

安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|--------------------|
| 基金简称 | 安信新趋势混合 | |
| 基金主代码 | 001710 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 9 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,495,311,382.88 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 | 本基金旨在追求绝对回报，注重风险控制，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，因势利导运用多样化的投资策略如资产配置策略、固定收益类投资策略、股票投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略等实现基金资产稳定增值。 | |
| 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。 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信新趋势混合 A | 安信新趋势混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001710 | 001711 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,396,973,219.29 份 | 2,098,338,163.59 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 安信新趋势混合 A | 安信新趋势混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 28,006,727.34 | 21,239,978.03 |
| 2. 本期利润 | -5,683,071.61 | -5,959,275.58 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0023 | -0.0031 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,776,887,351.77 | 2,418,334,658.49 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.158 | 1.152 |

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

安信新趋势混合 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 | -0.26% | 0.14% | -7.43% | 0.44% | 7.17% | -0.30% |
| 过去六个月 | 1.05% | 0.16% | -4.45% | 0.59% | 5.50% | -0.43% |
| 过去一年 | 3.02% | 0.20% | -10.60% | 0.59% | 13.62% | -0.39% |
| 过去三年 | 19.86% | 0.18% | 3.21% | 0.63% | 16.65% | -0.45% |
| 过去五年 | 35.68% | 0.16% | 6.57% | 0.63% | 29.11% | -0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.60% | 0.16% | 10.14% | 0.60% | 32.46% | -0.44% |

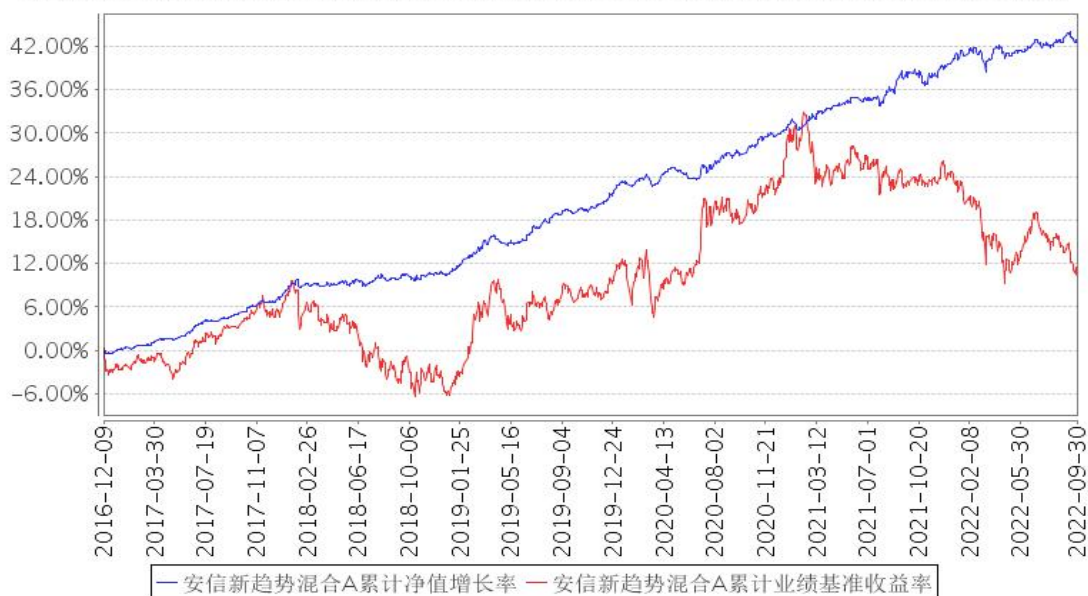
安信新趋势混合 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

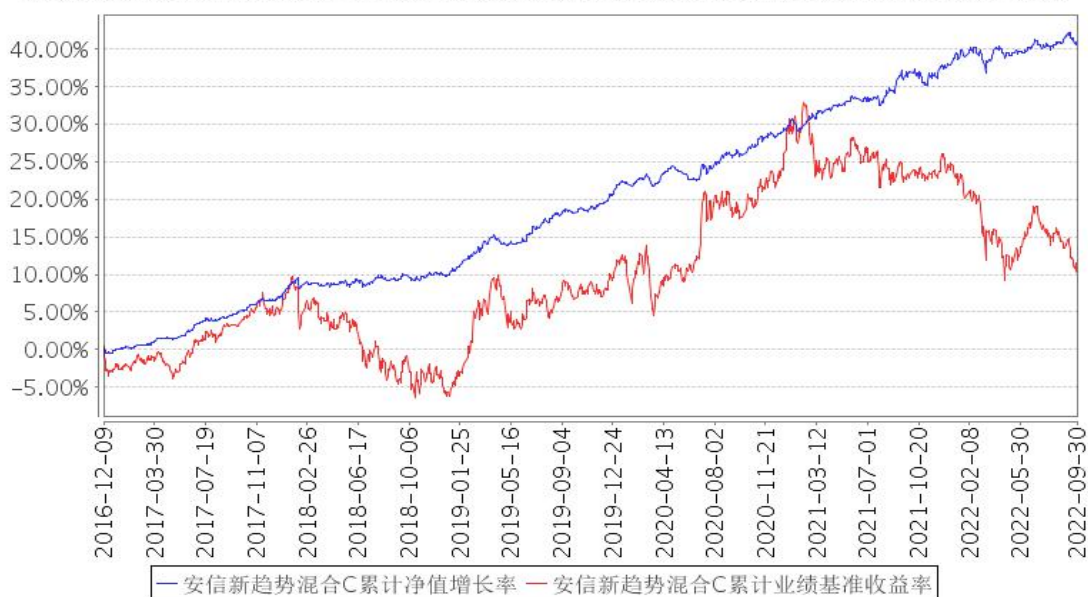
| | | | | ④ | | |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.35% | 0.15% | -7.43% | 0.44% | 7.08% | -0.29% |
| 过去六个月 | 0.96% | 0.16% | -4.45% | 0.59% | 5.41% | -0.43% |
| 过去一年 | 2.77% | 0.21% | -10.60% | 0.59% | 13.37% | -0.38% |
| 过去三年 | 19.13% | 0.18% | 3.21% | 0.63% | 15.92% | -0.45% |
| 过去五年 | 34.09% | 0.17% | 6.57% | 0.63% | 27.52% | -0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.80% | 0.16% | 10.14% | 0.60% | 30.66% | -0.44% |

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

安信新趋势混合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



安信新趋势混合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 2016 年 12 月 09 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 | | |
| 李君 | 本基金的基金经理，混合资产投资部总经理 | 2017 年 12 月 26 日 | - | 17 年 | 李君先生，管理学硕士。历任光大证券研究所研究部行业分析师，国信证券研究所研究部高级行业分析师，上海泽熙投资管理有限公司投资研究部投资研究员，太和先机资产管理有限公司投资研究部研究总监，东方睿德（上海）投资管理有限公司股权投资部投资总监，上海东证橡睿投资管理有限公司投资部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部基金经理、混合资产投资部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部总经理。曾任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）、安信目标收益债券型证券投资基金、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信稳健聚申一 |

| | | | | |
|-----|----------|----------------|---|--|
| | | | | <p>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的基金经理；现任安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信目标收益债券型证券投资基金、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理，安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信新趋势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、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> |
| 黄琬舒 | 本基金的基金经理 | 2022 年 3 月 9 日 | - | <p>7 年</p> <p>黄琬舒女士，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司集中交易部债券交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部基金经理。曾任安信民稳增长混合型证券投资基金的基金经理，安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金的基金经理助理；现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信稳健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、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信民稳增长混合型证券投资基金的基金经理助理，安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合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

本季度，债券市场走势整体偏强。期间，央行调降 7 天逆回购利率和 MLF 利率各 10bp，大超预期。季初受到疫情反复、地产信用风险蔓延等影响，市场对经济基本面趋于悲观，叠加资金面维持宽松，债市单边下行。8 月中下旬以来，在海外通胀高企、加快紧缩进程的背景下，人民币汇率承压，市场对后续货币政策有所担忧，债市小幅调整。报告期内，债券方面，本基金以中短久期利率债及高等级信用债为主要投资工具，在久期及杠杆的运用上偏谨慎。当前，我们对后期的利率方向仍然比较审慎，因此对债券头寸部分做了一定比例的对冲。

本季度，权益市场震荡下行。期间，本基金的股票持仓可分为两个部分，一是继续持有地产、能源、家电、建材、金融等低估值行业龙头，构成了本基金股票组合的主体持仓，二是同样从估值角度出发，结合基本面判断，构建了一个极为分散、均衡的投资组合，以求平衡风格和行业暴

露带来的短期波动。本基金股票组合整体跟随市场下跌，但对净值波动的影响基本在目标控制范围之内。由于市场下跌带来的个股估值普遍下降，基于性价比的资产配置原则，我们向上提升了股票持仓比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新趋势混合 A 基金份额净值为 1.158 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.26%；安信新趋势混合 C 基金份额净值为 1.152 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.35%；同期业绩比较基准收益率为-7.43%。

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 | 698,364,872.30 | 13.12 |
| | 其中：股票 | 698,364,872.30 | 13.12 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,360,456,134.30 | 81.93 |
| | 其中：债券 | 4,360,456,134.30 | 81.93 |
| | 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 | -1,048.31 | -0.00 |
| | 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 | 219,396,771.98 | 4.12 |
| 8 | 其他资产 | 43,897,042.36 | 0.82 |
| 9 | 合计 | 5,322,113,772.63 | 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 | 1,595,117.00 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 60,740,483.68 | 1.17 |
| C | 制造业 | 288,326,939.18 | 5.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | 5,896,545.85 | 0.11 |

| | 业 | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| E | 建筑业 | 1,297,072.00 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 15,258,685.00 | 0.29 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,991,408.00 | 0.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,290,504.28 | 0.12 |
| J | 金融业 | 115,101,278.76 | 2.22 |
| K | 房地产业 | 170,734,891.51 | 3.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,140,210.00 | 0.08 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,883,043.94 | 0.04 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,981,914.60 | 0.15 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 31,314.50 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,095,464.00 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 698,364,872.30 | 13.44 |

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 | 000002 | 万科 A | 6,383,294 | 113,814,132.02 | 2.19 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 1,205,300 | 40,558,345.00 | 0.78 |
| 3 | 601225 | 陕西煤业 | 1,695,800 | 38,613,366.00 | 0.74 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 1,150,058 | 33,133,170.98 | 0.64 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 735,811 | 30,595,021.38 | 0.59 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 523,675 | 25,822,414.25 | 0.50 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 658,400 | 20,831,776.00 | 0.40 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 480,098 | 15,569,578.14 | 0.30 |
| 9 | 600663 | 陆家嘴 | 1,572,083 | 15,139,159.29 | 0.29 |
| 10 | 600048 | 保利发展 | 755,200 | 13,593,600.00 | 0.26 |

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 | 1,014,687.67 | 0.02 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,359,085,563.69 | 64.66 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 1,739,359,761.91 | 33.48 |
| 4 | 企业债券 | 20,348,695.89 | 0.39 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,676,517.80 | 0.59 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 870,236,365.00 | 16.75 |
| 8 | 同业存单 | 79,094,304.25 | 1.52 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,360,456,134.30 | 83.93 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 3,632,490 | 390,678,777.92 | 7.52 |
| 2 | 210303 | 21 进出 03 | 1,800,000 | 185,446,257.53 | 3.57 |
| 3 | 200313 | 20 进出 13 | 1,500,000 | 152,305,602.74 | 2.93 |
| 4 | 190404 | 19 农发 04 | 1,200,000 | 124,572,690.41 | 2.40 |
| 5 | 210402 | 21 农发 02 | 1,200,000 | 123,975,386.30 | 2.39 |

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 |
|-------------------|---------|----------|-----------------|--------------|---------------|
| TF2212 | 国债 2212 | -440 | -446,248,000.00 | 1,257,314.74 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 1,257,314.74 |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -2,067,937.69 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 619,861.05 |

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除浦发转债（代码：110059 SH）、21 进出 03（代码：210303 CY）、20 进出 13（代码：200313 CY）、19 农发 04（代码：190404 CY）、21 农发 02（代码：210402 CY）、21 农发 06（代码：210406 CY）、18 中油 EB（代码：132015 SH）、17 农发 04（代码：170404 CY）、15 农发 05（代码：150405 CY）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. 上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 11 月 15 日，上海浦东发展银行股份有限公司因提供虚假资料证明文件被国家外汇管理局上海市分局罚款。

2022 年 3 月 25 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2022 年 8 月 17 日，上海浦东发展银行股份有限公司因未依法履行职责被上海市市场监督管理局罚款。

2022 年 9 月 2 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局

警告、罚款、没收违法所得、通知整改。

2. 中国进出口银行

2022 年 3 月 25 日，中国进出口银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

3. 中国农业发展银行

2022 年 3 月 25 日，中国农业发展银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

4. 中国石油天然气集团有限公司

2022 年 1 月 20 日，中国石油天然气集团有限公司因涉嫌违反法律法规被中央纪委国家监委没收违法所得。

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 | 5,572,079.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | 33,278,172.68 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,046,790.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 43,897,042.36 |

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 | 390,678,777.92 | 7.52 |
| 2 | 132015 | 18 中油 EB | 117,324,622.59 | 2.26 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 104,513,670.69 | 2.01 |
| 4 | 113044 | 大秦转债 | 84,190,424.94 | 1.62 |
| 5 | 128129 | 青农转债 | 67,590,434.54 | 1.30 |
| 6 | 113021 | 中信转债 | 44,922,963.27 | 0.86 |
| 7 | 113037 | 紫银转债 | 20,679,430.89 | 0.40 |
| 8 | 120002 | 18 中原 EB | 14,158,402.09 | 0.27 |
| 9 | 113584 | 家悦转债 | 5,979,953.53 | 0.12 |
| 10 | 123076 | 强力转债 | 3,143,386.00 | 0.06 |
| 11 | 113569 | 科达转债 | 2,945,413.12 | 0.06 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 123056 | 雪榕转债 | 2,080,062.62 | 0.04 |
| 13 | 128063 | 未来转债 | 2,025,246.77 | 0.04 |
| 14 | 127024 | 盈峰转债 | 1,930,151.14 | 0.04 |
| 15 | 113624 | 正川转债 | 1,476,528.94 | 0.03 |
| 16 | 128118 | 瀛通转债 | 1,476,029.88 | 0.03 |
| 17 | 123126 | 瑞丰转债 | 1,252,089.25 | 0.02 |
| 18 | 128125 | 华阳转债 | 1,186,630.50 | 0.02 |
| 19 | 113530 | 大丰转债 | 923,959.23 | 0.02 |
| 20 | 123104 | 卫宁转债 | 696,620.11 | 0.01 |
| 21 | 113628 | 晨丰转债 | 349,664.77 | 0.01 |
| 22 | 113608 | 威派转债 | 198,630.30 | 0.00 |
| 23 | 127041 | 弘亚转债 | 189,751.85 | 0.00 |
| 24 | 123113 | 仙乐转债 | 171,397.21 | 0.00 |
| 25 | 113606 | 荣泰转债 | 145,431.67 | 0.00 |
| 26 | 113056 | 重银转债 | 996.34 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 安信新趋势混合 A | 安信新趋势混合 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,413,071,317.03 | 1,876,984,807.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 309,913,955.40 | 668,929,035.56 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 326,012,053.14 | 447,575,679.33 |
| 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 | 2,396,973,219.29 | 2,098,338,163.59 |

§ 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新趋势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新趋势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

2022 年 10 月 25 日