安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
送出日期:2019年03月29日

§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。本年度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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信鑫发优选混合
基金主代码	000433
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月31日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	39,842,143.34份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以风险管理为基础,通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上,结合政策因素、市场情绪与估值因素等,分析大类资产风险收益比,合理配置;在固定收益类的投资上,采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略,选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种;在股票投资上,秉承价值投资理念,灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略,把握市场定价偏差带来的投资机会;在衍生品投资上,合理利用权证等做套保或套利投资;在风险管理上,根据市场环境的变化,动态调整仓位和投资品种,并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	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。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江辉	戴辉
	联系电话	0755-82509999	010-65169958
	电子邮箱	service@essencefund.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95508
传真		0755-82799292	010-65169555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-10,036,051.16	4,316,327.61	18,700,267.77
本期利润	-12,128,597.86	6,276,249.55	-41,313,650.24
加权平均基金份额本期利润	-0.3029	0.1202	-0.3823
本期基金份额净值增长率	-23.34%	9.15%	-16.99%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末基金资产净值	38,616,497.30	47,166,667.26	77,157,269.31
期末基金份额净值	0.969	1.264	1.158

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

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
过去三个月	-8.15%	1.56%	1.13%	0.01%	-9.28%	1.55%
过去六个月	-9.61%	1.45%	2.27%	0.01%	-11.88%	1.44%
过去一年	-23.34%	1.36%	4.50%	0.01%	-27.84%	1.35%
过去三年	-30.54%	1.39%	13.52%	0.04%	-44.06%	1.35%
过去五年	-3.10%	1.32%	24.60%	0.03%	-27.70%	1.29%
自基金合同生效起至今	-3.10%	1.32%	24.62%	0.03%	-27.72%	1.29%

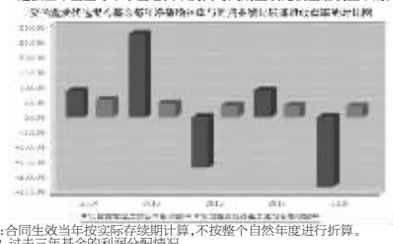
注:根据《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

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

注:1、本基金基金合同生效日为2013年12月31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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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,安信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2018年12月31日,本基金管理人共管理45只开放式基金,具体如下:从2012年6月20日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金;从2012年9月25日起管理安信目标收益债券型证券投资基金;从2012年12月18日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金;从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金;从2013年7月24日起管理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);从2013年11月8日起管理安信永利信用定开债券型证券投资基金;从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基;从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金;从2014年11月24日起管理安信现金增利货币市场基金;从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金;从2015年4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金;从2015年5月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月25日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金;从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金;从2015年8月7日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金;从2015年11月24日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金;从2016年3月9日至2018年5月28日管理安安盈保本混合型证券投资基金;从2016年5月9日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金;从2016年7月28日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金;从2016年8月9日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金;从2016年8月19日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金;从2016年9月9日至2018年9月26日管理安信保证金交易型货币市场基金;从2016年9月29日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金;从2016年10月10日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金;从2016年10月12日起管理安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金;从2016年10月17日起管理安信活期宝货币市场基金;从2016年12月9日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金;从2016年12月19日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金;从2017年1月13日至2018年6月11日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金;从2017年3月16日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月16日起管理安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月29日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金;从2017年7月3日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金;从2017年7月20日起管理安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金;从2017年12月6日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金;从2017年12月28日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金;从2018年3月14日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金;从2018年3月21日起管理安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金;从2018年3月30日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金;从2018年6月1日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金;从2018年6月12日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金;从2018年6月21日起管理安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金;从2018年9月3日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金;从2018年9月26日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金;从2018年11月29日起管理安信中证500指数增强型证券投资基金;从2018年12月7日起管理安信优享纯债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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孟雁书	本基金的基金经理	2013年12月31日	-	12	孟雁书先生,理学硕士。历任桂林理工大学(原桂林工学院)理学院教师,华西证券有限责任公司证券研究所研究员,安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员,2011年12月加入安信基金管理有限责任公司,现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,安信优势增长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的基金经理;现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略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、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
龚炜	本基金的基金经理助理	2015年7月10日	-	8	龚炜先生,理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理,安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,安信新趋势灵活配置混合型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"根据公司决定确定的聘任日期填写。"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。

4.2 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用T值检验等统计方法,定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示,本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间,不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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

2018年上半年,市场预期发生较大变化:房地产新开工面积增速大幅下降、资金来源情况变差,叠加前告期增速持续下滑,市场对2018年房地产投资增速预期变得相对谨慎;中美贸易战骤然来袭,使出口面临失速风险;制造业投资回暖,不抵地产投资和基建投资间下压力;消费端,必选消费增长放缓叠加举债透支影响逐步显现,消费对经济支撑作用弱化。

2018年下半年,国常会政策取向开始扭转,但海外市场的回落,加上国内股票价格下跌与质押盘违约的螺旋再次显现,投资者情绪极低,A股调整幅度较大。考虑到内外经济下行趋势基本形成,国内政策托底传导至实体信用环境还未改观,企业盈利能力还可能受到需求和成本冲击,盈利增速下滑,A股震荡下行。

期间,考虑到我们对A股持谨慎观点,本基金持仓自下而上以估值合理、具有一定核心竞争优势的具体个股为主,主要包括以基本面复苏趋势确定、估值合理的保险、电力和建筑等为主。在四季度末,考虑到A股估值水平已经回落至较低水平,市场风险偏好处于极低位置,且前期政策由"去杠杆"到"稳杠杆"转变,货币信用紧缩周期开始扭转,我们认为A股进入配置区间,我们加大了股票持仓头寸。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.969元,本报告期份额净值增长率为-23.34%,同期业绩比较基准增长率为4.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,我们对A股持相对乐观态度,核心原因是影响前期市场的主要矛盾正在发生逆转,"去杠杆"在向"稳增长"转变。

前期去杠杆对大家心里预期产生了冲击,市场预期悲观,经济增速下滑。7月底国常会定调调整,从"去杠杆"转向"稳杠杆",包括央行TMLF利率降低,前期扭曲中国经济社会的核心矛盾正在得到修正。这种修正使去杠杆节奏放缓,这些修补政策将对目前已经处于极低位置的风险偏好带来正贡献,也会对经济产生正面刺激。

对于贸易战,我们认为也不用过于担心。广阔的内需、依然丰富的劳动力资源、完善的制造业产业链配套以及技术积累,使得中国在新的全球化均衡过程中,依然具备竞争优势。

我们将重点关注重卡及工程机械、新能源汽车、电子与通信设备、医药与医疗设备等行业的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要,通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式,保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 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副总经理担任,估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核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:权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、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;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央国债登记结算有限责任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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况,本基金本报告期未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,时间范围为2018年1月2日至2018年1月31日、2018年3月2日至2018年5月30日、2018年6月8日至2018年8月28日和2018年9月5日至2018年12月31日。

本报告期内本基金出现了连续60个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§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,广发银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告,投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	5,014,360.29	5,986,283.84
结算备付金	272,999.53	338,104.96
存出保证金	109,928.76	153,829.52
交易性金融资产	33,580,145.68	41,004,576.06
其中:股票投资	33,580,145.68	41,004,576.06
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,190.98	1,781.58
应收股利	-	-
应收申购款	2,997.27	5,318.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	38,981,622.51	47,489,894.67
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	134,607.91	-
应付赎回款	6,920.33	49,174.34
应付管理人报酬	33,754.89	40,278.96
应付托管费	6,750.96	8,055.79
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	103,081.81	135,702.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,009.31	90,015.68
负债合计	365,125.21	323,227.41
所有者权益:		
实收基金	39,842,143.34	37,307,305.45
未分配利润	-1,225,646.04	9,859,361.81
所有者权益合计	38,616,497.30	47,166,667.26
负债和所有者权益总计	38,981,622.51	47,489,894.67

注: 报告截止日2018年12月31日,本基金份额净值人民币0.969元,基金份额总额39,842,143.34份。

7.2 利润表

会计主体:安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-10,424,024.06	8,661,658.06
1.利息收入	52,804.80	60,933.48
其中:存款利息收入	52,804.80	59,362.03
债券利息收入	-	132.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,438.89
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-8,472,452.39	6,560,039.04
其中:股票投资收益	-9,118,914.35	5,738,105.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	18,926.40
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	646,461.96	803,007.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-2,092,546.70	1,959,921.94
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	88,170.23	80,763.60
减:二、费用	1,704,573.80	2,385,408.51
1. 管理人报酬	446,025.36	635,623.06
2. 托管费	89,205.03	127,124.65
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,002,143.41	1,485,260.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	167,200.00	137,400.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-12,128,597.86	6,276,249.55
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-12,128,597.86	6,276,249.55

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	37,307,305.45	9,859,361.81	47,166,667.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,128,597.86	-12,128,597.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,534,837.89	1,043,590.01	3,578,427.90
其中:1.基金申购款	22,624,617.56	3,551,249.86	26,175,867.42
2.基金赎回款	-20,089,779.67	-2,507,659.85	-22,597,439.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	39,842,143.34	-1,225,646.04	38,616,497.30

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	66,601,337.78	10,555,931.53	77,157,269.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,276,249.55	6,276,249.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-29,294,032.33	-6,972,819.27	-36,266,851.60
其中:1.基金申购款	6,587,784.71	1,356,771.25	7,944,555.96
2.基金赎回款	-35,881,817.04	-8,329,590.52	-44,211,407.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	37,307,305.45	9,859,361.81	47,166,667.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘入领 范瑛 苗杨
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信鑫发优选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")2013年11月4日下发的证监许可[2013]1401号文"关于核准安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复"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《安信鑫发优选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2013年12月11日至2013年12月27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(2013)验字60962175_H09号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币550,664,388.77元。经向中国证监会备案,《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013年12月31日正式生效。截至2013年12月31日止,安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币550,664,388.77元,折合550,664,388.77份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币129,002.71元,折合129,002.71份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币550,793,391.48元,折合550,793,391.48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,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金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)、债券、货币市场工具、权证、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工具(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,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产投资比例为: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%,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。

本基金的业绩比较基准为:1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

7.4.2 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、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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2号《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(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

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。

7.4.6.3 增值税

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》、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》、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》、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》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》的规定及其他相关法规:

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,自2018年1月1日起,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;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。

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得,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,股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司(以下简称"安信基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发银行股份有限公司(以下简称"广发银行")	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券")	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
安信证券	345,116,674.02	44.99	875,348,705.19	77.76

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
安信证券	245,479.24	44.44	29,638.97	28.75
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
安信证券	622,630.92	77.28	70,888.26	52.24

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	446,025.36	635,623.06
其中:支付销售机构的客户维护费	179,815.26	310,398.40

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1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%/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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	89,205.03	127,124.65

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的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

|