安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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8月27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。本半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08月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30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	34,023,211.75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	乔江晖	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	4008308003
传真		0755-82799292	010-65169555

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	7,667,891.74
本期利润	9,150,467.76
加权平均基金份额本期利润	0.2495
本期基金份额净值增长率	23.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1992
期末基金资产净值	40,801,772.18
期末基金份额净值	1.199

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。

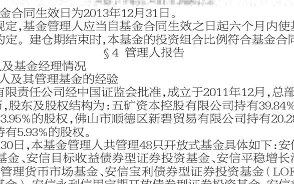
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	2.57%	1.00%	0.37%	0.01%	2.20%	0.99%
过去三个月	-3.23%	1.50%	1.12%	0.01%	-4.35%	1.49%
过去六个月	23.74%	1.42%	2.23%	0.01%	21.51%	1.41%
过去一年	11.85%	1.44%	4.50%	0.01%	7.35%	1.43%
过去三年	1.10%	1.14%	13.50%	0.01%	-12.40%	1.13%
自基金合同生效起至今	19.90%	1.33%	26.85%	0.01%	-6.95%	1.32%

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。

§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2019年6月30日，本基金管理人共管理48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、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、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、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、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、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、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、安信永泰定期开放债券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、安信永瑞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）、安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金、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、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、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（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）。

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	任本基金的基金经理（助理）期限：离任日期	证券从业年限	说明
袁玮	本基金的基金经理	2019年06月12日	-	9	袁玮先生，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、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；现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
蓝雁书	本基金的基金经理	2013年12月31日	2019年6月13日	13	蓝雁书先生，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，安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司特定资产管理部总经理。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、安信新视野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的基金经理、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的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015年7月10日	2019年6月12日	9	袁玮先生，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、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；现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

2、证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

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

2019年一季度上证指数上涨近24%，农林牧渔、计算机、券商等行业涨幅居前。我们认为，较低估值水平是A股走强的基础，而"去杠杆"向"稳杠杆"政策转向的持续发酵、对中小民企政策的纠偏，以及中美贸易谈判进展顺利，直接提升市场风险偏好；加上监管有所放松，场外增量资金进场，A股涨势凌厉。

2019年二季度A股指数振荡下行，主要原因是经历年初估值修复行情后，4月份货币政策微调对市场预期形成冲击，加上随后公布的国内经济数据走弱及中美贸易战发酵，进一步拖累市场走势，上证指数、深圳综指期间均录得负收益。经济数据方面，除了抢出口形成个别或区域数据略超预期外，整体弱于预期。基建投资增速不达预期，房地产投资如期转弱，制造业投资底部徘徊，甚至消费增速也不如预期。在预期偏弱情况下，投资者风险偏好降低，二级市场交易主要集中在食品饮料、家电、银行等行业，而传媒、TMT等行业跌幅居前。

报告期内，本基金持仓组合，以自下而上选择估值合理、具有核心竞争优势个股为主，包括处于景气度高、业绩确定性高的养殖、建筑建材等。二季度，考虑汽车库存去化接近尾声，行业自发修复过程很可能在政策刺激下超预期回升，加上优质个股估值并不高，期间加大优质汽车整车和零配件公司配置。

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1.199元，本报告期份额净值增长率为23.74%，同期业绩比较基准增长率为2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计市场后续关注重心重回经济基本面：市场对美国关税范围扩大至2000亿美元有一定预期，中国商务部也没有进一步跟进，人民币贬值一定程度上也能对冲关税影响，贸易战对市场风险偏好影响将逐渐钝化；信用债到期量平稳、"宽货币、紧信用"政策中宽货币持续发力，主动金融去杠杆节奏可控，后续去杠杆更多是结构性冲击。

但经济后续有下行压力，原因是：作为前期亮点的地产投资和出口有压力，且全球都处于紧缩周期中；国内短期推出的扩大内需措施力度偏弱，还需月底政治局会议进一步的方向性指导。

从盈利能力与资金成本对比来看，当前A股估值水平不是绝对底位，但已经具备一定吸引力。

综合来看，考虑到当前仍然处于金融去杠杆周期，经济下行压力犹在，托底强度尚弱，估值并不是绝对底位，指数振荡概率较大。能否突破振荡格局，取决于月底政治局会议进一步的方向指导。参考ROE与PE历史溢价率所处历史分位情况看，建议行业配置：电子、轻工、电气设备、传媒，以及后续扩大内需方向确定后的建筑建材等。

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以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等部门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

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。

4.8 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

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2019年1月2日至2019年6月30日。

自2018年9月5日至本报告期末，本基金基金资产净值出现了连续60个工作日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

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《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，不存在任何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《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方面进行了必要的监督，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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：安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	4,351,123.70	5,014,360.29
结算备付金	185,894.29	272,999.53
存出保证金	47,537.08	109,928.76
交易性金融资产	35,802,853.69	33,580,145.68
其中：股票投资	35,802,853.69	33,580,145.68
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	630,091.92	-
应收利息	1,143.53	1,190.98
应收股利	-	-
应收申购款	2,880.95	2,997.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	41,021,525.16	38,981,622.51
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	6,517.00	134,607.91
应付赎回款	29,943.15	6,920.33
应付管理人报酬	33,064.92	33,754.89
应付托管费	6,612.98	6,750.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	100,396.87	103,081.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	43,218.06	80,009.31
负债合计	219,752.98	365,125.21
所有者权益：		
实收基金	34,023,211.75	39,842,143.34
未分配利润	6,778,560.43	-1,225,646.04
所有者权益合计	40,801,772.18	38,616,497.30
负债和所有者权益总计	41,021,525.16	38,981,622.51

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.199元，基金份额总额34,023,211.75份。

6.2 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	9,791,360.36	-6,710,058.35
1.利息收入	21,706.76	28,977.50
其中：存款利息收入	21,690.08	28,977.50
债券利息收入	16.68	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	8,271,863.19	-3,342,462.88
其中：股票投资收益	7,908,119.82	-3,740,379.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,717.58	-
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	357,025.79	397,916.91
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	1,482,576.02	-3,430,952.49
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	15,214.39	34,379.52
减：二、费用	640,892.60	911,676.05
1. 管理人报酬	209,746.28	231,391.21
2. 托管费	41,949.28	46,278.23
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	327,382.08	600,530.22
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	61,814.96	33,476.39
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	9,150,467.76	-7,621,734.40
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	9,150,467.76	-7,621,734.40

6.3 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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）	39,842,143.34	-1,225,646.04	38,616,497.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,150,467.76	9,150,467.76
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）	-5,818,931.59	-1,146,261.29	-6,965,192.88
其中：1.基金申购款	2,171,326.68	379,746.54	2,551,073.22
2.基金赎回款	-7,990,258.27	-1,526,007.83	-9,516,266.10
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）	34,023,211.75	6,778,560.43	40,801,772.18

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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）	-	-7,621,734.40	-7,621,734.40
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）	3,600,297.36	696,645.88	4,296,943.24
其中：1.基金申购款	13,605,877.45	2,860,860.62	16,466,738.07
2.基金赎回款	-10,005,580.09	-2,164,214.74	-12,169,794.83
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）	40,907,602.81	2,934,273.29	43,841,876.10

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

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、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

6.4.6.1印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

6.4.6.2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。

6.4.6.3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。

6.4.6.4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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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（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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日：成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日：成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
安信证券	-	-	210,354,916.31	45.75

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	149,625.14	45.06	68,928.12	44.99

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	209,746.28	231,391.21
其中：支付销售机构的客户维护费	83,284.12	99,031.23

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	41,949.28	46,278.23

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

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日（2013年12月31日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,428,473.35	-
报告期间申购/买入总份额	-	6,428,473.35
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,428,473.35	6,428,473.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.89%	15.71%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

6.4.8.4.2 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本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日：期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日：期末余额	当期利息收入
广发银行	4,351,123.70	19,640.59	5,268,808.86	24,890.24

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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，无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

§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	35,802,853.69	87.28
	其中：股票	35,802,853.69	87.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,537,017.99	11.06
8	其他各项资产	681,653.48	1.66
9	合计	41,021,525.16	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	26,557.55	0.07
C	制造业	15,013,219.65	36.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,508,586.75	11.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	409,906.00	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,270,492.80	5.56
J	金融业	4,087,878.94	10.02
K	房地产业	8,693,770.00	21.31
L	租赁和商务服务业	792,442.00	1.94
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	35,802,853.69	87.75

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前十名股票投资明细

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	600383	金地集团	199,200	2,376,456.00	5.82
2	000069	华侨城A	324,400	2,254,580.00	5.53
3	002230	科大讯飞	67,750	2,252,010.00	5.52
4	000932	华菱钢铁	458,900	2,188,953.00	5.36
5	600048	保利地产	171,500	2,188,340.00	5.36
6	601668	中国建筑	373,049	2,145,031.75	5.26
7	000002	万科A	67,400	1,874,394.00	4.59
8	000338	潍柴动力	150,000	1,843,500.00	4.52
9	601318	中国平安	18,700	1,657,007.00	4.06
10	600585	海螺水泥	38,200	1,585,300.00	3.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于安信基金管理有限责任公司网站上的半年度报告正文。

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	000069	华侨城A	3,488,427.68	9.03
2	601166	兴业银行	3,229,566.00	8.36
3	000932	华菱钢铁	3,061,143.00	7.93
4	600383	金地集团	2,841,877.00	7.36
5	000338	潍柴动力	2,432,846.00	6.30
6	600048	保利地产	2,242,498.00	5.81
7	600027	华电国际	2,221,901.00	5.75
8	600104	上汽集团	2,221,257.00	5.75
9	601668	中国建筑	2,196,076.63	5.69
10	002531	天顺风能	2,075,975.00	5.38
11	002081	金螳螂	2,052,255.00	5.31
12	000002	万科A	1,907,923.00	4.94
13	000786	北新建材	1,871,318.00	4.85
14	000895	双汇发展	1,832,175.95	4.74
15	300601	康泰生物	1,783,929.95	4.62
16	002230	科大讯飞	1,770,093.00	4.58
17	600585	海螺水泥	1,712,899.00	4.44
18	600176	中国巨石	1,710,469.20	4.43
19	002027	分众传媒	1,695,585.00	4.39
20	601318	中国平安	1,638,120.00	4.24
21	300498	温氏股份	1,602,608.00	4.15
22	600745	闻泰科技	1,487,699.00	3.85
23	000883	湖北能源	1,480,600.00	3.83
24	002614	奥佳华	1,464,539.00	3.79
25	601238	广汽集团	1,395,842.36	3.61
26	002601	龙蟒佰利	1,379,887.00	3.57
27	000963	华东医药	1,301,790.40	3.37
28	002643	万润股份	1,288,725.50	3.34
29	600741	华域汽车	1,217,874.00	3.15
30	002327	富安娜	1,208,460.00	3.13
31	603026	石大胜华	1,203,768.00	3.12
32	600019	宝钢股份	1,189,097.00	3.08
33	300253	卫宁健康	1,186,905.19	3.07
34	603636	南威软件	1,168,857.00	3.03
35	002508	老板电器	1,166,876.00	3.02
36	600660	福耀玻璃	1,163,636.00	3.01
37	600016	民生银行	1,152,697.00	2.98
38	601186	中国铁建	1,149,686.00	2.98
39	000333	美的集团	1,144,807.00	2.96
40	002458	益生股份	1,095,084.00	2.84
41	300284	苏交科	1,057,945.00	2.74
42	000063	中兴通讯	1,054,135.00	2.73
43	600011	华能国际	1,049,951.00	2.72
44	300422	博世科	1,049,477.00	2.72
45	002110	三钢闽光	1,045,457.00	2.71
46	600196	复星医药	1,025,218.00	2.65
47	002051	中工国际	1,022,529.00	2.65
48	300083	劲胜智能	1,004,004.00	2.60
49	000966	长源电力	992,310.00	2.57
50	600031	三一重工	988,097.00	2.56
51	600801	华新水泥	984,306.99	2.55
52	601633	长城汽车	978,311.00	2.53
53	600754	锦江股份	977,165.00	2.53
54	000501	鄂武商A	968,886.00	2.51
55	600600	青岛啤酒	948,713.00	2.46
56	002008	大族激光	929,776.00	2.41
57	600340	华夏幸福	914,374.00	2.37
58	600325	华发股份	913,984.00	2.37
59	300094	国联水产	870,832.00	2.26
60	002228	合兴包装	859,835.00	2.23
61	600406	国电南瑞	859,588.00	2.23
62	600085	同仁堂	826,369.00	2.14
63	600036	招商银行	823,001.00	2.13
64	600309	万华化学	820,363.00	2.12
65	601966	玲珑轮胎	817,991.00	2.12
66	600570	恒生电子	783,572.00	2.03
67	002675	东诚药业	782,003.00	2.03

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	3,436,036.70	8.90
2	000063	中兴通讯	2,783,666.00	7.21
3	002531	天顺风能	2,751,188.20	7.12
4	600027	华电国际	2,610,516.00	6.76
5	300498	温氏股份	2,393,551.00	6.20
6	600383	金地集团	2,386,386.00	6.18
7	600104	上汽集团	2,205,984.00	5.71
8	002439	启明星辰	2,204,039.00	5.71
9	000895	双汇发展	2,106,317.00	5.45
10	002352	顺丰控股	1,998,439.33	5.18
11	300124	汇川技术	1,969,519.00	5.10
12	000786	北新建材	1,930,908.00	5.00
13	002458	益生股份	1,883,386.01	4.88
14	002081	金螳螂	1,878,910.00	4.87
15	300601	康泰生物	1,795,152.00	4.65
16	600176	中国巨石	1,759,874.00	4.56
17	002614	奥佳华	1,727,198.00	4.47
18	002078	太阳纸业	1,701,401.00	4.41
19	601166	兴业银行	1,678,496.00	4.35
20	600011	华能国际	1,637,883.00	4.24
21	300760	迈瑞医疗	1,600,620.00	4.14
22	600745	闻泰科技	1,538,144.00	3.98
23	002714	牧原股份	1,535,709.00	3.98
24	002601	龙蟒佰利	1,496,901.00	3.88
25	601238	广汽集团	1,484,126.00	3.84
26	600019	宝钢股份	1,479,838.00	3.83
27	600741	华域汽车	1,428,482.00	3.70
28	000883	湖北能源	1,389,638.00	3.60
29	000069	华侨城A	1,376,067.00	3.56
30	000963	华东医药	1,366,579.00	3.54
31	601985	中国核电	1,353,455.00	3.50
32	000338	潍柴动力	1,317,805.00	3.41
33	601766	中国中车	1,314,997.00	3.41
34	601800	中国交建	1,308,580.00	3.39
35	600801	华新水泥	1,282,035.00	3.32
36	000333	美的集团	1,275,472.00	3.30
37	002008	大族激光	1,256,195.00	3.25
38	603026	石大胜华	1,223,455.24	3.17
39	601186	中国铁建	1,191,775.00	3.09
40	600459	贵研铂业	1,190,957.00	3.08
41	600660	福耀玻璃	1,184,412.00	3.07
42	002508	老板电器	1,180,516.00	3.06
43	002110	三钢闽光	1,177,834.00	3.05
44	000966	长源电力	1,171,300.00	3.03
45	300059	东方财富	1,164,691.00	3.02
46	600585	海螺水泥	1,160,994.00	3.01
47	002643	万润股份	1,110,216.00	2.87
48	603601	再升科技	1,109,354.00	2.87
49	300284	苏交科	1,092,087.00	2.83
50	600016	民生银行	1,081,785.00	2.80
51	002258	利尔化学	1,073,453.00	2.78
52	300253	卫宁健康	1,071,435.00	2.77
53	300633	开立医疗	1,066,679.00	2.76
54	000501	鄂武商A	1,028,932.00	2.66
55	002228	合兴包装	1,008,811.00	2.61
56	002230	科大讯飞	987,563.00	2.56
57	601633	长城汽车	985,642.00	2.55
58	600600	青岛啤酒	964,213.00	2.50
59	600085	同仁堂	955,347.00	2.47
60	300094	国联水产	933,391.00	2.42
61	300083	劲胜智能	917,412.00	2.38
62	002092	中泰化学	915,245.00	2.37
63	603636	南威软件	905,619.00	2.35
64	600754	锦江股份	898,640.00	2.33
65	002675	东诚药业	894,290.00	2.32
66	000932	华菱钢铁	885,744.00	2.29
67	600340	华夏幸福	876,625.00	2.27
68	601966	玲珑轮胎	873,964.00	2.26
69	300422	博世科	872,830.00	2.26
70	603186	华正新材	840,180.00	2.18
71	000401	冀东水泥	824,802.00	2.14
72	600373	中文传媒	809,992.00	2.10
73	603599	广信股份	797,202.00	2.06
74	600325	华发股份	793,793.00	2.06
75	600486	扬农化工	792,394.00	2.05

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	119,504,723.04
卖出股票收入（成交）总额	126,672,710.87

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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除华菱钢铁（股票代码：000932），本期没有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。

湖南华菱湘潭钢铁有限公司于2018年12月27日收到地方外管局处罚。因重复单证办理境内融资以及未按规定办理贸易外汇业务，被以警告并罚款14万元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	47,537.08
2	应收证券清算款	630,091.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,143.53
5	应收申购款	2,880.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	681,653.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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：持有份额	机构投资者：占总份额比例（%）	个人投资者：持有份额	个人投资者：占总份额比例（%）
2,835	12,001.13	6,428,473.35	18.89	27,594,738.40	81.11

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	387,304.78	1.1384

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月31日）基金份额总额	550,793,391.48
本报告期期初基金份额总额	39,842,143.34
本报告期基金总申购份额	2,171,326.68
减：本报告期基金总赎回份额	7,990,258.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	34,023,211.75

§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

本基金管理人于2019年6月1日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第三届董事会第十次会议审议通过，廖维坤先生自2019年5月31日起担任公司副总经理兼首席信息官。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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：成交金额	股票交易：占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金：佣金	应支付该券商的佣金：占当期佣金总量的比例	备注
海通证券	2	219,241,131.86	89.34%	160,331.52	89.60%	-
川财证券	1	26,164,268.30	10.66%	18,610.73	10.40%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

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：成交金额	债券交易：占当期债券成交总额的比例	债券回购交易：成交金额	债券回购交易：占当期债券回购成交总额的比例	权证交易：成交金额	权证交易：占当期权证成交总额的比例
海通证券	113,734.26	100.00%	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§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

无。

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、中国证监会核准安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

2、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《安信鑫发优选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

2019年8月27日