# 安信优势增长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:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8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1月1日起至6月30日止。 §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 安信优势增长混合 | |
| 基金主代码 | 001287 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年5月20日 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 招商证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 63,325,591.73份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信优势增长混合A | 安信优势增长混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001287 | 002036 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,654,604.68份 | 12,670,987.05份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金将以严谨细致的逻辑和基本面分析为基础,通过自上而下和自下而上结合,把握经济转型发展期具有较高增长潜力的上市公司的投资机会,力争实现基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 资产配置方面,通过对基本面数据的分析和逻辑梳理,分析比较大类资产的风险收益比,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例;股票投资方面,主要从行业配置和个股精选两个层面进行投资;固定收益类投资方面,根据宏观数据和市场交易情况,合理判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,构建固定收益类债券投资组合;此外,本基金还采用股指期货投资策略、权证投资策略、低风险套利型投资策略等衍生品投资策略和资产支持证券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。 |
| 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 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 乔江晖 | 张志斌 |
| | 联系电话 | 0755-82509999 | 0755-82943666 |
| | 电子邮箱 | service@essencefund.com | tgb@cmachina.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008-088-088 | 95565 |
| 传真 | | 0755-82799292 | 0755-82960794 |

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) | |
|---|---|---|
| | 安信优势增长混合A | 安信优势增长混合C |
| 本期已实现收益 | 10,133,991.33 | 1,100,498.13 |
| 本期利润 | 13,835,466.14 | 1,510,114.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3420 | 0.3787 |
| 本期基金份额净值增长率 | 32.96% | 32.84% |
| 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 | 0.4427 | 0.3594 |
| 期末基金资产净值 | 80,650,521.38 | 20,058,591.52 |
| 期末基金份额净值 | 1.5922 | 1.5830 |

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、根据我公司2015年11月17日《关于安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同的公告》,自2015年11月17日起,本基金增加C类份额。C类份额自2015年11月18日起有份额。

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

| 安信优势增长混合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 | 3.28% | 1.25% | 2.96% | 0.58% | 0.32% | 0.67% |
| 过去三个月 | -1.45% | 1.52% | -0.11% | 0.75% | -1.34% | 0.77% |
| 过去六个月 | 32.96% | 1.54% | 14.27% | 0.77% | 18.69% | 0.77% |
| 过去一年 | 12.93% | 1.56% | 8.26% | 0.76% | 4.67% | 0.80% |
| 过去三年 | 48.53% | 1.20% | 17.47% | 0.55% | 31.06% | 0.65% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.22% | 1.03% | 1.09% | 0.79% | 58.13% | 0.24% |

安信优势增长混合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 | 3.26% | 1.25% | 2.96% | 0.58% | 0.30% | 0.67% |
| 过去三个月 | -1.50% | 1.53% | -0.11% | 0.75% | -1.39% | 0.78% |
| 过去六个月 | 32.84% | 1.55% | 14.27% | 0.77% | 18.57% | 0.78% |
| 过去一年 | 12.71% | 1.56% | 8.26% | 0.76% | 4.45% | 0.80% |
| 过去三年 | 48.36% | 1.20% | 17.47% | 0.55% | 30.89% | 0.65% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.05% | 1.09% | 10.04% | 0.63% | 41.01% | 0.46% |

注:根据《安信优势增长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:沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。其中沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求,基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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、本基金合同生效日为2015年5月20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、根据我公司2015年11月17日《关于安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同的公告》,自2015年11月17日起,本基金增加C类份额。C类份额自2015年11月18日起有份额。

§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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 聂世林 | 本基金的基金经理 | 2016年2月18日 | - | 11 | 聂世林先生,经济学硕士,历任安信证券股份有限公司资产管理部研究员、证券投资部研究员、安信基金管理有限责任公司研究部、权益投资部基金经理助理,现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金的基金经理助理;现任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合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

本报告期内,前期流动性宽松,二季度流动性稍有收紧,包商银行的接管对于信贷市场构成较大冲击;华为被美列入实体名单,关键零部件遭到禁运,5G产业链相关公司的预期被破坏;招行、浦发等也接到美国的传票等各种外部风险事件接连爆发。这对于市场偏好构成一定负面冲击。从国内经济来看,多数宏观经济指标持续走弱(发电量、货运量、柴油消费量等),地产销售增速回落,基建投资有所企稳;汽车消费受排放标准升级以及基数原因,增速下滑明显;其他可选消费类消费品都面临较大压力,企业的盈利增速仍还未探明底部。

由于企业盈利依然处于下滑过程,中小企业的盈利压力更大,白马龙头的经营抗风险能力相对要强。本产品坚持自下而上精选个股,行业配置方面,我们继续重点配置估值合理,竞争优势持续扩大的消费类龙头企业;地产产业链后周期受资金影响,竣工回升速度低于年初预期,业绩可能更晚才能看到回升。新能源汽车虽然短期受补贴退坡影响,但长期逻辑未改变,重点配置竞争格局好的细分子行业龙头。5G产业链确定性受益于未来2-3年的高强度投资建设,基站、消费电子等相关子行业将率先看到业绩的企稳反弹。

从资金角度看,海外的主动和被动配置资金流入非常明确,龙头白马的估值已经修复到相对合理区间。如果资金的配置集中度进一步提升,需要提防估值泡沫的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信优势增长混合A基金份额净值为1.5922元,本报告期基金份额净值增长率为32.96%;截至本报告期末安信优势增长混合C基金份额净值为1.5830元,本报告期基金份额净值增长率为32.84%;同期业绩比较基准收益率为14.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前的主要矛盾是国内经济的发展处于新旧动能转换的时期,过去以地产、基建为主要拉动力的发展模式已经遇到各种约束,资源消耗、环境压力、成本上升等等。中国的制造业企业经过几十年的发展,在全球的竞争力越来越强,顺差规模持续扩大,导致外部摩擦越来越多,原有的发展模式难以为继。以新能源汽车、5G、集成电路等为代表的新兴产业处于早期阶段,需要较长一段时间的培育。

在上述的宏观背景下,消费将成为多数资金的一致方向。从长期来看,国内空间巨大,随着居民财富增加,升级趋势明确。科创板的推出,将引导资金通过直接融资方式支持高新技术企业的研发,配合各种政策鼓励,税收优惠,人才激励等,未来必将产生一批具有核心技术的科技类公司。这两个方向将是未来重点配置的领域。

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2月3日。

§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,招商证券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,完全履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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:安信优势增长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 | 9,031,043.93 | 3,109,600.91 |
| 结算备付金 | 351,051.55 | 453,713.51 |
| 存出保证金 | 128,425.62 | 136,165.44 |
| 交易性金融资产 | 91,366,369.10 | 41,231,843.75 |
| 其中:股票投资 | 91,342,369.42 | 41,231,843.75 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 23,999.68 | - |
| 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 | 228,112.83 | 1,580,385.73 |
| 应收利息 | 5,028.15 | 1,792.40 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 183,908.40 | 10,120.87 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 101,293,939.58 | 46,523,622.61 |
| 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 | 131,922.58 | - |
| 应付赎回款 | 196,962.84 | 12,284.72 |
| 应付管理人报酬 | 76,757.02 | 40,995.16 |
| 应付托管费 | 15,351.43 | 8,199.04 |
| 应付销售服务费 | 1,968.46 | 530.88 |
| 应付交易费用 | 105,686.43 | 111,340.43 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 56,177.92 | 130,036.21 |
| 负债合计 | 584,826.68 | 303,386.44 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 63,325,591.73 | 38,610,350.72 |
| 未分配利润 | 37,383,521.17 | 7,609,885.45 |
| 所有者权益合计 | 100,709,112.90 | 46,220,236.17 |
| 负债和所有者权益总计 | 101,293,939.58 | 46,523,622.61 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额63,325,591.73份,其中安信优势增长混合A基金份额总额为50,654,604.68份,基金份额净值1.5922元;安信优势增长混合C基金份额总额为12,670,987.05份,基金份额净值1.5830元。

6.2 利润表

会计主体:安信优势增长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 | 16,169,399.07 | -2,661,944.87 |
| 1.利息收入 | 94,304.87 | 127,733.19 |
| 其中:存款利息收入 | 68,285.93 | 54,195.54 |
| 债券利息收入 | 8.51 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 26,010.43 | 73,537.65 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 11,837,152.71 | 3,235,664.57 |
| 其中:股票投资收益 | 10,938,137.55 | 2,980,524.86 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 475.24 | - |
| 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 | 898,539.92 | 255,139.71 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 4,111,090.68 | -6,255,581.95 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 126,850.81 | 230,239.32 |
| 减:二、费用 | 823,818.93 | 1,312,543.98 |
| 1. 管理人报酬 | 328,772.68 | 282,588.59 |
| 2. 托管费 | 65,754.65 | 56,517.75 |
| 3. 销售服务费 | 5,897.58 | 4,319.26 |
| 4. 交易费用 | 348,829.06 | 861,258.23 |
| 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 | 74,564.96 | 107,860.15 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 15,345,580.14 | -3,974,488.85 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 15,345,580.14 | -3,974,488.85 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信优势增长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) | 38,610,350.72 | 7,609,885.45 | 46,220,236.17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 15,345,580.14 | 15,345,580.14 |
| 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) | 24,715,241.01 | 14,428,055.58 | 39,143,296.59 |
| 其中:1.基申购款 | 54,252,461.95 | 31,381,602.02 | 85,634,063.97 |
| 2.基赎回款 | -29,537,220.94 | -16,953,546.44 | -46,490,767.38 |
| 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) | 63,325,591.73 | 37,383,521.17 | 100,709,112.90 |
| 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) | 41,474,729.18 | 21,715,340.26 | 63,190,069.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -3,974,488.85 | -3,974,488.85 |
| 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) | -9,936,863.21 | -4,828,280.63 | -14,765,143.84 |
| 其中:1.基申购款 | 26,698,099.10 | 14,966,578.44 | 41,664,677.54 |
| 2.基赎回款 | -36,634,962.31 | -19,794,859.07 | -56,429,821.38 |
| 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) | 31,537,865.97 | 12,912,570.78 | 44,450,436.75 |

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

安信优势增长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4月23日下发的证监许可[2015]728号文"关于核准安信优势增长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《安信优势增长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5月11日至2015年5月15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_H42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4,558,883,275.97元。经向中国证监会备案,《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月20日正式生效,截至2015年5月20日止,安信优势增长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4,558,883,275.97元,折合4,558,883,275.97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275,616.80元,折合275,616.80份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币4,559,158,892.77元,折合4,559,158,892.77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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同,经基金管理人安信基金管理有限责任公司与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,自2015年11月17日起增加C类份额。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、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;在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用,且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。原有的基金份额全部自动转为安信平稳增长混合型发起式证券投资基金A类份额。

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)、债券、货币市场工具、权证、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)。本基金各类资产投资比例为: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。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%。

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

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 |
| 招商证券股份有限公司(以下简称"招商证券") | 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(%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 安信证券 | 172,218,660.62 | 61.59 | 638,136,235.89 | 97.18 |
| 招商证券 | 15,197,579.85 | 5.43 | - | - |

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告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 | 123,747.85 | 61.50 | 97,898.32 | 92.63 |
| 招商证券 | 10,809.90 | 5.37 | - | - |
| 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 | 453,904.06 | 97.10 | 187,903.58 | 93.28 |

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 | 328,772.68 | 282,588.59 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 101,627.72 | 78,802.67 |

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 | 65,754.65 | 56,517.75 |

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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信优势增长混合A | 安信优势增长混合C | 合计 |
| 安信基金 | - | 5,093.53 | 5,093.53 |
| 安信证券 | - | 722.53 | 722.53 |
| 招商证券 | - | 10.23 | 10.23 |
| 合计 | - | 5,826.29 | 5,826.29 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信优势增长混合A | 安信优势增长混合C | 合计 |
| 安信基金 | - | 4,319