安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2018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:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年08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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08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2018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	安信合作创新混合
基金主代码	004393
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月29日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,434,314.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上,在本基金关注的领域内精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资,注重安全边际,为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	资产配置上,本基金以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,结合定量分析的方法,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资上,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活投资于具有合作创新(Public-Private-Partnership,简称PPP)主题相关领域的上市公司证券,通过合作创新(PPP)主题股票池的构建和个股精选,谋求基金资产的长期稳定增长。债券投资上,以企业债、公司债和可转债为主,并根据流动性管理的需要配置国债和货币市场工具。此外,本基金将投资于股指期货、权证、资产支持证券等,实现基金资产保值增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生AH股H指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	王永民
	联系电话	0755-82509999	010-66594896
	电子邮箱	service@essencefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95566
传真		0755-82799292	010-66594942

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(2018年01月01日 - 2018年06月30日)
本期已实现收益	10,885,778.26
本期利润	-6,591,029.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0356
本期基金份额净值增长率	-3.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1598
期末基金资产净值	213,301,180.37
期末基金份额净值	1.1756

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

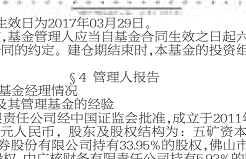
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去一个月	-4.48%	1.09%	-4.90%	0.77%	0.42%	0.32%
过去三个月	-4.48%	1.03%	-5.24%	0.69%	0.76%	0.34%
过去六个月	-3.28%	1.08%	-5.18%	0.73%	1.90%	0.35%
过去一年	9.29%	0.91%	1.54%	0.60%	7.75%	0.31%
自基金合同生效起至今	17.56%	0.87%	3.95%	0.56%	13.61%	0.31%

注:根据《安信合作创新主题沪港深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:沪深300指数收益率×40%+恒生AH股H指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。其中沪深300指数是中证指数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。本基金选择该指数作为股票(不含港股通标的股票)投资部分的业绩比较基准。恒生AH指数系列包括同时以A股形式及H股形式上市,市值最大及成交最活跃的中国公司为成分股。其中,恒生AH股H指数用以量度成分股在H股市场的表现。本基金选择该指数作为港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。本基金选择该指数作为债券投资部分的业绩比较基准。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40%、20%、40%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2017年03月29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2018年6月30日,本基金管理人共管理42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期开放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金;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日管理安信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日起管理安信保证金交易型货币市场基金;从2016年9月29日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金;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;2018年6月12日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金;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。

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
陈一峰	本基金的基金经理,总经理助理兼研究总监	2017年3月29日	-	10.0	陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、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的基金经理。
张明	本基金的基金经理	2017年5月5日	-	7.0	张明先生,管理学硕士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员,2011年12月加入安信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、特定资产管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,安信中国制造2025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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
谭珏娜	本基金的基金经理	2017年12月6日	-	12.0	谭珏娜女士,经济学学士。历任招商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员,2013年4月加入安信基金管理有限责任公司,历任运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理,现任研究部研究员。现任安信工业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的基金经理。
李巍	本基金的基金经理助理	2017年3月29日	-	5.0	李巍先生,理学硕士。曾任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员,富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金、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、安信新成长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、安信新价值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的基金经理助理。现任安信永盛定期开放债券型发起式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

本产品一直坚持自下而上的投资选股思路,在充分研究公司商业模式,竞争优势,公司成长空间,行业竞争格局的背景下,结合估值水平,注重安全边际,选择低估值的价值股和合理估值的成长股,总结成一句话就是:"好公司,好价格,买入并持有,赚钱是大概率事件"。

今年上半年整体呈现下跌走势,上证指数下跌13.9%,沪深300指数下跌12.9%,中证500指数下跌16.5%,创业板指数下跌8.3%。分行业来看,今年以来休闲服务、医药生物、食品饮料等行业涨幅靠前,通信、电器设备、有色金属等行业跌幅较大。截至2018年6月末,基金单位净值为1.1756,上半年收益率-3.28%,明显跑赢了市场指数。

本基金上半年运作总体与前述投资思路保持一致,始终在符合合作创新主题范围的公司中,按照前述选股标准,筛选出便宜的好公司,我们相信长期投资这些优秀公司会给基金带来不错的收益,对于市场波动的加大不必太过担心,每次股票价格的大幅波动都是买入优秀公司的机会,股票投资最大的风险并不是股票价格的大幅波动,而是被投资公司为股东创造超额利润的能力是否存在大幅消失的可能性以及持续性,简而言之,我们选取的公司通常现在很赚钱,ROE比较高,现金流不错,未来是否能够维持是需要我们持续保持关注的。

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1.1756元,本报告期基金份额净值增长率为-3.28%,同期业绩比较基准收益率为-5.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通过观察年初以来国内发电量,工业增加值,房地产投资等数据,叠加中美贸易摩擦的影响,我们认为国内宏观经济走势下半年会有下行压力,但从中期来看,中国经济大概率没有失速的风险。

从A股重要指数的估值角度来看,自沪深300指数创立以来,市盈率历史中位数为14倍,市净率为1.8倍,而当前指数市盈率为11.5倍,市净率1.34倍均处于历史后1/4分位的水平,市净率水平离历史最低的1.2倍仅有10%的空间,中证500指数的估值情况与沪深300类似,都已处于历史后1/4分位水平,我们认为目前指数已经处于历史偏低的状态。在市场恐慌的时候应该保持理性,站在3年的时间维度,市场上涨的概率明显大于下跌的概率,我们认为现在是一个很好的投资时点。

未来若市场继续下跌,我们会适时将仓位提高。我们目前看好的公司主要集中在建筑建材、食品饮料、家电、轻工、新能源发电等细分行业的优秀公司。

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

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金(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(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、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:安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	49,361,743.48	54,605,654.52
结算备付金	54,913.36	55,794.44
存出保证金	28,018.57	88,007.59
交易性金融资产	167,246,152.51	209,837,308.57
其中:股票投资	167,246,152.51	209,509,010.51
基金投资	-	-
债券投资	-	328,298.06
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	10,459.70	12,166.61
应收股利	-	-
应收申购款	257,857.76	844,766.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	216,959,145.38	265,443,698.48
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	1,838,777.06	552.60
应付赎回款	1,292,690.05	2,201,992.32
应付管理人报酬	275,720.94	340,328.10
应付托管费	45,953.45	56,721.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	29,899.47	50,501.84
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,924.04	203,218.86
负债合计	3,657,965.01	2,853,315.09
所有者权益:		
实收基金	181,434,314.27	216,033,897.55
未分配利润	31,866,866.10	46,556,485.84
所有者权益合计	213,301,180.37	262,590,383.39
负债和所有者权益总计	216,959,145.38	265,443,698.48

注:报告截止日2018年06月30日,本基金份额净值人民币1.1756元,基金份额总额181,434,314.27份。

6.2 利润表

会计主体:安信合作创新主题沪港深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6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月29日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
一、收入	-4,258,541.41	32,278,128.01
1.利息收入	180,984.54	927,119.24
其中:存款利息收入	180,944.85	202,123.55
债券利息收入	39.69	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	724,995.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	12,676,230.65	301,228.11
其中:股票投资收益	10,574,709.85	-3,247,896.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	67,693.07	-
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	2,033,827.73	3,549,124.95
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-17,476,807.39	30,141,917.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	361,050.79	907,862.78
减:二、费用	2,332,487.72	2,925,143.23
1. 管理人报酬	1,710,132.77	1,767,979.37
2. 托管费	285,022.16	294,663.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	150,761.56	755,947.86
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.11	-
7. 其他费用	186,571.12	106,552.78
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-6,591,029.13	29,352,984.78
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-6,591,029.13	29,352,984.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信合作创新主题沪港深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6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	216,033,897.55	46,556,485.84	262,590,383.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,591,029.13	-6,591,029.13
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)	-34,599,583.28	-8,098,590.61	-42,698,173.89
其中:1.基金申购款	107,728,039.43	28,241,686.07	135,969,725.50
2.基金赎回款	-142,327,622.71	-36,340,276.68	-178,667,899.39
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)	181,434,314.27	31,866,866.10	213,301,180.37
项目	上年度可比期间 2017年03月29日(基金合同生效日)至 2017年06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)	530,344,288.39	-	530,344,288.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,352,984.78	29,352,984.78
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)	-222,177,041.28	-6,038,611.30	-228,215,652.58
其中:1.基金申购款	21,421,500.45	679,469.43	22,100,969.88
2.基金赎回款	-243,598,541.73	-6,718,080.73	-250,316,622.46
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)	308,167,247.11	23,314,373.48	331,481,620.59

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

安信合作创新主题沪港深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10月21日下发的证监许可[2016]2403号文"关于核准安信合作创新主题沪港深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《安信合作创新主题沪港深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2017年2月27日至2017年3月24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60962175_H04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530,202,398.01元。经向中国证监会备案,《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月29日正式生效。截至2017年3月28日止,安信合作创新主题沪港深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530,202,398.01元,折合530,202,398.01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141,890.38元,折合141,890.38份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币530,344,288.39元,折合530,344,288.39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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围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)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、公司债、企业债、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、股指期货、权证等金融衍生工具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%(其中,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0%-95%);本基金投资于合作创新主题相关证券的比例不低于本基金持有的非现金基金资产的80%;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×40%+恒生AH股H指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。

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2018年06月30日的财务状况以及2018年01月01日起至2018年06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
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	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	基金管理人的子公司

注:1) 本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司。

2) 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 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(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
安信证券	26,002,426.19	25.63	550,529,364.65	81.63

6.4.8.1.2 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

6.4.8.1.3 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	18,495.77	25.63	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年03月29日(基金合同生效日)至 2017年06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	391,591.88	81.63	215,218.64	94.94

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 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月29日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,710,132.77	1,767,979.37
其中:支付销售机构的客户维护费	451,733.93	662,209.82

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1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/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 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月29日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	285,022.16	294,663.22

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0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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

本基金本报告期内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

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

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 2018年1月1日 至 2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	49,361,743.48	180,320.69	24,740,229.40	178,629.45

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06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

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
6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
603105	芯能科技	2018年06月29日	2018年7月9日	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018年06月25日	2018年7月3日	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年06月29日	2018年7月9日	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
6.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别:权证										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.9.2 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
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项	10.43	-	-	110,000	1,100,200.00	1,147,300.00	-

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

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	167,246,152.51	77.09
	其中:股票	167,246,152.51	77.09
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	49,416,656.84	22.78
8	其他各项资产	296,336.03	0.14
9	合计	216,959,145.38	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

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	11,641,777.98	5.46
C	制造业	127,627,911.68	59.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.03
E	建筑业	5,165,310.95	2.42
F	批发和零售业	8,902,714.54	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	635,600.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	8,162,404.24	3.83
K	房地产业	2,806,000.00	1.32
L	租赁和商务服务业	803,985.27	0.38
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	1,024,200.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	166,841,464.51	78.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	404,688.00	0.19
合计	404,688.00	0.19

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

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	600519	贵州茅台	13,553	9,913,477.38	4.65
2	000651	格力电器	210,003	9,901,641.45	4.64
3	000786	北新建材	490,000	9,079,700.00	4.26
4	601088	中国神华	400,467	7,985,311.98	3.74
5	600352	浙江龙盛	630,000	7,528,500.00	3.53
6	601799	星宇股份	120,097	7,192,609.33	3.37
7	600309	万华化学	150,060	6,815,725.20	3.20
8	600566	济川药业	140,952	6,792,476.88	3.18
9	002563	森马服饰	450,800	6,446,440.00	3.02
10	000963	华东医药	112,632	5,434,494.00	2.55

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

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	600048	保利地产	3,123,000.00	1.19
2	300296	利亚德	2,698,000.00	1.03
3	600519	贵州茅台	2,187,172.00	0.83
4	002508	老板电器	1,652,900.00	0.63
5	600352	浙江龙盛	1,572,448.00	0.60
6	000786	北新建材	1,480,299.00	0.56
7	600612	老凤祥	1,354,391.00	0.52
8	600335	国机汽车	1,100,200.00	0.42
9	002367	康力电梯	1,066,124.00	0.41
10	600757	长江传媒	1,003,980.00	0.38
11	000726	鲁 泰A	985,641.00	0.38
12	000546	金圆股份	924,176.00	0.35
13	000651	格力电器	913,500.00	0.35
14	300197	铁汉生态	869,673.00	0.33
15	601939	建设银行	859,000.00	0.33
16	002677	浙江美大	780,600.00	0.30
17	600837	海通证券	712,000.00	0.27
18	601088	中国神华	704,400.00	0.27
19	600859	王府井	703,828.00	0.27
20	601398	工商银行	604,000.00	0.23

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

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	600068	葛洲坝	5,763,689.08	2.19
2	002310	东方园林	4,568,636.69	1.74
3	002202	金风科技	3,021,525.00	1.15
4	000651	格力电器	2,888,713.00	1.10
5	601799	星宇股份	2,750,986.96	1.05
6	002271	东方雨虹	2,704,196.00	1.03
7	002372	伟星新材	2,659,269.00	1.01
8	002508	老板电器	2,512,494.00	0.96
9	601088	中国神华	2,443,408.00	0.93
10	000786	北新建材	2,422,817.32	0.92
11	300197	铁汉生态	2,325,506.99	0.89
12	600036	招商银行	2,312,740.00	0.88
13	600566	济川药业	2,043,223.00	0.78
14	002051	中工国际	1,882,632.60	0.72
15	600887	伊利股份	1,791,843.00	0.68
16	600491	龙元建设	1,657,023.00	0.63
17	000963	华东医药	1,612,701.00	0.61
18	000488	晨鸣纸业	1,543,532.00	0.59
19	002027	分众传媒	1,460,524.00	0.56
20	000910	大亚圣象	1,385,809.00	0.53

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	34,198,603.52
卖出股票收入(成交)总额	69,559,363.98

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

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

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合约。

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

报告期内基金投资的前十名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。

7.12.2

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	28,018.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,459.70
5	应收申购款	257,857.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	296,336.03

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	占总份额比例(%)	个人投资者 持有份额	占总份额比例(%)
3,651	49,694.42	48,019,569.72	26.47	133,414,744.55	73.53

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	965,618.71	0.5322

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(2017年3月29日)基金份额总额	530,344,288.39
本报告期期初基金份额总额	216,033,897.55
本报告期基金总申购份额	107,728,039.43
减:本报告期基金总赎回份额	142,327,622.71
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	181,434,314.27

§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

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门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	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
招商证券	2	56,142,328.44	55.34%	39,934.47	55.34%	-
安信证券	2	26,002,426.19	25.63%	18,495.77	25.63%	-
渤海证券	1	19,306,255.55	19.03%	13,732.67	19.03%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	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会讨论及决定。

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	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	386,303.76	86.60%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	59,755.00	13.40%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180327-20180418;20180424-20180425;20180508-20180529;	-	35,886,180.34	-	35,886,180.34	19.78
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:

(1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2018年08月29日