安信鑫安得利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:宁波银行股份有限公司
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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8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	安信鑫安得利混合	
基金主代码	001399	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月5日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	547,931,431.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信鑫安得利混合A	安信鑫安得利混合C
下属分级基金的交易代码	001399	001400
报告期末下属分级基金的份额总额	24,516,806.53份	523,414,624.66份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提,结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘,动态灵活调整投资策略,力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险,通过多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。资产配置上,考虑经济环境、政策取向、资金供求状况和流动性因素,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整;固定收益投资方面,灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略;股票投资上,坚持价值投资理念,重点发掘出价值被市场低估的股票;此外,本基金还辅助性采用衍生品投资策略、风险管理策略和资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中国人民银行公布的金融机构1年期人民币定期存款基准利率+3.00%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	王海燕
	联系电话	0755-82509999	0574-89103171
	电子邮箱	service@essencefund.com	wanghaiyan@nbcb.cn
客户服务电话		4008-088-088	95574
传真		0755-82799292	0574-89103213

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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)	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
	安信鑫安得利混合A	安信鑫安得利混合C
本期已实现收益	1,041,702.91	17,685,520.50
本期利润	451,835.65	6,320,979.66
加权平均基金份额本期利润	0.0145	0.0115
本期基金份额净值增长率	0.95%	0.84%
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	0.1844	0.1701
期末基金资产净值	29,331,001.50	618,672,235.13
期末基金份额净值	1.1964	1.1820

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认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

安信鑫安得利混合A

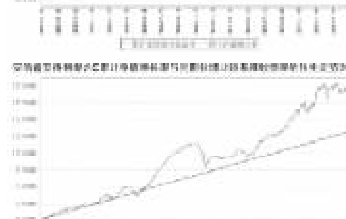
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.85%	0.26%	0.37%	0.01%	-1.22%	0.25%
过去三个月	-0.34%	0.24%	1.12%	0.01%	-1.46%	0.23%
过去六个月	0.95%	0.24%	2.23%	0.01%	-1.28%	0.23%
过去一年	5.79%	0.20%	4.50%	0.01%	1.29%	0.19%
过去三年	18.93%	0.14%	13.63%	0.01%	5.30%	0.13%
自基金合同生效起至今	19.64%	0.14%	14.00%	0.01%	5.64%	0.13%

安信鑫安得利混合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	-0.86%	0.26%	0.37%	0.01%	-1.23%	0.25%
过去三个月	-0.39%	0.24%	1.12%	0.01%	-1.51%	0.23%
过去六个月	0.84%	0.24%	2.23%	0.01%	-1.39%	0.23%
过去一年	5.57%	0.20%	4.50%	0.01%	1.07%	0.19%
过去三年	17.50%	0.14%	13.63%	0.01%	3.87%	0.13%
自基金合同生效起至今	18.20%	0.14%	14.00%	0.01%	4.20%	0.13%

注:根据《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同生效日为2015年6月5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	任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期	证券从业年限	说明
庄园	本基金的基金经理	2015年6月5日	–	14	庄园女士,经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员,工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理,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)、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、安信新优选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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、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、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
张明	本基金的基金经理	2017年7月3日	–	7	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任研究部研究员,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。
李巍	本基金的基金经理助理	2016年10月25日	–	5	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

2018年2季度实际GDP同比增速从1季度的6.8%下降至6.7%, 宏观数据显示,无论是在投资还是消费方面,内需增速均有所放缓。央行推出了一系列货币政策,以实现稳增长,防风险的权衡。定向降准由普惠金融变为置换中期借贷便利,直至债转股,由去杠杆变为稳杠杆;收回棚户区改审批权限,避免货币性安置使得PSL资金导致房地产价格大幅变动;不跟随美国加息,保持货币政策独立性。

利率债方面, 截止6月底, 上半年10年期国债收益率从3.90%震荡下行至3.47%,跌幅约40bp,10年期国开债收益率则从4.87%回落至4.25%,跌幅约60bp;信用债方面,主要受信用违约风险影响,相对于利率债而言信用债交投总体较为清淡,不同评级品种估值收益率曲线分化明显,AAA企业债下行幅度明显大于AA企业债。

本基金上半年债券部分对持仓结构进行了一些调整, 在资金面比较宽松的大背景下维持了杠杆,并适度地拉长了久期。权益方面我们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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金A类基金份额净值为1.1964元, 本报告期基金份额净值增长率为0.95%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.1820元,本报告期基金份额净值增长率为0.84%;同期业绩比较基准收益率为2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中美贸易冲突、经济数据不及预期等多重外部冲击下,二季度市场流动性出现了脉冲式的改善,虽然当前债市情绪回暖,但我们认为短期在乐观当中还应保持警惕。一方面,流动性缓和的程度还取决于风险事件的进一步演化。另一方面,第三季度外汇占款增长可能出现放缓,市场将更为依赖央行主动操作对流动性的补给。

权益方面,市场经历了6月份的大跌,在下半年可能会有一轮反弹,但预计短期仍是弱势震荡的格局。长期来看,站在3年的维度,现在是一个很好的投资时点,另外大小盘的估值水平可能会长期向港股靠拢,即大盘估值抬升,小盘股估值折价。

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, 本基金本报告期末进行利润分配。

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,本托管人在安信鑫安得利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:安信鑫安得利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	13,015,574.69	21,513,119.24
结算备付金	462,344.84	1,358,811.02
存出保证金	47,476.22	56,067.78
交易性金融资产	632,541,189.92	701,689,026.16
其中:股票投资	122,550,880.52	125,309,927.38
基金投资	–	–
债券投资	509,990,309.40	546,289,937.14
资产支持证券投资	–	30,089,161.64
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	5,000,000.00	–
应收证券清算款	–	262,189.49
应收利息	9,979,303.80	7,894,135.81
应收股利	–	–
应收申购款	1,806.71	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	661,047,696.18	732,773,349.50
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	5,000,000.00	–
应付证券清算款	7,131,826.92	–
应付赎回款	91,164.75	–
应付管理人报酬	429,552.81	495,821.85
应付托管费	53,694.13	61,977.73
应付销售服务费	102,412.64	116,917.24
应付交易费用	23,944.18	37,898.09
应交税费	21,591.05	–
应付利息	1,835.62	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	188,437.45	280,000.00
负债合计	13,044,459.55	992,614.91
所有者权益:		
实收基金	547,931,431.19	623,950,369.86
未分配利润	100,071,805.44	107,830,364.73
所有者权益合计	648,003,236.63	731,780,734.59
负债和所有者权益总计	661,047,696.18	732,773,349.50

6.2 利润表

会计主体:安信鑫安得利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1月1日 至 2017年6月30日
一、收入	10,889,074.16	34,547,029.80
1.利息收入	12,569,540.07	19,737,110.09
其中:存款利息收入	103,292.31	274,341.93
债券利息收入	11,345,228.64	19,184,052.86
资产支持证券利息收入	374,634.86	176,745.20
买入返售金融资产收入	746,384.26	101,970.10
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	10,271,583.42	4,290,873.79
其中:股票投资收益	13,937,650.67	6,107,292.56
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-5,018,816.46	-3,552,268.87
资产支持证券投资收益	-89,161.64	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	1,441,910.85	1,735,850.10
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-11,954,408.10	10,511,670.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,358.77	7,375.16
减:二、费用	4,116,258.85	9,098,148.96
1. 管理人报酬	2,734,377.21	3,628,237.23
2. 托管费	341,797.21	453,529.65
3. 销售服务费	646,221.85	845,074.23
4. 交易费用	130,895.61	281,815.41
5. 利息支出	37,430.28	3,672,538.16
其中:卖出回购金融资产支出	37,430.28	3,672,538.16
6. 税金及附加	18,499.40	–
7. 其他费用	207,037.29	216,954.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,772,815.31	25,448,880.84
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,772,815.31	25,448,880.84

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信鑫安得利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)	623,950,369.86	107,830,364.73	731,780,734.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	6,772,815.31	6,772,815.31
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)	-76,018,938.67	-14,531,374.60	-90,550,313.27
其中:1.基金申购款	52,963,066.28	9,882,338.78	62,845,405.06
2.基金赎回款	-128,982,004.95	-24,413,713.38	-153,395,718.33
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)	547,931,431.19	100,071,805.44	648,003,236.63
项目	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017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)	895,644,174.22	79,659,038.76	975,303,212.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	25,448,880.84	25,448,880.84
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)	-130,875,179.75	-13,138,110.36	-144,013,290.11
其中:1.基金申购款	1,285,990.30	132,258.09	1,418,248.39
2.基金赎回款	-132,161,170.05	-13,270,368.45	-145,431,538.50
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)	764,768,994.47	91,969,809.24	856,738,803.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘入领	范瑛	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信鑫安得利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5月18日下发的证监许可[2015]924 号文"关于准予安信鑫安得利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《安信鑫安得利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6月1日至2015年6月2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_H64号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,495,390,544.02元。经向中国证监会备案,《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月5日正式生效。截至2015年6月4日止,安信鑫安得利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2,495,390,544.02元,折合2,495,390,544.02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为人民币72,200.06元,折合72,200.06份基金份额。其中鑫安得利A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565,446,845.02元,折合565,446,845.02 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为人民币16,443.13元, 折合16,443.13 份基金份额;鑫安得利C已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币1,929,943,699.00元,折合1,929,943,699.00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为人民币55,756.93元,折合21,240.09份基金份额。以上收到的实收基金共计人民2,495,462,744.08元,折合2,495,462,744.08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,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金投资范围包括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、国债期货、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)。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。本基金的投资组合比例为: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和国债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中国人民银行公布的金融机构1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》 及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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1月1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 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》、财政(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
宁波银行股份有限公司(以下简称"宁波银行")	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注: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

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。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,734,377.21	3,628,237.23
其中:支付销售机构的客户维护费	48,748.40	90,105.66

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.80%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

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1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	341,797.21	453,529.65

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提,托管费的计算方法如下:

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

6.4.8.2.3 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 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 安信鑫安得利混合A	安信鑫安得利混合C	合计
宁波银行	–	1,540.67	1,540.67
安信基金	–	643,713.10	643,713.10
安信证券	–	4.87	4.87
合计	–	645,258.64	645,258.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 安信鑫安得利混合A	安信鑫安得利混合C	合计
宁波银行	–	1,978.17	1,978.17
安信基金	–	830,184.55	830,184.55
安信证券	–	37.53	37.53
合计	–	832,200.25	832,200.25

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人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本期末及上年度末未持有本基金份额。

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
宁波银行	13,015,574.69	95,875.95	16,345,583.65	102,314.41

注:本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管,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

6.4.12.1 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
603105	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	–
603693	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	–
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	–

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	2018-04-03	重大事项	10.43	–	–	150,000.00	1,613,751.00	1,564,500.00	–

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2018年6月30日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额5,000,000.00元,于2018年7月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

§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	122,550,880.52	18.54
	其中:股票	122,550,880.52	18.54
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	509,990,309.40	77.15
	其中:债券	509,990,309.40	77.15
	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	5,000,000.00	0.76
	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	13,477,919.53	2.04
8	其他各项资产	10,028,586.73	1.52
9	合计	661,047,696.18	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	1,333,800.00	0.21
B	采矿业	5,735,600.00	0.89
C	制造业	93,083,707.49	14.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	1,528,800.00	0.24
F	批发和零售业	6,771,057.03	1.04
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	–	–
J	金融业	9,374,600.00	1.45
K	房地产业	3,172,000.00	0.49
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	616.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	1,397,913.51	0.22
S	综合	–	–
	合计	122,550,880.52	18.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,500	8,411,790.00	1.30
2	000651	格力电器	172,900	8,152,235.00	1.26
3	600352	浙江龙盛	550,000	6,572,500.00	1.01
4	000786	北新建材	350,000	6,485,500.00	1.00
5	002563	森马服饰	396,200	5,665,660.00	0.87
6	000910	大亚圣象	290,000	4,901,000.00	0.76
7	002202	金风科技	373,590	4,722,177.60	0.73
8	600104	上汽集团	130,000	4,548,700.00	0.70
9	600741	华域汽车	190,000	4,506,800.00	0.70
10	601088	中国神华	190,000	3,788,600.00	0.58

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	4,201,213.47	0.57
2	600048	保利地产	3,496,825.00	0.48
3	601398	工商银行	2,897,000.00	0.40
4	002367	康力电梯	2,881,184.86	0.39
5	600741	华域汽车	2,599,382.00	0.36
6	601288	农业银行	2,442,000.00	0.33
7	000786	北新建材	2,257,859.00	0.31
8	000651	格力电器	2,154,940.00	0.29
9	000726	鲁 泰A	2,086,241.46	0.29
10	601668	中国建筑	1,989,000.00	0.27
11	600335	国机汽车	1,613,751.00	0.22
12	002508	老板电器	1,403,244.00	0.19
13	600757	长江传媒	1,362,767.17	0.19
14	300296	利亚德	1,346,972.00	0.18
15	000501	鄂武商A	1,301,663.38	0.18
16	000910	大亚圣象	1,254,521.60	0.17
17	000546	金圆股份	1,181,093.00	0.16
18	600519	贵州茅台	1,052,630.00	0.14
19	002677	浙江美大	992,280.00	0.14
20	601939	建设银行	982,200.00	0.13

注:本项的"累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	5,378,200.00	0.73
2	000858	五 粮 液	4,867,887.46	0.67
3	601006	大秦铁路	3,708,142.00	0.51
4	000786	北新建材	2,297,895.00	0.31
5	600066	宇通客车	2,296,041.00	0.31
6	002027	分众传媒	2,208,700.00	0.30
7	300568	星源材质	2,149,705.00	0.29
8	600900	长江电力	2,086,900.00	0.29
9	601318	中国平安	1,613,366.00	0.22
10	600028	中国石化	1,430,000.00	0.20
11	600019	宝钢股份	1,306,015.17	0.18
12	603579	荣泰健康	1,164,391.00	0.16
13	000488	晨鸣纸业	1,155,301.25	0.16
14	300296	利亚德	1,080,468.00	0.15
15	600036	招商银行	1,038,016.00	0.14
16	002677	浙江美大	995,500.00	0.14
17	000546	金圆股份	936,204.00	0.13
18	002508	老板电器	817,660.00	0.11
19	601633	长城汽车	816,566.00	0.11
20	601939	建设银行	778,000.00	0.11

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	51,723,899.00
卖出股票收入(成交)总额	49,110,985.84

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	67,539,500.00	10.42
	其中:政策性金融债	67,539,500.00	10.42
4	企业债券	117,433,809.40	18.12
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	60,136,000.00	9.28
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	264,881,000.00	40.88
9	合计	509,990,309.40	78.70

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	111818158	18华夏银行CD158	500,000	49,520,000.00	7.64	
2	111811076	18平安银行CD076	500,000	48,915,000.00	7.55	
2	111815100	18民生银行CD100	500,000	48,915,000.00	7.55	
3	101564058	15哈供热MTN001	400,000	40,100,000.00	6.19	
4	122462	15正奇债	300,000	29,898,000.00	4.61	
5	112367	16华西01	299,990	29,717,009.40	4.59	

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

本基金在进行股指期货投资时,以风险对冲、套期保值为主要目的,将选择流动性好、交易活跃的期货合约,结合股指期货的估值定价模型,与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,实现基金资产增值保值。

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

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。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,力求实现资产的长期稳定增值。

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除18浦发银行CD165 (证券代码:111809165 CY,对应上市公司为浦发银行,股票代码:600000)、18兴业银行CD174 (证券代码:111810174 CY,对应上市公司为兴业银行,股票代码:601166)、18兴业银行CD206(证券代码:111810206 CY,对应上市公司为兴业银行,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。

上海浦东发展银行股份有限公司成都分行于2018年1月19日收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称"银监会四川监管局")行政处罚决定书(川银监罚字【2018】2号)。因内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为于2018年1月18日被银监会四川监管局给予行政处罚。

兴业银行股份有限公司于2018年4月19日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)1号),因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,内控管理严重违反审慎经营规则,非真实转让信贷资产,个人理财资金违规投资等十二项违规行为,被罚款5870万元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,476.22
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	9,979,303.80
5	应收申购款	1,806.71
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,028,586.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例(%)	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例(%)
安信鑫安得利混合A	517	47,421.29	–	–	24,516,806.53	100.00
安信鑫安得利混合C	95	5,509,627.63	516,372,012.79	98.65	7,042,611.87	1.35
合计	589	930,274.08	516,372,012.79	94.24	31,559,418.40	5.76

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	安信鑫安得利混合A	–	–
	安信鑫安得利混合C	–	–
	合计	–	–

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	份额级别	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	安信鑫安得利混合A	0
	安信鑫安得利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信鑫安得利混合A	0
	安信鑫安得利混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信鑫安得利混合A	安信鑫安得利混合C
基金合同生效日(2015年6月5日)基金份额总额	565,463,288.15	1,929,999,455.93
本报告期期初基金份额总额	34,530,986.28	589,419,383.58
本报告期基金总申购份额	1,942,598.29	51,020,467.99
减:本报告期基金总赎回份额	11,956,778.04	117,025,226.91
本报告期期末基金份额总额	24,516,806.53	523,414,624.66

§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

本基金本报告期内基金管理人、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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	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
申万宏源	2	65,986,792.32	67.16%	46,935.92	72.64%	–
中泰证券	2	32,264,862.88	32.84%	17,675.14	27.36%	新增

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	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
申万宏源	152,189,752.37	77.93%	609,513,000.00	83.43%	–	–
中泰证券	43,112,005.60	22.07%	121,065,000.00	16.57%	–	–

§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	20180101-20180630	481,196,462.91	–	60,870,000.00	420,326,462.91	76.71
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