安信比较优势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:中国农业银行股份有限公司 送出日期:2018年08月29日

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

度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2018年03月21日(基金合同生效日)起至6月30日止。 § 2 基金

简介 ?1 基金基本情况

2.1 基金	基本情况					
基金简称			安信比较优势混合			
基金主代码			006687			
基金运作方法	武		契约型开放式			
基金合同生产	牧 日		2018年3月21日			
基金管理人			安信基金管理有限责任公司			
基金托管人			中国农业银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额			2,054,138,988.62份			
基金合同存金	卖網		不定期			
2.2 基金	产品说明					
投资目标		的前提下,	基金通过科学、灵活的行业(板块)配置,在严格控制风险井保证充足流动性的损损。方,充分挖挪和利用在中国经济转型调整过程中具有明显比较优势的权益及资标的,谋求基金资产的长期稳定增值。			
投资策略		平、通胀水配置模型	本基金基于前瞻性的宏观经济研究,遵循国家政策的阶段性思路,根据利率水平,通胀水平、风险偏好等市场联感因素的变化趋势,利用主动式、科学的资产 起震模型进行大步资产配置,在基金合同约定的范围内通时动态调整股票,使 身和现金的投资比例。			
业绩比较基准	隹	沪深300指数收益率*70%+中债总指数(全价)收益率*30%				
风险收益特征	VE.	本基金为7 基金,但假	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	管理人和建	金托管	入			
	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	中国农业银行股份有限公司		
	姓名	乔江晖		贺倩		
信息披露负 责人	联系电话	0755-1	32509999	010-66060069		
	电子邮箱	service	e@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com		
obsistantes de calab	or .					

主要财务指标和其余

3.1 主要会计数据和

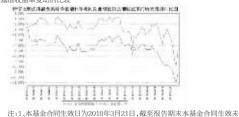
	金额甲位:人氏
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年03月21日 - 2018年06月30日)
本期已实现收益	54,737,652.49
本期利润	-109,399,776.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0447
本期基金份額净值增长率	-5.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0525
期末基金资产净值	1,946,263,778.33
期末基金份额净值	0.9475

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

	份额净值均	曾长率及其	与同期业组	责比较基准	收益率的	七较
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准整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	-2.97%	1.64%	-5.14%	0.89%	2.17%	0.75%
过去三个月	-6.31%	1.15%	-6.50%	0.79%	0.19%	0.36%
自基金合同 生效起至今	-5.25%	1.09%	-9.22%	0.80%	3.97%	0.29%

注:根据《安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的 注:根据《安信比较优势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×70%+中協点指数(全价)收益率×30%。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(全价)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取投资比例,选用上述业绩比较基准能够多观。合理也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70%、30%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。32.2 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



平。 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。 § 4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理情况

9、日本八版日 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93.84%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 署贸易有限公司持有20.28%的股权,中广核财务有限责任公司持有5.03%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6日起管理安信现金管理货币市 场基金;从2013年7月24日起管理安信室和债券型证券投资基金,但、1007年10月度 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2014年12月31日起管理安信条位选灵活配置部合型证 券投资基金,从2014年12月1日起管理安信的推选股票型证券投资基金,从2014 個秀型业券投资基金;从2013年12月31日起管理室信護支忧远灵活配置混合型业券投资基金;从2014年4月21日起管理室信育价值精选股票型证券投资基金;从2014年4月24日起管理空信测金管判货币市场基金;从2015年3月19日起管理空信消费经药主题坚约主要经济主题坚则证券投资基金;从2015年5月16年月15日起管理空信治公策略灵活起置混合型证券投资基金;从2015年5月10日起管理空信允劳增长灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月20日起管理空信优势增长灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月20日起管理空信范的基份型信息混合型证券投资基金;从2015年5月20日起管理安信范的基份型企业券投资基金;从2015年5月26日起管理安信德设置发行起置混合型证券投资基金;从2015年5月26日营理安信德健增值灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月26日营理安信德健增值灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券投资基金,从2015年5月26日营证券上2015年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2015年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月26日与2615年5月5日与2615年5月26日与2 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 2010年6月6日成百里安百鑫女侍列政店配息在百宝证对汉文基金;次4010年07/ 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金;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 宣称古堂址:外校对基金;从2010年7月26日返自建文信制70远央店配置在古堂址 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 9日返自建安自称此正义%至以11中物基金;从2016年9月29日返自建安自制成下 吳江託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明开放债券型证券投资基金;从2016 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 从2016年10月12日起管理安信沪深300階数增强组发起式业券投资基金;从2016年10月17日起管理安信前期全货市市场基金;从2016年12月15日起管理安信新规野灵活配置 海合型游券投资基金;从2017年1月13日至2018年6月11日管理安信新规野灵活配置 海合型游券投资基金;从2017年1月13日至2018年6月11日管理安信新规野灵活配置海合型证券投资基金;从2017年2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净接项灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月26日起管理安信中国制造2025净接项灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月29日起管理安信令作创新主题消拾研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消拾研灵活配置指合型 770以海监,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40主题沪港採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。

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	高任日期			
陈振宇	本基金的基金经理,副总经理	2018年3月 21日	-	24.0	與兩字先生,關於於學。然於學師 上 所任大趣證券有限責任今的 证券投資兩於學,竟严懷層極的 於學,和商正券股份有限公司 以略证券查查你总參與,安信证 券股份有限公司 於理,這券投資兩端的於學,安信证 多經,這券投資兩端的於學, 完全管實有有限計化公司 是一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個	
寂玮	本基金的基金经理	2018年3月 21日	-	8.0	與執先生,理学博士。所任何证 對股份有限公司信益金會報何數任 研究员,並信基金管理有限责任 公司的好應即行及,现任金经营配 金管理得到责任公司设金经营配 報告起表面。 整理是有限责任公司设金经营配 或者是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是	

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。

关于证券从业人员范围的相关规定。 42 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》、《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。沒有损害基金份额持有人 和达约5分方。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.31 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任异常交易行为。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 时交易你办

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年上半年及陆市验试库显页下选走势,风格轮转频繁,1月份银行地产大
涨,2月份周期股表现较好。3月份科技股大幅上涨,4月份科技股大幅回答而医药
股表现强势,5月份周期股大师下挫而消费股表现强势,6月份消费股、科技股大幅
回答而周期股表现较好。对于这种吃动的下跌模式、我们认为主要有几方面的原
因:1) 去杠杆的全方位执行,使得大家对未来经济的下行充满了担忧,进而持续降
低市场的风险偏好,打压地产和周期股的估值。从微观上看,地产利用即的签营数
据与盈利状况又持续好于大家的预期,因此也会不时引起市场的关注和热情。宏观
预期与盈利状况又持续好于大家的预期,因此也会不时引起市场的关注和热情。宏观
预期与温和对战又持续好于大家的预期,因此也会不时引起市场的关注和热情。宏观
预期,并且指向发国未来的商业技产业、走向时好时环使相关。家对科技股的情绪也出
现剧烈波动;3) 消费股由于避开了周期与科技类股票的风险点。成为了大家的避

出了了可以的。 我们认为在去杠杆的过程中,尽管会对需求侧造成一定的冲击,但冲击整体可 投。事实上、经济的真实表现是一再超出市场领期的、社嫌数据的大幅回落,并没有 接。事实上、经济的真实表现是一再超出市场领期的、社嫌数据的大幅回落,并没有 导致经济出现调整。逻辑上看,社融数据的回落过程中,企业周转效率的提升、融资 依套的减少使得资金周置和空转的情况大幅好转,有效的支撑了实体经济。从更长 近来看,去杠杆的成功实施。将从很大程度上消除过去流压杆经营带来的潜在风险 和估值压力,尽管企业的增长速度会更加温和,但是增长的稳定性会大幅提高,是 明显有利于估值提升的,而当下A股的整体估值是历史低位,因此潜存收益空间是比较大的,关于贸易战,随着事态发展,我们认为市场已经反映得比较充分,已经成熟的全球贸易体系不会轻易被打破,但增量的部分可能面临较大的重构,我国目前正在加大改革与开放的力度,直视知识产权保护,这些大方向无疑能有利于我则整济的长远发展,我们认为当前市场对于短期事件性的反应有些过激,对于长期利好的思考却是偏少的。总体上看,本基金的操作思想与对从对经济的相对乐观判断是一致,我们依然是市场上少数坚持高仓位并且维持相当比例周期头寸的基金产品,上坐在被长寿职一般

一致、我们依然是市场上少数坚持高仓位并且维持相当比例周期头可的基金产而,上半年整体表现一般。
442报台期内基金的业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为0.9475元,本报告期基金份额净值增长率为—5.25%。同期业绩比较基准收益率为—9.22%。
45管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望下半年,随着一系列的稳经济措施社台、去杠杆逐渐转为稳杠杆,市场对经济的强强担忧情绪有望得到稳定。上半年跌痛较大的周期股有望企稳回升。另外,市场对贸易战预期较为充分,再度变坏的可能性存在但不是很大,市场的信心有望随着一系列改革开放举措而逐步恢复。因此,我们相信下半年的市场环境要好于上半年。

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

b.2. 什官人对报告期内本基金投资运车建规寸信, 伊恒订算, 利雨灯配等间60 的说明
本托管人认为, 安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作, 基金资产净值的计算, 基金给制申购赎回价格的计算, 基金费用开支及利润分配等间面上, 不存在损害基金价额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按限基金合同的规定进行。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。本托管人认为, 安信基金管理有限责任公司的信息政策事务符合《证券投资基金信息技资管理办法》及其他相关法律法则的规定, 基金管理人所编制和投资的本基金半年度报告中的财务指标, 净值表现, 收益分配情忍, 财务会计报告、投资组合报告等信息真实, 准确, 完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。
《61 资产负债表会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表会计报告(对债的行为。

资产	本期末 2018年6月30日
资产:	
银行存款	164,216,263.69
结算备付金	34,714,708.17
存出保证金	883,531.04
交易性金融资产	1,759,109,047.93
其中:股票投资	1,759,109,047.93
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
费金属投资	-
衍生金融资产	-
买人返售金融资产	-
应收证券清算款	4,514,916.63
应收利息	41,798.93
以收股利	_
应收申购款	785,535.21
递延所得税资产	_
其他资产	_
资产总计	1,964,265,801.60
	本期末
负债和所有者权益 负债:	2018年6月30日
以 (页: 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	3,836,899.00
应付赎回款	8,476,494.61
应付管理人报酬	2,545,441.03
应付托管费	424,240.16
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,589,465.26
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
逆延所得税负债	_
其他负债	129,483.21
负债合计	18,002,023.27
所有者权益:	
实收基金	2,054,138,988.62
未分配利润	-107,875,210.29
所有者权益合计	1,946,263,778.33
负债和所有者权益总计	1,964,265,801.60

154,138,988.62份。 2.本基金的基金合同于2018年3月21日生效,无上年度可比期间。 6.2.利润表

	单位:人民
项目	本期 2018年3月21日 (基金合同生效日)至2018年6 月30日
一、收入	-92,103,546.44
1.利息收入	5,987,705.10
其中:存飲利息收入	1,294,164.13
债券利息收入	_
资产支持证券利息收入	-
买人返售金融资产收人	4,693,540.97
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	62,894,440.13
其中:股票投资收益	43,778,229.24
基金投资收益	-
债券投资收益	_
资产支持证券投资收益	_
费金属投资收益	-
衍生工具收益	_
股利收益	19,116,210.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-164,137,429.44
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,151,737.77
喊:二、费用	17,296,230.51
1. 管理人报酬	10,106,154.92
2. 托管费	1,684,359.08
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	5,377,508.20
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	128,208.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-109,399,776.95
域:所得税费用	
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-109,399,776.95

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期 2018年3月21日 (基金合同生效日)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)	2,885,419,428.16	-	2,885,419,428.16				
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期利 润)	-	-109,399,776.95	-109,399,776.96				
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)	-831,280,439.54	1,524,566.66	-829,755,872.88				
其中:1.基金申购款	26,532,385.55	-173,561.10	26,358,824.45				
2.基金赎回款	-857,812,825.09	1,698,127.76	-856,114,697.33				
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)	2,054,138,988.62	-107,875,210.29	1,946,263,778.33				

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署

6.4.1 基金基本情况

641 基金基本间的 安信比较优势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")2017年12月13日下发的证监许可 [2017]2230号文"关于准予安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金注册的批 货"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《安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本 分契约型开放式,存续期限不定。 本基金募集期间为2018年3月5日至2018年3月16日,募集结束经安永华明会

本基金募集期间为2018年3月5日至2018年3月16日,募集结束经安永华职会 计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2018월2李第60962175_1405号 验资报告,首次设立募集不包括认购资金利息其募集人民元2.884,051,84138 元。经向中国证监会备案、《安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金合 同》于2018年3月21日正式生效。截至2018年3月20日止,安信比较优势灵活配置 混合型证券投资基金已收到的首次发自募集即有效认购资金和能认购费品印能认购费品的等认 购金额为人民币2.884、051.841.98元,折合2.884、051.841.98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1,367,586.18元,折合1,367, 566.18份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币2.885,419,428.16元,折合2.885,419,428.16元,折合2.885,419,428.16元,标合2.885,419,428.16元,标合2.885,419,428.16元,标合2.885,419,428.16元,标合2.885,419,428.16元,标合3.885,419,428.16元,标码3.885,419,428.16元,在3.885,419,428.16元,在3.885,419,428.16 注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份

云口。 根据《中化人民共和国证券投资基金法》和《安信比较优势思活配置混合刑 根据(中华人民共和国证券投资基金法)和(安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金合同)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,包括国内依法发行和上市交易的股票(包括中小板,创业板及其他经中国证金 会核住上市的股票)股指期货、权证、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)、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

基金投资的其它金融工具,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,基金管理人在履行适当 程序后,可以将其纳人投资范围。 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6%的现金或者到期日 在一年以内的政府债券,前述现金不包括结营备付金、存出保证金。应收申购款等。 本基金投资于比较优势主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。 本基金投资于比较优势主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。 水益率×20%

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《企业会计准则一基本准则》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

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。

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

国证券投资基金建设交额均开发的工程。 能会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金信息披露内容与格式准则》 《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海报规则》第3号《 14程本社》等2020年12月21日

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

489.7718.482.44金五寸986至13.74金五寸986至13.74金五寸986至13.482.643。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6 月30日的财务状况以及2018年3月21日(基金合同生效日)至2018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

044.1 云口 中原 本基金会计中度采用公历年度。本期财务报表的实际编制期间系2018年3月 21日(基金合同生效日)至2018年6月30日止。 6.442 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。 6.4.4.3 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,可及在目形从华盛业的立藏双广(最负顺),开形成类记书证的立藏负顺 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:交易性金融资产和应收款项。

本基金目前持有的交易性金融资产主要包括股票和债券等投资。本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、结算备付 金、存出保证金和各类应收款项等。

符目所证並和哲學起收款學等。 (2)金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。 本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债,主要包括各类应付款项

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债,按照取 得时的公允价值作为初始确认金额。划分为交易性金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益,应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金

在55日至 交易性金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得 的利息或现金股利,应当确认为当即收益。每日,本基金将交易性金融资产或金融 负借的公允价度空动计人当期损益;应收或项及其他金融负债采用实际利率法,按 照摊余成本进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金

用收取收益機成了一%並加速的目的形象的差別,以收益機以厂已收移,且中行五 繼強产转移的發生确认条件的,金融资产等終生确认。 当金融负值的现时义务全部政部分已经解除的。该金融负债或其一部分将终 上确认,处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始人账金额之间的差额应 确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止 确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认 该金融资产,本基金股没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和 报酬的,分别下列情况处理,放弃了对该金融资产学制的,终且确认该金融资产等 确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融 资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.5 宏融政广州运融以原访伯祖原则 公允价值,是指市场参与者在计量已发生的有序交易中,出售一项资产所能收 到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假 定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场协进行。不存在 主要市场价、本基金假定交易存相关资产或负债的原有利市场进行。主要市场 (或最有利市场)是本基金在计量已能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者

在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。 在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整 体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次;第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层

次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。 每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资 产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换

一和以近近月通州市区、欧姆及定在任公元团组开型及4人产的发生存4%。 本基金持有的股票和债券等投资按如下原则确定公价值非进行估值: ()存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上表码服的报价等少余价值。估值日无银价且最近交易日日未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表 明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定 公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,成以相同资产政负债的公允价值,与上述投资品种相同,但具有不同特征的,成以相同资产政负债的公价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出自或使用的限制等。如果该积制是转对资产持有者的,那么在价值技术中不边辖该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价 (2)不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用

数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应 级级科技经验间部级大师的目面这个的地位人们加拿大的加强人不同的面对的现在分词, 他先他用可观察输入值。只有在无法决定特别关键产业负债可观察输入值。 约或自行的情况下,才使用不可观察输入值。 (3)如有确值证据表明按 上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的价格估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销 0.44.6 金融實产州亞德亞貝亞丹馬利 当本基金用的清壓下列条件时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在 资产负债表内列示:具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执 行的;计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金 实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量 (1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额人账。若提前支

取定期存款,按协议规定的利率及持有明重新计算存款利息收入,并根据提前支收 所实际收到的利息收入与账而已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息 收入减减,存款利息收入以产额列示; (2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除 自债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利塞计算的金额,扣除应由 主支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期

内逐日计是 (4)买人返售金融资产收入,按买人返售金融资产的成本及实际利率(当实际 利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提; (5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的 差额人账; (7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与

其成本的差额人账; (8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基è持有的以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允 价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失; (10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金

6.4.4.10 费用的确认和计量 本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定

中華並即18世代版剛州北自教等任政州越區期间政權並召回城和大公召约此 的费率和计算方法逐日确认。 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与 直线法差异较小的则按直线法计算

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6-44.11 基础的收益对配效限。 每一基金价额享有同等价配权;本基金收益分配方式分两种;现金分红与红利 再投资、投资者可选择现金红利应将现金红利拉分红路权目的基金份额净值目动 转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金赋认的收益分配方式是现金分 红;若期末未分配利润中的未实现部分为正数。包括基金经营活动产生的未实现税 盆以及基金份额交易产生的未实现邓化金等。则如未可任分配利润的金额为期末 未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供 分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣

7加利用引速减少到水水7加加间。18亿2%空间207年18.水头%1807/1719. 告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。 64.4.12 其他重要的会计政策和会计估计 本基金本报告期无需要原则的身体重要会计政策和会计估计事项。 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。 6.4.5.3 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。

6.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

证券(股票)交易中化6000举为1%。由出让万藏码。 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。 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及增试点金融进有关政策的通知》。财税2016[46号文(关于进一步明确全面推开营及增试点金融进有关政策的通知》。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(房地下开发、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

展目「加速島」建作中化土印印庫(国際地位) 75、以原目「加島生人が自唐で55 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管值税应 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; 64.64 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)

签金从上间公司则配款得的股总组和前得,特及的股配工厂户的、其股股财制,在1个月, 的,其股股财利所得全额计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个 暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 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 管理人、注册登记机构、基金销售机构

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

2018年半年度报告摘要

(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



6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

				3万48十一万・ノくレク
关联方名称	201	18年3月21日 (基金	本期 合同生效日)至2	2018年6月30日
大联万石桥	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例(%)	期末应付佣金 余額	占期末应付佣金总额的比 例(%)
安信证券	2,703,313.85	78.22	1,826,510.58	70.81
注:上述佣金按市	场佣金率计算	算,以扣除由	中国证券登	记结算有限责任公
正管费、经手费和由	券商承担的i	正券结算风险	金基金后的?	争额列示。该类佣金
88名范围还有任佣4	HORD THE	た其今担併さ	内证券担答	瓜农成用和市场信

6482 羊联方拐翻



在:金宝百年过程日刊证,12万之门。本金宝1.150%年费率计提。管理费的计算方法如下: 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

本期 18年3月21日 (基金合同生效日)至2018年6 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基金资产净值

单位:人民币元

0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.25%÷当年天数 H 为每日应计提的基金托管费

日 / 沙坡日並出 她们继近社正自改 E 为前一日的基金资产增加。 6.48.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。 6.48.4 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 0-40-4.1 依日朝內據並告達人及由由申取並以及平確並的同的 本报告明基金管理人未运用固有资金投资本基金。 6-48-4.2 报告明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未持有本基金份额。 6-485 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称 注: 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管, 按约定利塞计息

本基立本环石则水红本印刷内参与大吸刀本印证券。 64.87 其他关联交易事项的说明 本基金本期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

6.48.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券

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	(単 位: 股)	期末 成本总額	期末估值 总额	备注	
60310 5	芯能 科技	2018年 06月29 日	2018 年07 月09 日	新股未 上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-	
60369	江苏新能	2018年 06月25 日	2018 年07 月03 日	新股未 上市	9,00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-	
60370 6	东方 环宇	2018年 06月29 日	2018 年07 月09 日	新股未 上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-	
6.4.9.2	期 対	k持有I	的暂时	停牌等	流通	受限股!	票	6	b额单位:	人足	而示

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 \$款余额,无抵押债券

780.47801,701.07401075。 64.93.2 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

€7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

证券款余额,无抵押债券。

			金额单位:人民
序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,759,109,047.93	89.56
	其中:股票	1,759,109,047.93	89.56
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	买人返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	198,930,971.86	10.13
8	其他各项资产	6,225,781.81	0.32

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(%)
Α	农、林、牧、渔业	10,725,263.64	0.58
В	采矿业	-	
C	制造业	806,694,214.67	41.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	71,559.85	0.00
Е	建筑业	251,736,185.38	12.90
F	批发和零售业	89,796,086.44	4.6
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务 业	98,408,270.22	5.00
J	金融业	31,096,958.66	1.60
K	房地产业	408,396,702.00	20.98
L	租赁和商务服务业	_	
М	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.0
N	水利、环境和公共设施管理业	62,104,415.57	3.19
0	居民服务、修理和其他服务业	_	
Р	教育	-	
Q	卫生和社会工作	-	
R	文化、体育和娱乐业	-	

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

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细 应阅读登载干安信 其全管理有限责任公司网站的坐在度报告正文 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

股票代码 股票名称 本期累计买人金额 135,745,44 123,850,16 122,958,70 98,134,50 88,155,58

54,485,76

47,406,467

主:本项的"累计买人金额"按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的胎

·木顶的"要计壳虫全频"按壳虫成态全频(成态单价乘以成态数量)情别 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:"买人股票成本(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

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

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

本基金投资股指期货将以对冲投资组合的系统性风险为目的, 优先选择流动 性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置,在系统性风险积累 较大时,通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险,力争获取个股的超额收益和对

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。

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

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 由于四舍五人原因,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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 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

§ 9 开放式基金份额变动 单位:份

€ 10 重大事件掲示 10.1 基金份额持有人大会决议

0.2 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 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

0.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

0.6 管理人、托管人及其高级管理人员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

10.4 基金投资策略的改变

金额单位:人民币元 5当期佣金 总量的比例 佣金 成交金額

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

	债券交	债券交易 债		さ易	权证交易	
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金額	占当期 证 成交总 的比例
安信证券	-	-	6,559,900,000.00	100.00%	-	
安信证券	-	-	6,559,900,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

安信基金管理有限责任公司