安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行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。

安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成。安信新起点灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会表决投票时间为2019年3月26日至2019年4月22日,会议审议通过了《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,权益登记日为2019年3月25日。2019年4月25日,本基金管理人发布《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,该决议自2019年4月24日起生效。依据中国证监会2019年3月13日《关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]375号)及上述基金份额持有人大会决议,安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、基金估值、基金费用、收益分配等事项,并更名为"安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金"。自2019年5月7日起,由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金》生效,原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

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。

安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金报告期自2019年5月7日起至6月30日止,原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日起至5月6日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	安信量化沪深300增强	
基金主代码	003957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年5月7日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,202,520.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化沪深300增强A	安信量化沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	628,537.35份	33,573,982.66份

1.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	安信新起点混合	
基金主代码	003957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月16日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	61,360,856.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信新起点混合A	安信新起点混合C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	586,304.23份	60,774,551.77份

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求有效跟踪标的指数,控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%的基础上,结合量化方法,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金,在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上,通过数量化模型进行投资组合优化,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。股票投资上,本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合,并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段,严格将跟踪误差控制在规定范围内,控制与标的指数主动偏离的风险。同时,本基金在保证基金资产流动性的基础上,进行债券投资,提高基金资产的投资收益。此外,本基金将合理利用权证、股指期货、国债期货等衍生工具进行投资,并在基础资产类型和资产池现金流研究基础上,进行资产支持证券的投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*90%+商业银行活期存款利率(税后)*10%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

1.1 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金将以严格风险管理与控制为前提,通过积极主动的资产配置和灵活多样的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面,本基金通过分析宏观指标和政策,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。固定收益投资方面,本基金在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购、可转换债券等投资策略,配置流动性好、风险溢价水平合理、剔除收益率和信用质量较高的品种。股票投资方面,遵循自上而下和自下而上相结合原则,挖掘增长潜力巨大、同时符合资本市场阶段偏好的标的,同时,灵活运用多种低风险投资策略与事情驱动策略,把握市场定价偏差带来的投资机会。此外,本基金将合理利用权证、股指期货、国债期货等衍生工具,实现基金资产保值增值。
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798

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

1.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年5月7日(基金合同生效日)-2019年6月30日)	
	安信量化沪深300增强A	安信量化沪深300增强C
本期已实现收益	21,357.80	1,235,902.57
本期利润	40,135.37	2,090,967.91
加权平均基金份额本期利润	0.0647	0.0526
本期基金份额净值增长率	6.04%	6.01%
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	0.0608	0.0519
期末基金资产净值	703,779.97	37,278,477.95
期末基金份额净值	1.1197	1.1103

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、本基金自2019年5月7日起,由《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金》生效,原《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。

1.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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5月6日)	
	安信量化沪深300增强A	安信量化沪深300增强C
本期已实现收益	64,869.99	7,749,351.72
本期利润	96,545.78	16,075,777.32
加权平均基金份额本期利润	0.1725	0.2078
本期基金份额净值增长率	21.37%	21.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年5月6日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0264	0.0181
期末基金资产净值	619,065.47	63,653,910.66
期末基金份额净值	1.0559	1.0474

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、本基金自2019年5月7日起,由《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金》生效,原《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。

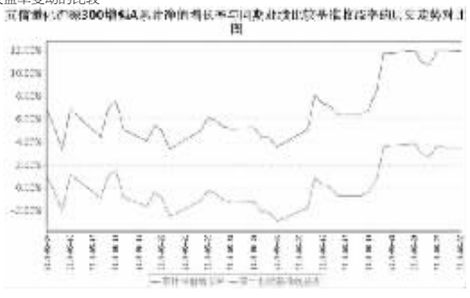
3.1 基金净值表现(转型后)

3.1.1 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

安信量化沪深300增强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	6.51%	1.16%	4.86%	1.04%	1.65%	0.12%
自基金转型(2019年5月7日)以来	6.04%	1.32%	3.47%	1.22%	2.57%	0.10%
安信量化沪深300增强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	6.48%	1.16%	4.86%	1.04%	1.62%	0.12%
自基金转型(2019年5月7日)以来	6.01%	1.32%	3.47%	1.22%	2.54%	0.10%

注:根据《安信量化精选沪深300指数增强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*90%+商业银行活期存款利率(税后)*10%。沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。

3.1.2 自基金转型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、本基金自2019年5月7日由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成,本基金基金合同生效日为2019年5月7日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。

1.1 基金净值表现(转型前)

3.1.3 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

安信新起点混合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
2019年4月1日至2019年5月6日	-4.19%	1.76%	-3.01%	0.87%	-1.18%	0.89%
2019年1月1日至2019年5月6日	21.37%	1.56%	10.29%	0.80%	11.08%	0.76%
2019年7月1日至2019年5月6日	7.03%	1.49%	4.08%	0.77%	2.95%	0.72%
自基金合同生效起至2019年5月6日	5.59%	1.11%	5.29%	0.59%	0.30%	0.52%
安信新起点混合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
2019年4月1日至2019年5月6日	-4.22%	1.76%	-3.01%	0.87%	-1.21%	0.89%
2019年1月1日至2019年5月6日	21.28%	1.56%	10.29%	0.80%	10.99%	0.76%
2019年7月1日至2019年5月6日	6.84%	1.49%	4.08%	0.77%	2.76%	0.72%
自基金合同生效起至2019年5月6日	4.74%	1.11%	5.29%	0.59%	-0.55%	0.52%

注:根据《安信新起点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:50%*沪深300指数收益率+50%*中债总指数(全价)收益率。沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限责任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。

3.1.4 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2017年3月16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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、本基金自2019年5月7日起,由《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金》生效,原《新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。

§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(转型后)

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		
徐黄玮	本基金的基金经理	2017年11月1日	-	12	徐黄玮先生,理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任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,安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;现任安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金(原安信新起点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基金、安信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。

1.1.1 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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		
徐黄玮	本基金的基金经理	2017年11月1日	-	12	徐黄玮先生,理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任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,安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;现任安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金(原安信新起点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基金、安信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。
王坤	本基金的基金经理助理	2017年3月16日	2019年1月17日	4	王坤先生,金融学硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。曾任安信永鑫定期开放债券式证券投资基金的基金经理助理,现任安信基金目标收益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、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信新起点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的基金经理助理。

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

上半年宏观经济仍处于回落区间,行业景气多数下行,包商事件对市场情绪有影响,且中美贸易压力有所升温。经济下行压力和美国降息预期继续催生市场对宽松政策的期待,货币政策中性偏宽松,市场流动性相对充裕。中美贸易谈判和金融供给侧改革的进展仍需继续观察。

本基金运用量化多因子模型,综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素,以自下而上为主,自上而下为辅,精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的,并积极把握指数分红、指数成分调整、新股等确定性增强机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金A类基金份额净值为1.1197元,自2019年5月7日起至2019年6月30日止,基金份额净值增长率为6.04%;截至2019年6月30日,安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金C类基金份额净值为1.1103元,自2019年5月7日起至2019年6月30日止,基金份额净值增长率为6.01%;同期业绩比较基准收益率为3.47%。

截至2019年5月6日,新起点灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值为1.0559元,自2019年1月1日起至2019年5月6日止,基金份额净值增长率为21.37%;截至2019年5月6日,新起点灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值为1.0474元,自2019年1月1日起至2019年5月6日止,基金份额净值增长率为21.28%;同期业绩比较基准收益率为10.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,本基金会持续关注经济数据以及中美贸易的进展,将市场及政策的变化当作宏观变量,结合量化模型,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

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。

4.7 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

转型后:

自2019年5月7日起至2019年6月30日止,安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金出现了连续20个工作日资产净值低于五千万元的情形,时间范围为2019年5月14日至2019年6月30日。

转型前:

无。

§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,本基金托管人在对安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,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

本报告期内,安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)

6.1 资产负债表

会计主体:安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金

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
资 产:	
银行存款	1,395,968.26
结算备付金	338,240.49
存出保证金	261,681.15
交易性金融资产	35,233,264.99
其中:股票投资	33,472,515.11
基金投资	-
债券投资	1,760,749.88
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	1,000,000.00
应收证券清算款	29,044.16
应收利息	32,256.31
应收股利	-
应收申购款	3,902.55
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	38,294,357.91
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30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	127,031.37
应付赎回款	3,255.48
应付管理人报酬	23,807.02
应付托管费	2,975.88
应付销售服务费	5,838.84
应付交易费用	63,005.33
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	86,186.07
负债合计	312,099.99
所有者权益:	
实收基金	34,202,520.01
未分配利润	3,779,737.91
所有者权益合计	37,982,257.92
负债和所有者权益总计	38,294,357.91

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额总额34,202,520.01份,其中安信量化沪深300增强A基金份额总额为628,537.35份,基金份额净值1.1197元;安信量化沪深300增强C基金份额总额为33,573,982.66份,基金份额净值1.1103元。

2、本基金的基金合同于2019年5月7日生效,无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体:安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期:2019年5月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年5月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	2,323,874.91
1.利息收入	13,572.49
其中:存款利息收入	3,325.30
债券利息收入	9,126.37
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,120.82
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,435,356.78
其中:股票投资收益	1,198,284.89
基金投资收益	-
债券投资收益	-4,303.46
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-139,440.00
股利收益	380,815.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	873,842.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,102.73
减:二、费用	192,771.63
1.管理人报酬	51,097.05
2.托管费	6,387.15
3.销售服务费	12,574.64
4.交易费用	75,428.93
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	47,283.86
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,131,103.28
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,131,103.28

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期:2019年5月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年5月7日(基金合同生效日)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)	61,360,856.00	2,912,120.13	64,272,976.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,131,103.28	2,131,103.28
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)	-27,158,335.99	-1,263,485.50	-28,421,821.49
其中:1.基金申购款	671,795.80	54,174.07	725,969.87
2.基金赎回款	-27,830,131.79	-1,317,659.57	-29,147,791.36
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)	34,202,520.01	3,779,737.91	37,982,257.92

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:	
刘人领	范璞	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

安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"安信新起点混合")转型而成。基金转型事项获中国证监会2019年3月13日《关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]375号)批复,并经安信新起点灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会决议通过。自2019年5月7日起,由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效,原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。原安信新起点混合为契约型开放式,存续期限不定。根据中国证监会2019年3月13日《关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]375号)批复并生效的原安信新起点混合份额持有人大会决议,自2019年5月7日起,原基金安信新起点混合更名为安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金"),为契约型开放式基金,存续期限不定。

原安信新起点混合于基金合同失效前的基金资产净值为64,272,976.13元,基金份额为61,360,856.00份,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值、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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(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(包括国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等)、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、国债期货、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货和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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*90%+商业银行活期存款利率(税后)*10%

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5月7日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

1.1.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日至12月31日止。惟本会计期间为自2019年5月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日止。

6.4.4.1 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项;

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当

(上接B287版)

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月6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)	87,333,708.26	-11,908,570.17	75,425,138.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,172,323.10	16,172,323.10
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)	-25,972,852.26	-1,351,632.80	-27,324,485.06
其中:1.基金申购款	18,805,755.06	-1,818,633.44	16,987,121.62
2.基金赎回款	-44,778,607.32	467,000.64	-44,311,606.68
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)	61,360,856.00	2,912,120.13	64,272,976.13

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)	155,930,692.26	11,236,680.02	167,167,372.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,536,710.33	-12,536,710.33
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)	-14,161,178.86	-1,495,274.60	-15,656,453.46
其中:1.基金申购款	12,549,632.46	775,954.03	13,325,586.49
2.基金赎回款	-26,710,811.32	-2,271,228.63	-28,982,039.95
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)	141,769,513.40	-2,795,304.91	138,974,208.49

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:	
刘人领	范璞	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

6.7 报表附注

6.7.1 基金基本情况

安信新起点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")2016年11月16日下发的证监许可[2016]2739号文"关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金注册的批复"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《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金合同》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2016年12月12日至2017年3月10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(2017)验字第60962175_H02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291,566,487.95元。经向中国证监会备案,《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月16日正式生效。截至2017年3月14日止,安信新起点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291,566,487.95元,折合291,566,487.95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13,082.15元,折合13,082.15份基金份额。其中A类基金份额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772,357.05元,折合772,357.05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2,377.37元,折合2,377.37份基金份额。C类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币290,794,130.90元,折合290,794,130.90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10,704.78元,折合10,704.78份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币291,579,570.10元,折合291,579,570.10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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会表决投票时间为2019年3月26日至2019年4月22日,会议审议通过了《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,根据本基金份额持有人大会决议,本基金管理人于2019年4月25日发布《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,该决议自2019年5月7日起生效。依据中国证监会2019年3月13日《关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]375号)及上述基金份额持有人大会决议,安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、基金估值、基金费用、收益分配等事项,并更名为"安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金"。自2018年6月12日起,由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效,原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新起点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(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券等)、资产支持证券、银行存款、债券回购、其他货币市场工具、权证、国债期货、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为: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%,每个交易日日终在扣除国债期货和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:50%*沪深300指数收益率+50%*中债总指数(全价)收益率

6.7.2 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。

6.7.3 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日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.7.4 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。

6.7.5 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。

6.7.6 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。

6.7.7 关联方关系

6.7.7.1 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。

6.7.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(以下简称"工商银行")	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
中广核财务有限责任公司	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
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	基金管理人子公司

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。

6.7.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.7.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.7.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.7.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.7.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.7.8.2 关联方报酬

6.7.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月6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	216,131.40	617,416.28
其中:支付销售机构的客户维护费	1,395.58	1,022.84

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0.80%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.80%/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

6.7.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月6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	27,016.44	77,177.05

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0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/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

6.7.8.2.3 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5月6日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新起点灵活配置混合A	安信新起点灵活配置混合C	合计
工商银行	-	-	-
安信基金	-	53,047.15	53,047.15
安信证券	-	46.58	46.58
合计	-	53,093.73	53,093.73

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		
	安信新起点灵活配置混合A	安信新起点灵活配置混合C	合计
工商银行	-	-	-
安信基金	-	153,419.82	153,419.82
安信证券	-	100.81	100.81
合计	-	153,520.63	153,520.63

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。

6.7.8.3 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。

6.7.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.7.8.4.1 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5月6日	
	安信新起点灵活配置混合A	安信新起点灵活配置混合C
基金合同生效日(2017年3月16日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	11,578,094.25
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	-	11,578,094.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	18.8700%

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	安信新起点灵活配置混合A	安信新起点灵活配置混合C
基金合同生效日(2017年3月16日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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。

6.7.8.4.2 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

本基金的其他关联方本期末及上年度末未持有本基金份额。

6.7.8.5 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5月6日			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	969,269.90	6,730.56	1,988,696.75	17,857.96

注:本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管,按约定利率计息。

6.7.8.6 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。

6.7.8.7 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其他关联交易事项。

6.7.9 期末(2019年5月6日)本基金持有的流通受限证券

6.7.9.1 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
002953	日丰股份	2019年4月26日	2019年5月9日	新股未上市	10.52	10.52	1,072	11,277.44	11,277.44	-

6.7.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002456	欧菲光	2019年4月29日	重大事项	12.07	2019年5月9日	10.86	10,500	140,270.03	126,735.00	-

6.7.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.7.9.3.1 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。

6.7.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事交易所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。

§7 投资组合报告(转型后)

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	33,472,515.11	87.41
	其中:股票	33,472,515.11	87.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,760,749.88	4.60
	其中:债券	1,760,749.88	4.60
	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	1,000,000.00	2.61
	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	1,734,208.75	4.53
8	其他各项资产	326,884.17	0.85
9	合计	38,294,357.91	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	509,575.00	1.34
B	采矿业	805,655.00	2.12
C	制造业	12,995,608.86	34.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,606.00	1.99
E	建筑业	1,005,244.00	2.65
F	批发和零售业	651,280.00	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	781,057.00	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,166,734.50	3.07
J	金融业	11,804,300.49	31.08
K	房地产业	1,762,975.00	4.64
L	租赁和商务服务业	354,460.20	0.93
M	科学研究和技术服务业	34,672.00	0.09
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	292,999.30	0.77
R	文化、体育和娱乐业	108,555.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	33,027,722.35	86.96

7.2.2 报告期末积极投资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	-	-
C	制造业	387,281.00	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,511.76	0.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	444,792.76	1.17

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	33,800	2,995,018.00	7.89
2	600519	贵州茅台	1,600	1,574,400.00	4.15
3	600036	招商银行	33,200	1,194,536.00	3.14
4	600030	中信证券	34,300	816,683.00	2.15
5	601166	兴业银行	44,481	813,557.49	2.14
6	000333	美的集团	15,050	780,493.00	2.05
7	000651	格力电器	14,000	770,000.00	2.03
8	000858	五粮液	5,800	684,110.00	1.80
9	600887	伊利股份	19,156	640,001.96	1.69
10	601288	农业银行	171,500	617,400.00	1.63

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。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600549	厦门钨业	7,400	105,894.00	0.28
2	002371	北方华创	1,100	76,175.00	0.20
3	002675	东诚药业	6,900	75,348.00	0.20
4	600132	重庆啤酒	1,400	66,024.00	0.17
5	300450	先导智能	1,900	63,840.00	0.17

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600989	宝丰能源	270,838.72	0.71
2	600000	浦发银行	229,375.00	0.60
3	601166	兴业银行	221,784.00	0.58
4	300498	温氏股份	216,660.00	0.57
5	601933	永辉超市	197,470.00	0.52
6	601988	中国银行	192,184.00	0.51
7	002422	科伦药业	191,172.00	0.50
8	601328	交通银行	171,597.00	0.45
9	600030	中信证券	170,187.00	0.45
10	600016	民生银行	160,257.00	0.42
11	002044	美年健康	158,601.00	0.42
12	002179	中航光电	157,790.00	0.42
13	600340	华夏幸福	154,776.00	0.41
14	601169	北京银行	153,328.00	0.40
15	000166	申万宏源	147,900.00	0.39
16	600570	恒生电子	139,319.00	0.37
17	600438	通威股份	128,324.00	0.34
18	300059	东方财富	128,098.00	0.34
19	002146	荣盛发展	108,555.00	0.29
20	601766	中国中车	100,500.00	0.26

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,007,834.00	5.29
2	600519	贵州茅台	1,257,502.00	3.31
3	600036	招商银行	1,008,585.00	2.66
4	601328	交通银行	707,754.00	1.86
5	000651	格力电器	609,543.00	1.60
6	601166	兴业银行	596,344.00	1.57
7	601668	中国建筑	548,250.00	1.44
8	600030	中信证券	544,285.00	1.43
9	000333	美的集团	538,387.00	1.42
10	601988	中国银行	478,500.00	1.26
11	000002	万科A	443,323.00	1.17
12	002304	洋河股份	432,336.58	1.14
13	601169	北京银行	427,872.00	1.13
14	601601	中国太保	423,408.57	1.11
15	002415	海康威视	410,561.00	1.08
16	601009	南京银行	388,912.00	1.02
17	600887	伊利股份	379,653.00	1.00
18	600104	上汽集团	376,076.00	0.99
19	601229	上海银行	374,989.00	0.99
20	600989	宝丰能源	374,849.88	0.99

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	7,428,300.30
卖出股票收入(成交)总额	34,014,845.74

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,751,750.00	4.61
	其中:政策性金融债	1,751,750.00	4.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,999.88	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,760,749.88	4.64

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	108901	农发1801	17,500	1,751,750.00	4.61
2	113028	环境转债	90	8,999.88	0.02

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1907	IF1907	2	2,283,000.00	2,100.00	-
公允价值变动总额合计(元)					2,100.00
股指期货投资本期收益(元)					-139,440.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					252,840.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,以控制并调整投资组合风险、提高投资的资金效率,降低跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。

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

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行国债期货投资,将构建量化分析体系,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管理利率波动风险,实现基金资产保值增值。

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合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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兴业银行(股票代码:601166),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。

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时"不符合法定条件,未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试,不具备任职资格"的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于2018年10月25日前整改,健全基金托管业务内部控制制度,加强从业人员管理,并于2018年10月25日前提交整改报告。

兴业银行股份有限公司于2018年8月21日因违规经营被深圳市消委会监管(约见)谈话,责令改正。

兴业银行股份有限公司于2018年9月12日因违规经营被上海证监局责令整改。

兴业银行股份有限公司于2019年3月31日因未依法履行职责被鼓东市场监管局罚款(鼓市场监管字[2018]108号)。

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	261,681.15
2	应收证券清算款	29,044.16
3	应收股利	-
4	应收利息	32,256.31
5	应收申购款	3,902.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,884.17

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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。

§1 投资组合报告(转型前)

1.1 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	58,245,529.56	90.25
	其中:股票	58,245,529.56	90.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,657,893.39	5.67
	其中:债券	3,657,893.39	5.67
	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	1,457,444.10	2.26
8	其他各项资产	1,174,275.80	1.82
9	合计	64,535,142.85	100.00

7.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.13.1 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	476,974.00	0.74
B	采矿业	1,696,336.00	2.64
C	制造业	23,224,258.34	36.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,171,723.00	1.82
E	建筑业	2,177,057.40	3.39
F	批发和零售业	1,063,602.00	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,689,010.40	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,495,254.28	2.33
J	金融业	21,066,151.14	32.78
K	房地产业	2,905,557.00	4.52
L	租赁和商务服务业	543,883.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	169,665.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	56,836.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	403,550.00	0.63
R	文化、体育和娱乐业	105,672.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	58,245,529.56	90.62

7.13.2 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。

7.14 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	601318	中国平安	59,100	4,798,920.00	7.47
2	600519	贵州茅台	3,000	2,718,000.00	4.23
3	600036	招商银行	62,800	2,129,548.00	3.31
4	000651	格力电器	25,200	1,298,556.00	2.02
5	000333	美的集团	25,650	1,258,645.50	1.96
6	601166	兴业银行	64,881	1,254,798.54	1.95
7	600030	中信证券	52,700	1,092,998.00	1.70
8	601288	农业银行	267,100	974,915.00	1.52
9	601668	中国建筑	166,260	962,645.40	1.50
10	600887	伊利股份	31,756	952,680.00	1.48

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。