

# 安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信鑫发优选混合
基金主代码	000433
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 31 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	39,842,143.34 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以风险管理为基础，通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略，力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上，结合政策因素、市场情绪与估值因素等，分析大类资产风险收益比，合理配置；在固定收益类的投资上，采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略，选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种；在股票投资上，秉承价值投资理念，灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略，把握市场定价偏差带来的投资机会；在衍生品投资上，合理利用权证等做套保或套利投资；在风险管理上，根据市场环境的变化，动态调整仓位和投资品种，并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	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	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	戴辉
	联系电话	0755-82509999	010-65169958
	电子邮箱	service@essencefund.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95508
传真		0755-82799292	010-65169555

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-10,036,051.16	4,316,327.61	18,700,267.77
本期利润	-12,128,597.86	6,276,249.55	-41,313,550.24
加权平均基金份额本期利润	-0.3029	0.1202	-0.3823
本期基金份额净值增长率	-23.34%	9.15%	-16.99%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末基金资产净值	38,616,497.30	47,166,667.26	77,157,269.31
期末基金份额净值	0.969	1.264	1.158

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

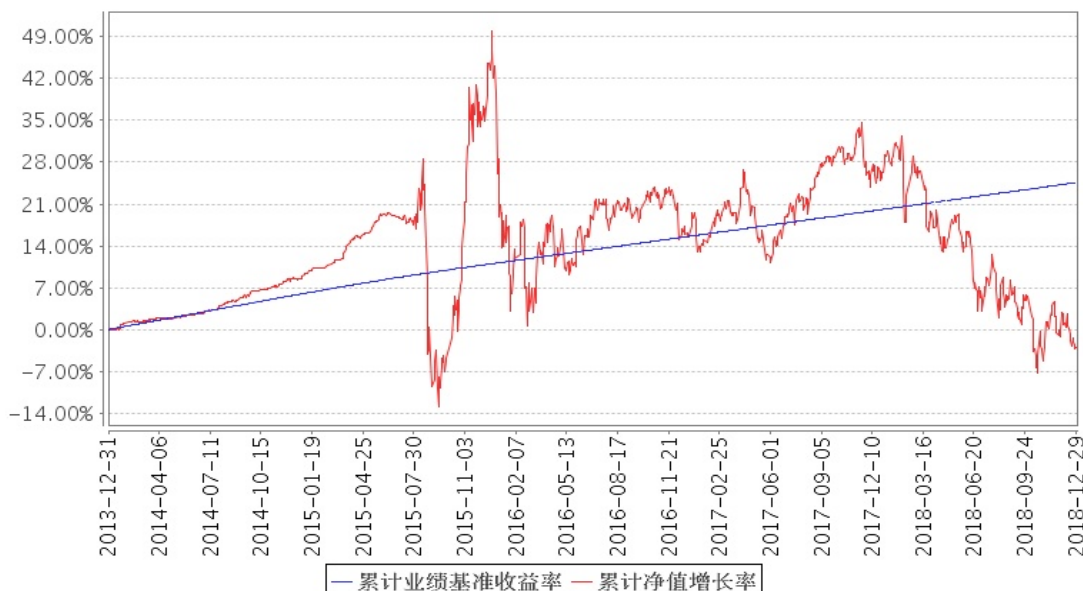
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	-8.15%	1.56%	1.13%	0.01%	-9.28%	1.55%
过去六个月	-9.61%	1.45%	2.27%	0.01%	-11.88%	1.44%
过去一年	-23.34%	1.36%	4.50%	0.01%	-27.84%	1.35%
过去三年	-30.54%	1.39%	13.52%	0.04%	-44.06%	1.35%
过去五年	-3.10%	1.32%	24.60%	0.03%	-27.70%	1.29%
自基金合同生效起至今	-3.10%	1.32%	24.62%	0.03%	-27.72%	1.29%

注：根据《安信鑫发优选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

安信鑫发优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

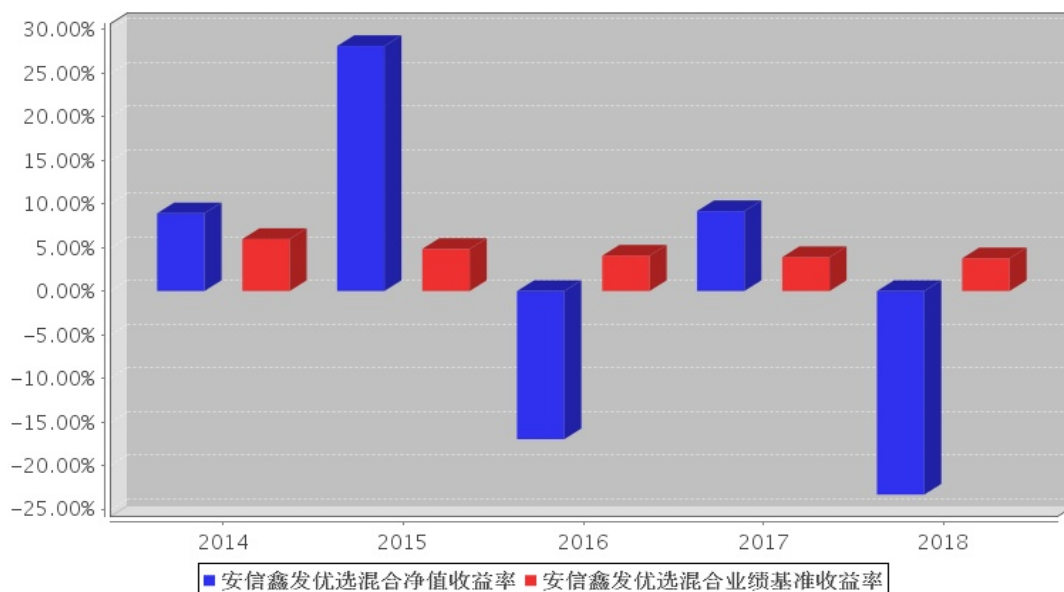


注：1、本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 31 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信鑫发优选混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 45 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 日至 2018 年 9 月 26 日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；从 2018 年 6 月 12 日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金；从 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；从 2018 年 9 月 3 日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金；从 2018 年 9 月 26 日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金；从 2018 年 11 月 29 日起管理安信中证 500 指数增强型证券投

资基金；从 2018 年 12 月 7 日起管理安信优享纯债债券型证券投资基金。

#### 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		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蓝雁书	本基金的基金经理	2013 年 12 月 31 日	-	12	蓝雁书先生，理学硕士。历任桂林理工大学（原桂林工学院）理学院教师，华西证券有限责任公司证券研究所研究员，安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信优势增长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的基金经理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015 年 7 月 10 日	-	8	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信鑫发优选灵活配置混



					合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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 年上半年，市场预期发生较大变化：房地产新开工面积增速大幅下降、资金来源情况变差，叠加销售增速持续下滑，市场对 2018 年房地产投资增速预期变得相对谨慎；中美贸易战骤然来袭，使出口面临失速风险；制造业投资回暖，不抵地产投资和基建投资向下压力；消费端，必选消费增长放缓叠加举债透支影响逐步显现，消费对经济支撑作用弱化。

2018 年下半年，国常会政策取向开始扭转，但海外市场的回落，加上国内股票价格下跌与质押盘违约的螺旋再次显现，投资者情绪极低，A 股调整幅度较大。考虑到内外经济下行趋势基本形成，国内政策托底传导至实体信用环境还未改观，企业盈利能力还可能受到需求和成本冲击，盈利增速下滑，A 股震荡下行。

期间，考虑到我们对 A 股持谨慎观点，本基金持仓自下而上以估值合理、具有一定竞争优势的具体个股为主，主要包括以基本面复苏趋势确定、估值合理的保险、电力和建筑等为主。在四季度末，考虑到 A 股估值水平已经回落至较低水平，市场风险偏好处于极低位置，且前期政策由“去杠杆”到“稳杠杆”转变，货币信用紧缩周期开始扭转，我们认为 A 股进入配置区间，我们加大了股票持仓头寸。

### 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 0.969 元，本报告期份额净值增长率为-23.34%，同期业绩比较基准增长率为 4.50%。

## 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 2019 年，我们对 A 股持相对乐观态度，核心原因是影响前期市场的主要矛盾正在发生逆转，“去杠杆”在向“稳增长”转变。

前期去杠杆对大家心里预期产生了冲击，市场预期悲观，经济增速下滑。7 月底国常会定调调整，从“去杠杆”转向“稳杠杆”，包括央行 TMLF 利率降低，前期扭曲中国经济社会的核心矛盾正在得到修正。这种修正使去杠杆节奏放缓，这些修补政策将对目前已经处于极低位置的风险偏好带来正贡献，也会对经济产生正面刺激。

对于贸易战，我们认为也不用过于担心。广阔的内需、依然丰富的劳动力资源、完善的制造业产业链配套以及技术积累，使得中国在新的全球化均衡过程中，依然具备竞争优势。

我们将重点关注重卡及工程机械、新能源汽车、电子与通信设备、医药与医疗设备等行业的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 1 月 31 日、2018 年 3 月 2 日至 2018 年 5 月 30 日、2018 年 6 月 8 日至 2018 年 8 月 28 日和 2018 年 9 月 5 日至 2018 年 12 月 31 日。

本报告期内本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

### § 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，广发银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告，投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	5,014,360.29	5,986,283.84
结算备付金	272,999.53	338,104.96
存出保证金	109,928.76	153,829.52
交易性金融资产	33,580,145.68	41,004,576.06
其中：股票投资	33,580,145.68	41,004,576.06
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	1,190.98	1,781.58
应收股利	-	-
应收申购款	2,997.27	5,318.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	38,981,622.51	47,489,894.67
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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	134,607.91	-
应付赎回款	6,920.33	49,174.34
应付管理人报酬	33,754.89	40,278.96
应付托管费	6,750.96	8,055.79
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	103,081.81	135,702.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,009.31	90,015.68
负债合计	365,125.21	323,227.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	39,842,143.34	37,307,305.45
未分配利润	-1,225,646.04	9,859,361.81
所有者权益合计	38,616,497.30	47,166,667.26
负债和所有者权益总计	38,981,622.51	47,489,894.67

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值人民币 0.969 元，基金份额总额 39,842,143.34 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信鑫发优选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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-10,424,024.06	8,661,658.06
1. 利息收入	52,804.80	60,933.48

其中：存款利息收入	52,804.80	59,362.03
债券利息收入	-	132.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,438.89
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-8,472,452.39	6,560,039.04
其中：股票投资收益	-9,118,914.35	5,738,105.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	18,926.40
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	646,461.96	803,007.35
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-2,092,546.70	1,959,921.94
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	88,170.23	80,763.60
减：二、费用	1,704,573.80	2,385,408.51
1. 管理人报酬	446,025.36	635,623.06
2. 托管费	89,205.03	127,124.65
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,002,143.41	1,485,260.80
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	167,200.00	137,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-12,128,597.86	6,276,249.55
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-12,128,597.86	6,276,249.55

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信鑫发优选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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	37,307,305.45	9,859,361.81	47,166,667.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,128,597.86	-12,128,597.86
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）	2,534,837.89	1,043,590.01	3,578,427.90
其中：1. 基金申购款	22,624,617.56	3,551,249.86	26,175,867.42
2. 基金赎回款	-20,089,779.67	-2,507,659.85	-22,597,439.52
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）	39,842,143.34	-1,225,646.04	38,616,497.30
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	66,601,337.78	10,555,931.53	77,157,269.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,276,249.55	6,276,249.55
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）	-29,294,032.33	-6,972,819.27	-36,266,851.60
其中：1. 基金申购款	6,587,784.71	1,356,771.25	7,944,555.96



2. 基金赎回款	-35,881,817.04	-8,329,590.52	-44,211,407.56
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）	37,307,305.45	9,859,361.81	47,166,667.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信鑫发优选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”）2013 年 11 月 4 日下发的证监许可[2013]1401 号文“关于核准安信鑫发优选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《安信鑫发优选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 2013 年 12 月 11 日至 2013 年 12 月 27 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(2013)验字 60962175\_H09 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 550,664,388.77 元。经向中国证监会备案，《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 31 日正式生效。截至 2013 年 12 月 31 日止，安信鑫发优选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 550,664,388.77 元，折合 550,664,388.77 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 129,002.71 元，折合 129,002.71 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 550,793,391.48 元，折合 550,793,391.48 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，基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权

证、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，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。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%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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：1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

#### 7.4.5 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
广发银行股份有限公司（以下简称“广发银行”）	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31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	345,116,674.02	44.99	875,348,705.19	77.76

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.3 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12月31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	245,479.24	44.44	29,638.97	28.75
关联方名称	上年度可比期间			
	2017年1月1日至2017年12月31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	622,630.92	77.28	70,888.26	52.24

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	446,025.36	635,623.06
其中：支付销售机构的客户维护费	179,815.26	310,398.40

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	89,205.03	127,124.65

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 12 月 31 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	6,428,473.35	-
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	6,428,473.35	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	16.13%	-

注：期间申购/买入总份额含转换入份额；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。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金除管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

**7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行	5,014,360.29	45,428.59	5,986,283.84	49,237.82

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按约定利率计息。

**7.4.8.6 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。

**7.4.8.7 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需要说明的其他关联交易事项。

**7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 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。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.10.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.10.2 其他事项

##### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 33,580,145.68 元，无划分为第二层级及第三层级余额（于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 41,004,576.06 元，无划分为第二层级及第三层级余额）。

##### 公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 38,616,497.30 元，已连续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

#### 7.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	33,580,145.68	86.14
	其中：股票	33,580,145.68	86.14
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	5,287,359.82	13.56
8	其他各项资产	114,117.01	0.29
9	合计	38,981,622.51	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	2,117,505.00	5.48
B	采矿业	646,958.00	1.68
C	制造业	17,399,779.26	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,693,246.00	6.97
E	建筑业	2,485,642.00	6.44
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	1,211,750.00	3.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,948,647.42	12.81
J	金融业	509,520.00	1.32
K	房地产业	1,567,098.00	4.06
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	33,580,145.68	86.96

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	600570	恒生电子	36,829	1,914,371.42	4.96
2	600383	金地集团	162,900	1,567,098.00	4.06
3	600741	华域汽车	75,235	1,384,324.00	3.58
4	002714	牧原股份	47,700	1,371,375.00	3.55
5	601186	中国铁建	125,600	1,365,272.00	3.54
6	300124	汇川技术	67,700	1,363,478.00	3.53
7	002352	顺丰控股	37,000	1,211,750.00	3.14

8	601985	中国核电	224,900	1,185,223.00	3.07
9	300760	迈瑞医疗	10,800	1,179,576.00	3.05
10	601766	中国中车	125,000	1,127,500.00	2.92

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 <http://www.essencefund.com> 上的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600570	恒生电子	7,645,617.24	16.21
2	002714	牧原股份	7,374,870.00	15.64
3	600383	金地集团	6,590,159.00	13.97
4	001979	招商蛇口	5,708,246.00	12.10
5	002110	三钢闽光	5,454,256.80	11.56
6	600581	八一钢铁	5,326,941.00	11.29
7	000932	华菱钢铁	4,787,326.00	10.15
8	600068	葛洲坝	4,762,884.00	10.10
9	600741	华域汽车	4,509,620.00	9.56
10	600019	宝钢股份	4,470,099.00	9.48
11	002643	万润股份	4,237,737.50	8.98
12	600486	扬农化工	4,171,044.40	8.84
13	600036	招商银行	4,150,948.00	8.80
14	002230	科大讯飞	4,090,499.23	8.67
15	600271	航天信息	4,078,273.75	8.65
16	601288	农业银行	4,001,087.00	8.48
17	002202	金风科技	3,979,578.00	8.44
18	000717	韶钢松山	3,854,332.88	8.17
19	600970	中材国际	3,828,859.06	8.12

20	601985	中国核电	3,759,000.00	7.97
21	002078	太阳纸业	3,732,630.87	7.91
22	000002	万科A	3,695,321.03	7.83
23	300383	光环新网	3,628,846.00	7.69
24	000513	丽珠集团	3,540,858.00	7.51
25	601111	中国国航	3,540,412.00	7.51
26	600029	南方航空	3,446,897.79	7.31
27	600346	恒力股份	3,438,862.46	7.29
28	000902	新洋丰	3,426,327.00	7.26
29	600030	中信证券	3,362,457.00	7.13
30	600487	亨通光电	3,139,861.53	6.66
31	002614	奥佳华	3,135,386.98	6.65
32	600048	保利地产	3,117,754.00	6.61
33	300602	飞荣达	3,114,304.90	6.60
34	601668	中国建筑	2,994,548.00	6.35
35	603579	荣泰健康	2,758,759.00	5.85
36	002439	启明星辰	2,734,904.00	5.80
37	601601	中国太保	2,733,324.00	5.80
38	601318	中国平安	2,724,637.00	5.78
39	600801	华新水泥	2,694,781.33	5.71
40	002281	光迅科技	2,658,296.00	5.64
41	600782	新钢股份	2,643,438.00	5.60
42	603686	龙马环卫	2,608,169.00	5.53
43	600056	中国医药	2,607,697.00	5.53
44	600309	万华化学	2,596,766.00	5.51
45	000786	北新建材	2,581,027.00	5.47
46	300124	汇川技术	2,569,115.72	5.45
47	601939	建设银行	2,530,127.00	5.36

48	600027	华电国际	2,509,519.00	5.32
49	601186	中国铁建	2,481,636.00	5.26
50	601398	工商银行	2,443,172.00	5.18
51	000546	金圆股份	2,371,770.00	5.03
52	600016	民生银行	2,362,367.00	5.01
53	600282	南钢股份	2,359,035.00	5.00
54	000703	恒逸石化	2,336,443.00	4.95
55	000895	双汇发展	2,311,795.00	4.90
56	601800	中国交建	2,288,654.00	4.85
57	300498	温氏股份	2,265,540.00	4.80
58	000776	广发证券	2,183,561.00	4.63
59	300021	大禹节水	2,158,725.00	4.58
60	601233	桐昆股份	2,119,233.00	4.49
61	002123	梦网集团	2,111,970.00	4.48
62	000063	中兴通讯	2,076,533.00	4.40
63	002258	利尔化学	2,070,965.00	4.39
64	603019	中科曙光	2,058,990.00	4.37
65	600585	海螺水泥	2,034,672.00	4.31
66	002746	仙坛股份	2,015,379.20	4.27
67	002635	安洁科技	1,999,467.00	4.24
68	000488	晨鸣纸业	1,987,758.00	4.21
69	002624	完美世界	1,935,464.00	4.10
70	300316	晶盛机电	1,914,633.00	4.06
71	002709	天赐材料	1,883,971.04	3.99
72	002299	圣农发展	1,873,730.00	3.97
73	600201	生物股份	1,849,652.00	3.92
74	002458	益生股份	1,849,441.00	3.92
75	300203	聚光科技	1,840,150.00	3.90

76	000921	海信家电	1,838,732.00	3.90
77	002352	顺丰控股	1,834,219.00	3.89
78	600612	老凤祥	1,807,156.00	3.83
79	000661	长春高新	1,746,319.00	3.70
80	002142	宁波银行	1,743,494.00	3.70
81	300009	安科生物	1,691,637.59	3.59
82	000338	潍柴动力	1,689,944.00	3.58
83	600176	中国巨石	1,681,222.00	3.56
84	002102	ST 冠福	1,670,894.00	3.54
85	601952	苏垦农发	1,658,518.00	3.52
86	300422	博世科	1,653,397.00	3.51
87	002234	民和股份	1,611,489.00	3.42
88	601688	华泰证券	1,606,814.79	3.41
89	000001	平安银行	1,606,558.00	3.41
90	002531	天顺风能	1,605,616.00	3.40
91	300633	开立医疗	1,591,989.00	3.38
92	601088	中国神华	1,589,509.00	3.37
93	002475	立讯精密	1,583,314.25	3.36
94	002534	杭锅股份	1,565,762.00	3.32
95	601003	柳钢股份	1,551,760.40	3.29
96	002555	三七互娱	1,544,353.00	3.27
97	002027	分众传媒	1,501,990.00	3.18
98	601009	南京银行	1,499,586.00	3.18
99	600837	海通证券	1,495,961.00	3.17
100	000887	中鼎股份	1,486,458.00	3.15
101	300558	贝达药业	1,483,389.00	3.14
102	600498	烽火通信	1,478,289.20	3.13
103	600483	福能股份	1,466,886.00	3.11

104	002008	大族激光	1,447,875.00	3.07
105	002080	中材科技	1,434,644.00	3.04
106	600845	宝信软件	1,418,983.00	3.01
107	601699	潞安环能	1,417,831.00	3.01
108	600011	华能国际	1,392,097.00	2.95
109	603881	数据港	1,382,727.00	2.93
110	600522	中天科技	1,362,078.00	2.89
111	600690	青岛海尔	1,358,462.00	2.88
112	000498	山东路桥	1,356,820.77	2.88
113	300251	光线传媒	1,334,757.00	2.83
114	300059	东方财富	1,321,466.32	2.80
115	300760	迈瑞医疗	1,316,446.40	2.79
116	002050	三花智控	1,305,403.51	2.77
117	002341	新纶科技	1,301,635.00	2.76
118	600323	瀚蓝环境	1,296,168.00	2.75
119	300568	星源材质	1,204,887.00	2.55
120	002482	广田集团	1,199,541.00	2.54
121	002013	中航机电	1,198,883.50	2.54
122	300628	亿联网络	1,191,094.00	2.53
123	601336	新华保险	1,188,680.00	2.52
124	600039	四川路桥	1,182,444.00	2.51
125	600115	东方航空	1,181,400.00	2.50
126	603365	水星家纺	1,180,222.00	2.50
127	600340	华夏幸福	1,176,784.00	2.49
128	603658	安图生物	1,155,760.00	2.45
129	002355	兴民智通	1,149,429.00	2.44
130	603601	再升科技	1,115,631.00	2.37
131	601766	中国中车	1,108,103.00	2.35

132	601117	中国化学	1,107,856.00	2.35
133	002081	金螳螂	1,078,342.00	2.29
134	600740	山西焦化	1,067,389.00	2.26
135	600426	华鲁恒升	1,044,980.00	2.22
136	300045	华力创通	1,022,655.00	2.17
137	002713	东易日盛	1,017,611.00	2.16
138	601899	紫金矿业	988,707.00	2.10
139	002034	旺能环境	983,767.80	2.09
140	002001	新和成	983,403.00	2.08
141	000100	TCL 集团	971,602.00	2.06
142	002332	仙琚制药	968,003.50	2.05
143	000830	鲁西化工	967,774.00	2.05
144	000938	紫光股份	963,939.00	2.04
145	002430	杭氧股份	956,047.00	2.03

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。

#### 8.4.2 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	002714	牧原股份	6,380,935.00	13.53
2	000513	丽珠集团	6,140,372.73	13.02
3	001979	招商蛇口	5,730,364.71	12.15
4	000932	华菱钢铁	5,714,582.94	12.12
5	600570	恒生电子	5,676,501.00	12.03
6	600581	八一钢铁	5,543,859.73	11.75
7	600036	招商银行	4,936,514.42	10.47
8	600487	亨通光电	4,910,983.82	10.41
9	600048	保利地产	4,853,713.86	10.29



10	600068	葛洲坝	4,728,694.69	10.03
11	002110	三钢闽光	4,641,622.42	9.84
12	600383	金地集团	4,632,914.00	9.82
13	600019	宝钢股份	4,483,636.07	9.51
14	000546	金圆股份	4,328,951.76	9.18
15	601398	工商银行	4,322,896.00	9.17
16	002643	万润股份	4,130,011.45	8.76
17	600271	航天信息	4,064,701.00	8.62
18	601288	农业银行	3,853,453.00	8.17
19	002202	金风科技	3,821,816.00	8.10
20	000002	万科A	3,631,209.00	7.70
21	002534	杭锅股份	3,627,030.28	7.69
22	601318	中国平安	3,617,041.00	7.67
23	000717	韶钢松山	3,613,395.00	7.66
24	600970	中材国际	3,610,821.00	7.66
25	600030	中信证券	3,496,968.00	7.41
26	300383	光环新网	3,486,849.11	7.39
27	600486	扬农化工	3,383,159.00	7.17
28	600346	恒力股份	3,346,916.00	7.10
29	000902	新洋丰	3,327,371.00	7.05
30	601601	中国太保	3,304,304.25	7.01
31	601111	中国国航	3,203,672.60	6.79
32	600029	南方航空	3,189,306.00	6.76
33	600690	青岛海尔	3,059,137.04	6.49
34	002614	奥佳华	3,035,616.86	6.44
35	601668	中国建筑	3,004,061.00	6.37
36	002078	太阳纸业	2,964,488.00	6.29
37	300602	飞荣达	2,959,629.30	6.27

38	002444	巨星科技	2,880,829.19	6.11
39	002281	光迅科技	2,759,772.20	5.85
40	603686	龙马环卫	2,743,383.58	5.82
41	600801	华新水泥	2,692,135.00	5.71
42	600522	中天科技	2,622,747.70	5.56
43	002635	安洁科技	2,618,334.30	5.55
44	601155	新城控股	2,570,683.42	5.45
45	002230	科大讯飞	2,568,732.00	5.45
46	600741	华域汽车	2,458,008.75	5.21
47	603579	荣泰健康	2,431,406.82	5.15
48	601939	建设银行	2,430,455.00	5.15
49	601985	中国核电	2,354,151.00	4.99
50	600282	南钢股份	2,334,629.00	4.95
51	000001	平安银行	2,297,470.30	4.87
52	601233	桐昆股份	2,282,523.88	4.84
53	000776	广发证券	2,230,727.00	4.73
54	600782	新钢股份	2,213,501.00	4.69
55	600016	民生银行	2,188,811.36	4.64
56	600056	中国医药	2,157,513.00	4.57
57	000895	双汇发展	2,147,680.86	4.55
58	600309	万华化学	2,128,828.52	4.51
59	603019	中科曙光	2,082,775.54	4.42
60	000786	北新建材	2,031,606.54	4.31
61	000488	晨鸣纸业	2,004,633.30	4.25
62	002299	圣农发展	1,997,521.26	4.24
63	002624	完美世界	1,946,240.00	4.13
64	300009	安科生物	1,931,171.79	4.09
65	000887	中鼎股份	1,910,236.00	4.05

66	000661	长春高新	1,909,974.00	4.05
67	300316	晶盛机电	1,887,141.47	4.00
68	601336	新华保险	1,879,025.00	3.98
69	601965	中国汽研	1,876,799.54	3.98
70	600201	生物股份	1,847,729.00	3.92
71	300415	伊之密	1,847,668.72	3.92
72	300203	聚光科技	1,830,462.30	3.88
73	002709	天赐材料	1,812,678.00	3.84
74	002555	三七互娱	1,809,972.00	3.84
75	002123	梦网集团	1,809,878.14	3.84
76	002746	仙坛股份	1,805,485.02	3.83
77	000921	海信家电	1,801,111.00	3.82
78	600027	华电国际	1,800,742.00	3.82
79	002458	益生股份	1,778,320.00	3.77
80	600612	老凤祥	1,775,535.80	3.76
81	600176	中国巨石	1,768,534.60	3.75
82	002234	民和股份	1,766,804.00	3.75
83	000338	潍柴动力	1,755,052.01	3.72
84	601688	华泰证券	1,686,334.00	3.58
85	300422	博世科	1,679,700.00	3.56
86	000063	中兴通讯	1,679,531.00	3.56
87	300498	温氏股份	1,643,877.00	3.49
88	002142	宁波银行	1,643,589.00	3.48
89	300021	大禹节水	1,640,329.00	3.48
90	000069	华侨城 A	1,622,247.00	3.44
91	601952	苏垦农发	1,576,786.00	3.34
92	300558	贝达药业	1,563,515.00	3.31
93	002013	中航机电	1,554,688.00	3.30

94	002102	ST 冠福	1,542,234.00	3.27
95	600498	烽火通信	1,539,589.00	3.26
96	002341	新纶科技	1,537,157.00	3.26
97	600483	福能股份	1,517,550.00	3.22
98	002080	中材科技	1,489,540.00	3.16
99	000703	恒逸石化	1,484,751.00	3.15
100	002439	启明星辰	1,480,523.22	3.14
101	601009	南京银行	1,471,078.00	3.12
102	002475	立讯精密	1,438,723.00	3.05
103	601699	潞安环能	1,438,479.34	3.05
104	601088	中国神华	1,414,798.00	3.00
105	002179	中航光电	1,394,672.56	2.96
106	600323	瀚蓝环境	1,357,946.00	2.88
107	002531	天顺风能	1,351,840.00	2.87
108	002050	三花智控	1,341,496.00	2.84
109	600845	宝信软件	1,317,427.00	2.79
110	603881	数据港	1,304,370.00	2.77
111	000498	山东路桥	1,288,341.50	2.73
112	002008	大族激光	1,282,055.00	2.72
113	601003	柳钢股份	1,279,161.24	2.71
114	002027	分众传媒	1,201,764.00	2.55
115	300054	鼎龙股份	1,201,244.00	2.55
116	603365	水星家纺	1,183,379.80	2.51
117	600885	宏发股份	1,181,953.00	2.51
118	300568	星源材质	1,172,259.00	2.49
119	300251	光线传媒	1,123,673.86	2.38
120	002332	仙琚制药	1,115,528.04	2.37
121	600426	华鲁恒升	1,114,625.00	2.36

122	002482	广田集团	1,114,070.00	2.36
123	300628	亿联网络	1,108,822.00	2.35
124	601800	中国交建	1,104,060.00	2.34
125	002355	兴民智通	1,097,027.00	2.33
126	600115	东方航空	1,094,828.00	2.32
127	601186	中国铁建	1,089,566.00	2.31
128	600039	四川路桥	1,083,721.00	2.30
129	300124	汇川技术	1,072,543.00	2.27
130	300136	信维通信	1,056,820.00	2.24
131	600585	海螺水泥	1,051,441.94	2.23
132	601117	中国化学	1,050,391.00	2.23
133	002034	旺能环境	1,039,422.40	2.20
134	603986	兆易创新	1,037,913.00	2.20
135	300045	华力创通	1,022,098.00	2.17
136	600340	华夏幸福	1,007,933.00	2.14
137	603658	安图生物	1,000,146.00	2.12
138	002327	富安娜	997,640.00	2.12
139	002293	罗莱生活	997,597.00	2.12
140	002713	东易日盛	984,540.00	2.09
141	000822	山东海化	967,062.00	2.05
142	600740	山西焦化	962,745.00	2.04
143	603393	新天然气	943,710.00	2.00

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。

#### 8.4.3 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	385,525,617.55
卖出股票收入（成交）总额	381,738,586.88

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。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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

参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	109,928.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,190.98
5	应收申购款	2,997.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,117.01

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3077	12,948.37	8,149,969.67	20.46	31,692,173.67	79.54

### 9.2 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	387,304.78	0.9721

### 9.3 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 12 月 31 日) 基金份额总额	550,793,391.48
本报告期期初基金份额总额	37,307,305.45
本报告期基金总申购份额	22,624,617.56
减：本报告期基金总赎回份额	20,089,779.67
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	39,842,143.34



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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无重大人事变动；本基金托管人于 2018 年 7 月，经中国证监会核准资格，蒋柯先生担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理，2018 年 6 月，经中国证监会核准资格，梁冰女士担任广发银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

### 11.5 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。本年度应支付的审计费为人民币 30,000.00 元。

### 11.6 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未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

安信证券	2	345,116,674.02	44.99%	245,479.24	44.44%	-
海通证券	2	335,769,450.72	43.77%	245,549.28	44.45%	-
川财证券	1	86,216,978.77	11.24%	61,326.29	11.10%	新增
东海证券	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讨论及决定。

### 11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国银保监会关于广发银行王滨任职资格的批复》（银保监复〔2019〕340号），基金托管人广发银行已完成《营业执照》法定代表人变更，法定代表人由“杨明生”变更为

“王滨”。自 2019 年 3 月 26 日起，启用“王滨”法定代表人名章，同时停用“杨明生”名章。

安信基金管理有限责任公司

2019 年 03 月 29 日