45.02%         | 0.01%                 | 18.51%  | 0.25% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 74.33% | 0.25%         | 50.03%         | 0.01%                 | 24.30%  | 0.24% |

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、本基金合同约定，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 |        |                                     |
| 张明 | 本基金的基金经 | 2022 年 6 月 23 日 | —    | 15 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研究部研究 |

|    |                     |                    |   |      |                                                                                                                                                                                                                                  |
|----|---------------------|--------------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 理，价值<br>投资部副<br>总经理 |                    |   |      | 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的基金经理助理；安信企业价值优选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、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、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、安信优选价值混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 应隽 | 本基金的<br>基金经理        | 2022 年 6 月 23<br>日 | - | 19 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、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信锦顺利率债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会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

我们的股票投资策略是坚持自下而上的选股思路，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”，长期获得估值均值回归和企业内在价值增长的收益。

2026 年二季度 A 股市场震荡上涨，市场成交活跃，季度成交额再创历史新高，沪深 300 指数上涨超过 10%，创业板指大幅上涨，红利价值板块和微盘股表现低迷，成长与价值风格分化明显。分行业来看，电子、通信、建材、机械等行业表现较好，石油石化、农业、钢铁、商贸零售等行业表现较弱。

二季度宏观经济运行平稳，制造业 PMI 连续 3 个月均保持在 50 以上，发电量继续平稳增长。二季度内需总体有边际走弱，国内社零消费出现单月下滑，地产销售环比一季度也有所走弱，出口依然表现相对亮眼。流动性继续保持宽裕，十年期国债收益率小幅下行至 1.7% 左右，人民币汇率继续有小幅升值。中东局势有阶段性缓和，美伊谈判达成谅解备忘录，但达成永久性的停战协定还有待时日，油价高位回落，全球通胀预期有所减弱，全球各国市场关注焦点逐渐集中到科技 AI 板块。

二季度市场行情走势比较极致，以电子、通信为代表的科技板块继续大幅上涨，部分公司估值创出历史新高。同时我们也看到 A 股出现一批价值类股票持续走低，估值和总市值甚至处于历史新低状态。短期我们无法判断这种割裂状态将持续多久，但从自下而上角度，中期来看部分价值股已经处于非常有吸引力的位置，这种吸引力指的是即使考虑未来行业需求持续走弱，这些公司的账上现金和经营利润相比当前市值依然能够有较好的安全边际。叠加当前十年期国债收益率仍处于相对低位，持有这些权益资产的机会成本较低，只要时间视角稍微放长一些，我们对持有的公司后续 1-3 年取得不错的绝对收益非常有信心。唯一需要注意的是如果短期资金面逆风的时间持续超预期，我们需要适当控制净值回撤幅度，虽然这种浮亏令人难受，但过去一段时间

持有的这些资产，其背后的内在价值并未像股价表现得那样大幅下滑，实际上根据我们的测算，多数持有公司内在价值还是上升的。

二季度，我们总体坚持买入并持有的策略，换手率相对较低，相对看好低估值、高股息等价值类股票，行业配置方面，二季度我们主要小幅增加了家电、建材等行业的配置，减少了煤炭、交运的持仓，相对看好银行、家电、建材、煤炭等行业的优秀公司。

债券方面，二季度债市的主要驱动因素为资金面和内需。随着市场对输入型通胀的担忧减轻，经济数据反映内需偏弱，叠加 DR007 利率在 1.4% 下方持续时间较长，有部分机构由短债向长债切换，利率震荡下行，10 年期国债最低触及 1.70%。6 月初央行连续暂停公开市场投放，引导资金回归合理区间，市场情绪降温，利率有所回调。信用债供需格局较利率债更佳，信用利差震荡收窄，低等级、二永债改善最明显。转债市场二季度先涨后跌，中证转债指数上涨 3.7%，期间受 AI 科技板块虹吸效应影响，小盘、高价转债表现强势，大盘、低价转债表现整体承压，股性转债表现好于债性转债。

本基金债券仓位仍以利率债和优质信用债为主，二季度根据市场变化适当提高了产品久期，提高了信用债和转债占比。展望后市，三季度政府债供给集中释放，资金较难重回极度宽松状态，利率区间震荡的概率较大。中期限债券价值提升，超长期利率债波动或仍偏大。信用债方面，随着监管持续整治评级虚高，城投区域分化加剧，中高等级信用债的性价比提升。我们将视市场风险偏好变化和资金情况动态调整产品杠杆和久期，注重产品的流动性管理。

4.5 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 1.1546 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.65%；安信鑫安得利混合 C 基金份额净值为 1.1233 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.70%；同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

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   | 7,985,876.15   | 6.42         |
|    | 其中：股票  | 7,985,876.15   | 6.42         |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 102,583,953.14 | 82.49        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 102,583,953.14 | 82.49  |
|   | 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          | 12,420,000.00  | 9.99   |
|   | 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      | 1,283,448.32   | 1.03   |
| 8 | 其他资产              | 87,049.02      | 0.07   |
| 9 | 合计                | 124,360,326.63 | 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              | 770,640.00   | 0.68         |
| C  | 制造业              | 3,154,374.00 | 2.78         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | 434,000.00   | 0.38         |
| F  | 批发和零售业           | 973,360.15   | 0.86         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 376,400.00   | 0.33         |
| 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              | 2,048,522.00 | 1.81         |
| K  | 房地产业             | —            | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 228,580.00   | 0.20         |
| 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        | —            | —            |
| S  | 综合               | —            | —            |
|    | 合计               | 7,985,876.15 | 7.04         |

### 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  | 002508 | 老板电器 | 37,000  | 540,940.00 | 0.48         |
| 2  | 601939 | 建设银行 | 56,000  | 539,280.00 | 0.48         |
| 3  | 002867 | 周大生  | 48,221  | 537,664.15 | 0.47         |
| 4  | 600585 | 海螺水泥 | 30,000  | 508,500.00 | 0.45         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 13,300  | 472,150.00 | 0.42         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 9,200   | 439,208.00 | 0.39         |
| 7  | 600729 | 重百集团 | 23,200  | 435,696.00 | 0.38         |
| 8  | 601668 | 中国建筑 | 100,000 | 434,000.00 | 0.38         |
| 9  | 601088 | 中国神华 | 10,000  | 390,400.00 | 0.34         |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 35,000  | 377,300.00 | 0.33         |

### 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      | 33,212,817.33  | 29.27        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 62,501,817.31  | 55.08        |
|    | 其中：政策性金融债 | 31,124,071.23  | 27.43        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 3,019,101.53   | 2.66         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 3,850,216.97   | 3.39         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 102,583,953.14 | 90.41        |

### 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  | 019839  | 26 国债 10     | 113,000 | 11,319,377.18 | 9.98         |
| 2  | 220220  | 22 国开 20     | 100,000 | 10,868,726.03 | 9.58         |
| 3  | 250220  | 25 国开 20     | 100,000 | 10,222,186.30 | 9.01         |
| 4  | 250202  | 25 国开 02     | 100,000 | 10,033,158.90 | 8.84         |
| 5  | 2600002 | 26 超长特别国债 02 | 100,000 | 9,989,273.22  | 8.80         |

### 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

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。

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      |
|-------------------|-----------------|----------|-----------------|-------------|-------------|
| T2609             | 10 年期国债<br>2609 | 2        | 2, 184, 300. 00 | -500. 00    | -           |
| TL2609            | 30 年期国债<br>2609 | 1        | 1, 137, 500. 00 | -3, 950. 00 | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                 |          |                 |             | -4, 450. 00 |
| 国债期货投资本期收益（元）     |                 |          |                 |             | -3, 782. 39 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |                 |          |                 |             | -4, 450. 00 |

5.10.3 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。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，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   | 83,498.50 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 3,550.52  |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 87,049.02 |

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  | 127025 | 冀东转债 | 1,896,179.18 | 1.67         |
| 2  | 128129 | 青农转债 | 1,722,862.47 | 1.52         |
| 3  | 113052 | 兴业转债 | 230,175.29   | 0.20         |

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          | 安信鑫安得利混合 A    | 安信鑫安得利混合 C     |
|-------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 21,902,836.50 | 115,986,586.93 |

|                           |               |               |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额              | 28,993,252.92 | 3,539,288.78  |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 3,651,275.48  | 67,075,028.31 |
| 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               | 47,244,813.94 | 52,450,847.40 |

## § 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              | 20260401-20260401       | 33,197,925.99 | -             | 33,197,925.99 | -             | -       |
|       | 2              | 20260415-20260521       | 24,261,631.28 | -             | 24,261,631.28 | -             | -       |
|       | 3              | 20260402-20260630       | 26,680,896.48 | -             | -             | 26,680,896.48 | 26.76   |
|       | 4              | 20260522-20260630       | 13,834,463.04 | 28,403,339.65 | -             | 42,237,802.69 | 42.37   |

#### 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。

## 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。

### 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

2026 年 7 月 20 日