

安信盈利驱动股票型证券投资基金 2019 年 半年度报告

2019 年 6 月 30 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

送出日期：2019 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 3 月 5 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
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	38

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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信盈利驱动股票型证券投资基金	
基金简称	安信盈利驱动股票	
基金主代码	006818	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 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	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	183,713,613.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信盈利驱动股票 A	安信盈利驱动股票 C
下属分级基金的交易代码	006818	006819
报告期末下属分级基金的份额总额	158,712,597.81 份	25,001,016.05 份

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,精选盈利前景良好的股票进行投资,力争为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	资产配置方面,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、风险偏好等市场敏感因素的变化趋势,利用主动式、科学的资产配置模型进行大类资产配置。股票投资方面,本基金筛选盈利能力较强,基本面良好的上市公司股票构建盈利驱动主题股票池,评估经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面因素,并结合市场热点和趋势带来的投资机会,构建并优化投资组合。债券投资方面,本基金将采取自上而下的投资策略,通过深入分析宏观经济、货币政策、利率水平、物价水平以及风险偏好的变化趋势,从而确定债券的配置数量与结构。此外,本基金在严格遵守相关法律法规情况下,合理利用权证等衍生工具进行投资,并在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的资产支持证券进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518026	100818
法定代表人		刘入领	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 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(2019 年 3 月 5 日(基金合同生效日)-2019 年 6 月 30 日)	
	安信盈利驱动股票 A	安信盈利驱动股票 C
本期已实现收益	8,595,536.31	1,786,195.63
本期利润	5,563,634.40	2,266,372.07
加权平均基金份额本期利润	0.0283	0.0464
本期加权平均净值利润率	2.82%	4.61%
本期基金份额净值增长率	0.62%	0.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	978,660.31	120,726.60
期末可供分配基金份额利润	0.0062	0.0048
期末基金资产净值	159,691,258.12	25,121,742.65
期末基金份额净值	1.0062	1.0048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.62%	0.48%

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、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同生效日为2019年3月5日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

安信盈利驱动股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.03%	1.17%	4.42%	0.93%	1.61%	0.24%
过去三个月	-2.23%	1.58%	-0.72%	1.22%	-1.51%	0.36%
自基金合同生效起至今	0.62%	1.40%	1.04%	1.25%	-0.42%	0.15%

安信盈利驱动股票 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	5.99%	1.17%	4.42%	0.93%	1.57%	0.24%
过去三个月	-2.34%	1.58%	-0.72%	1.22%	-1.62%	0.36%

自基金合同生效起至今	0.48%	1.40%	1.04%	1.25%	-0.56%	0.15%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

注:根据《安信盈利驱动股票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*80%+中证综合债券指数收益率*20%。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。中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面,期限构成宽泛。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。

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

安信盈利驱动股票A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



安信盈利驱动股票C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. 本基金合同生效日为 2019 年 3 月 5 日, 截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 本基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末, 本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准, 成立于 2011 年 12 月, 总部位于深圳, 注册资本 5.0625 亿元人民币, 股东及股权结构为: 五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权, 安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权, 佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权, 中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2019 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 48 只开放式基金具体如下: 安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金 (LOF) (原安信宝利分级债券型证券投资基金)、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票

型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
袁玮	本基金的基金经理	2019 年 3 月 5 日	-	9	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、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，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任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、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

2、证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

三月初，市场的风险偏好进一步提升，科技类成长股成为市场的明星。三月末，经济数据的好转再次带动了地产与周期股的上涨。然而进入二季度之后，政策开始边际上收紧，社融数据退潮，经济开始显现疲态，市场情绪转入防御，周期股与科技股回调幅度较大，消费类白马股成为了市场追捧的对象。尤其是进入到五月份，贸易战突然加剧，市场情绪受到了巨大的打击。总结来看，一季度市场在周期与成长中寻找进攻机会，二季度则在恐慌中利用消费白马股进行避险。

三月至四月份，在周期股的强势期我们减持一定比例的周期股，并提前布局了一定比例的消费白马。应该说，针对四月初的市场风格切换我们是有所预判和应对的，只不过地产与周期的底仓持有较多，而我们的切换都是用较少比例的仓位来实施，因此导致二季度整体业绩不理想，但显著好于地产与周期的整体性表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信盈利驱动股票 A 基金份额净值为 1.0062 元，本报告期基金份额净值增长

率为 0.62%；截至本报告期末安信盈利驱动股票 C 基金份额净值为 1.0048 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%；同期业绩比较基准收益率为 1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济的预期整体还是偏悲观，贸易战虽然又有所缓和，但对美的出口长期来看依然会受到挤压，同时中国大面积开放市场，也会加大国内很多产业的竞争压力。与此同时，去杠杆的长期目标依然在起作用，中国的潜在经济增速下行的趋势没有好转的迹象。在这个背景之下，逆周期的调节依然是阶段性的政策选项，其中基建与房地产依然是重要的抓手。考虑到我们的人均基础设施依然大幅落后于发达国家，再考虑到我们的实际居住条件依然有很强的升级需求，因此即便是从中长期来看，基建与地产依然有较大的发展空间，在经济下行压力较大的时期，使用基建与地产来托底经济的做法并没有市场所担忧的较大的负面作用。科技的发展是基于文化与价值导向的自然结果，并不是简单的资本推动型产业，需要一个很长的孕育期，而这个时期中，传统领域依然会发挥重要的作用，并实实在在的改善老百姓的生活质量，为科技文化的长期发展奠定物质基础。至于消费市场，它是一个滞后于周期的市场，在经济整体低迷的背景下，除了少量必选消费品外，大多数消费品都或多或少会遇到压力。当然，经济的下行中，同样会促使行业的优胜劣汰，促使各个行业向优质头部公司集中，这一特征已经持续了好几年，未来依然会持续下去。因此我们认为，下半年指数大涨大跌的概率不大，从政策托底的角度来看，周期股或许会有优势，但更重要的分化依然会在公司的优劣选择上体现出来。

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债金融估值中心有限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”）在安信盈利驱动股票型证券投资基金（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：安信盈利驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	13,300,600.96
结算备付金		350,826.35
存出保证金		136,077.42
交易性金融资产	6.4.7.2	172,799,285.32
其中：股票投资		172,799,285.32
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		184,558.84
应收利息	6.4.7.5	2,980.76
应收股利		-
应收申购款		174,309.97
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		186,948,639.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		184,273.35
应付赎回款		1,382,740.22
应付管理人报酬		225,511.22
应付托管费		37,585.20
应付销售服务费		8,505.98
应付交易费用	6.4.7.7	231,730.09
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	65,292.79
负债合计		2,135,638.85
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	183,713,613.86
未分配利润	6.4.7.10	1,099,386.91
所有者权益合计		184,813,000.77
负债和所有者权益总计		186,948,639.62

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 183,713,613.86 份，其中安信盈利驱动股票 A 基金份额总额为 158,712,597.81 份，基金份额净值 1.0062 元；安信盈利驱动股票 C 基金份额总额为 25,001,016.05 份，基金份额净值 1.0048 元。

2. 本基金合同生效日为 2019 年 3 月 5 日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：安信盈利驱动股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效 日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		9,861,105.76
1. 利息收入		310,572.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	191,824.01
债券利息收入		14.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		118,733.70
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,440,651.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,668,892.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,905.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,763,853.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,551,725.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,661,606.97
减：二、费用		2,031,099.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,154,971.88

2. 托管费	6.4.10.2.2	192,495.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	59,665.93
4. 交易费用	6.4.7.19	554,456.51
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.03
7. 其他费用	6.4.7.20	69,509.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,830,006.47
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,830,006.47

注：本基金合同生效日为 2019 年 3 月 5 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信盈利驱动股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	484,492,971.82	-	484,492,971.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,830,006.47	7,830,006.47
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）	-300,779,357.96	-6,730,619.56	-307,509,977.52
其中：1. 基金申购款	33,623,295.39	970,944.18	34,594,239.57
2. 基金赎回款	-334,402,653.35	-7,701,563.74	-342,104,217.09
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）	183,713,613.86	1,099,386.91	184,813,000.77

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

安信盈利驱动股票型证券投资基金（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”）2018年7月11日下发的证监许可[2018]1088号文“关于准予安信盈利驱动股票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《安信盈利驱动股票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2019年1月8日至2019年3月1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(2019)验字60962175_H02号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币484,215,136.98元。经向中国证监会备案，《安信盈利驱动股票型证券投资基金基金合同》于2019年3月5日正式生效。截至2019年3月5日止，安信盈利驱动股票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484,215,136.98元，折合484,215,136.98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277,834.84元，折合277,834.84份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币484,492,971.82元，折合484,492,971.82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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信盈利驱动股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，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，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于盈利驱动主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*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—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。惟本会计期间为自 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止。

6.4.4.2 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）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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、买入返售金

融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的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，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的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额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的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，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款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。

终止确认

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，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入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。

金融资产转移

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；本基金既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控制的，终止确认该金融资产并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

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，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进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日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，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。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 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未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后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，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将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或折价；

(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，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿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

当本基金同时满足下列条件时，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后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；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或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默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损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供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。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他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 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	13,300,600.96
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	13,300,600.96	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	175,351,010.79	172,799,285.32	-2,551,725.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		175,351,010.79	172,799,285.32	-2,551,725.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,761.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	157.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	61.30
合计	2,980.76

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日

交易所市场应付交易费用	231,730.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	231,730.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,775.21
应付审计费	23,444.24
应付信息披露费	39,073.34
合计	65,292.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信盈利驱动股票 A

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	316,705,066.18	316,705,066.18
本期申购	23,937,791.54	23,937,791.54
本期赎回（以“-”号填列）	-181,930,259.91	-181,930,259.91
本期末	158,712,597.81	158,712,597.81

安信盈利驱动股票 C

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	167,787,905.64	167,787,905.64
本期申购	9,685,503.85	9,685,503.85
本期赎回（以“-”号填列）	-152,472,393.44	-152,472,393.44
本期末	25,001,016.05	25,001,016.05

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信盈利驱动股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	8,595,536.31	-3,031,901.91	5,563,634.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,440,923.49	-3,144,050.60	-4,584,974.09
其中：基金申购款	482,878.01	201,939.78	684,817.79
基金赎回款	-1,923,801.50	-3,345,990.38	-5,269,791.88
本期已分配利润	-	-	-

本期末	7,154,612.82	-6,175,952.51	978,660.31
安信盈利驱动股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	1,786,195.63	480,176.44	2,266,372.07
本期基金份额交易产生的变动数	-692,985.81	-1,452,659.66	-2,145,645.47
其中：基金申购款	178,083.05	108,043.34	286,126.39
基金赎回款	-871,068.86	-1,560,703.00	-2,431,771.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,093,209.82	-972,483.22	120,726.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
活期存款利息收入	180,253.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,120.13
其他	450.56
合计	191,824.01

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	161,922,429.45
减：卖出股票成本总额	154,253,536.85
买卖股票差价收入	7,668,892.60

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	47,920.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,997.81
减：应收利息总额	17.10
买卖债券差价收入	7,905.89

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,763,853.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,763,853.49

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,551,725.47
股票投资	-2,551,725.47
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,551,725.47

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	1,661,375.84
基金转换费收入	231.13
合计	1,661,606.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	554,456.51
银行间市场交易费用	-
合计	554,456.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	23,444.24
信息披露费	39,073.34
银行汇划费用	6,592.06
其他	400.00
合计	69,509.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,154,971.88
其中：支付销售机构的客户维护费	400,140.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	192,495.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信盈利驱动股票 A	安信盈利驱动股票 C	合计
安信证券	-	23,233.15	23,233.15
安信基金	-	8,945.07	8,945.07
中国银行	-	1,431.99	1,431.99
合计	-	33,610.21	33,610.21

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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日

	期末余额	当期利息收入
中国银行	13,300,600.96	180,253.32

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年07月05日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资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，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性

风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本

基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,300,600.96	-	-	-	13,300,600.96
结算备付金	350,826.35	-	-	-	350,826.35
存出保证金	136,077.42	-	-	-	136,077.42
交易性金融资产	-	-	-	172,799,285.32	172,799,285.32
应收利息	-	-	-	2,980.76	2,980.76
应收申购款	-	-	-	174,309.97	174,309.97
应收证券清算款	-	-	-	184,558.84	184,558.84
资产总计	13,787,504.73	-	-	173,161,134.89	186,948,639.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,382,740.22	1,382,740.22
应付管理人报酬	-	-	-	225,511.22	225,511.22
应付托管费	-	-	-	37,585.20	37,585.20
应付证券清算款	-	-	-	184,273.35	184,273.35
应付销售服务费	-	-	-	8,505.98	8,505.98
应付交易费用	-	-	-	231,730.09	231,730.09
其他负债	-	-	-	65,292.79	65,292.79
负债总计	-	-	-	2,135,638.85	2,135,638.85
利率敏感度缺口	13,787,504.73	-	-	171,025,496.04	184,813,000.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2019 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资金占基金资产的比例为 80%-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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	172,799,285.32	93.50
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	172,799,285.32	93.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2019年6月30日）	
分析	1、沪深 300 指数上升 5%	9,846,751.96
	2、沪深 300 指数下降 5%	-9,846,751.96

§ 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	172,799,285.32	92.43

	其中：股票	172,799,285.32	92.43
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	13,651,427.31	7.30
8	其他各项资产	497,926.99	0.27
9	合计	186,948,639.62	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

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	-	-
B	采矿业	111,825.00	0.06
C	制造业	75,353,367.19	40.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,078,614.00	8.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,508,363.88	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,176,665.76	6.05
J	金融业	21,167,489.94	11.45
K	房地产业	41,629,771.95	22.53
L	租赁和商务服务业	3,750,081.00	2.03
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	172,799,285.32	93.50

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所有股票投资明细

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	002230	科大讯飞	335,050	11,137,062.00	6.03
2	600383	金地集团	920,300	10,979,179.00	5.94
3	000069	华侨城A	1,564,381	10,872,447.95	5.88
4	601668	中国建筑	1,871,300	10,759,975.00	5.82
5	600048	保利地产	835,800	10,664,808.00	5.77
6	000932	华菱钢铁	2,180,660	10,401,748.20	5.63
7	000338	潍柴动力	778,500	9,567,765.00	5.18
8	601318	中国平安	104,600	9,268,606.00	5.02
9	000002	万科A	327,700	9,113,337.00	4.93
10	600585	海螺水泥	207,100	8,594,650.00	4.65
11	601166	兴业银行	415,800	7,604,982.00	4.11
12	600741	华域汽车	339,900	7,341,840.00	3.97
13	600031	三一重工	448,900	5,871,612.00	3.18
14	600196	复星医药	231,600	5,859,480.00	3.17
15	002051	中工国际	463,700	5,318,639.00	2.88
16	600309	万华化学	121,000	5,177,590.00	2.80
17	600036	招商银行	118,400	4,260,032.00	2.31
18	002507	涪陵榨菜	124,300	3,791,150.00	2.05
19	002027	分众传媒	708,900	3,750,081.00	2.03
20	000333	美的集团	69,100	3,583,526.00	1.94
21	600690	海尔智家	206,434	3,569,243.86	1.93
22	600887	伊利股份	106,100	3,544,801.00	1.92
23	002120	韵达股份	113,834	3,508,363.88	1.90
24	300203	聚光科技	134,600	3,216,940.00	1.74
25	000786	北新建材	153,900	2,790,207.00	1.51
26	600519	贵州茅台	1,900	1,869,600.00	1.01
27	600968	海油发展	31,500	111,825.00	0.06
28	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
29	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
30	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
31	603863	松炆资源	1,451	33,489.08	0.02
32	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
33	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
34	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
35	600660	福耀玻璃	1	22.73	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600383	金地集团	24,881,187.00	13.46
2	000069	华侨城 A	20,919,126.80	11.32
3	002230	科大讯飞	19,575,795.00	10.59
4	000338	潍柴动力	16,669,694.49	9.02
5	600741	华域汽车	16,497,303.00	8.93
6	601668	中国建筑	15,728,439.00	8.51
7	000002	万科 A	14,664,959.00	7.94
8	600048	保利地产	14,615,482.00	7.91
9	000932	华菱钢铁	14,322,504.00	7.75
10	600887	伊利股份	13,838,314.76	7.49
11	002507	涪陵榨菜	13,729,732.96	7.43
12	600196	复星医药	13,527,874.00	7.32
13	600519	贵州茅台	12,169,991.00	6.59
14	601166	兴业银行	10,244,824.00	5.54
15	601318	中国平安	9,977,547.00	5.40
16	600660	福耀玻璃	9,386,931.53	5.08
17	600309	万华化学	9,125,900.05	4.94
18	600585	海螺水泥	9,011,090.00	4.88
19	600031	三一重工	8,609,668.00	4.66
20	002051	中工国际	8,607,223.00	4.66
21	002475	立讯精密	8,206,707.40	4.44
22	002120	韵达股份	7,774,988.30	4.21
23	600690	海尔智家	6,602,990.33	3.57
24	600036	招商银行	6,432,784.60	3.48
25	002027	分众传媒	5,737,359.51	3.10
26	000333	美的集团	5,455,780.61	2.95

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600383	金地集团	15,183,947.00	8.22
2	600519	贵州茅台	11,783,878.00	6.38
3	000069	华侨城 A	11,653,779.00	6.31

4	600887	伊利股份	11,354,579.61	6.14
5	600741	华域汽车	10,204,265.00	5.52
6	002507	涪陵榨菜	9,823,445.11	5.32
7	600660	福耀玻璃	9,749,943.85	5.28
8	000338	潍柴动力	9,264,045.20	5.01
9	002475	立讯精密	8,219,913.00	4.45
10	002230	科大讯飞	7,190,381.00	3.89
11	600196	复星医药	6,863,726.00	3.71
12	000002	万科A	5,037,741.77	2.73
13	601668	中国建筑	4,330,925.00	2.34
14	002120	韵达股份	4,203,966.00	2.27
15	000932	华菱钢铁	4,140,081.74	2.24
16	600048	保利地产	3,361,826.00	1.82
17	300616	尚品宅配	3,203,365.00	1.73
18	600309	万华化学	3,158,992.00	1.71
19	600745	闻泰科技	3,121,526.00	1.69
20	600690	海尔智家	2,940,123.55	1.59

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	329,604,547.64
卖出股票收入（成交）总额	161,922,429.45

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所有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

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、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冲组合的绝对收益。

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。基金管理人将以套期保值为目的，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，力求实现所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本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行除华菱钢铁（股票代码：000932），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。

湖南华菱湘潭钢铁有限公司于 2018 年 12 月 27 日收到地方外管局处罚。因重复单证办理境内融资以及未按规定办理贸易外汇业务，被以警告并罚款 14 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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	136,077.42
2	应收证券清算款	184,558.84
3	应收股利	-
4	应收利息	2,980.76
5	应收申购款	174,309.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	497,926.99

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		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(%)
安信盈利驱动股票 A	2,750	57,713.67	204,490.94	0.13	158,508,106.87	99.87
安信盈利驱动股票 C	1,762	14,189.00	-	-	25,001,016.05	100.00
合计	4,417	41,592.40	204,490.94	0.11	183,509,122.92	99.89

注:机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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	安信盈利驱动股票 A	108,538.60	0.0684
	安信盈利驱动股票 C	150,742.14	0.6029
	合计	259,280.74	0.1411

注:管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	安信盈利驱动股票 A	0
	安信盈利驱动股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信盈利驱动股票 A	0
	安信盈利驱动股票 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信盈利驱动股票 A	安信盈利驱动股票 C
基金合同生效日(2019年3月5日)基金份额总额	316,705,066.18	167,787,905.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	23,937,791.54	9,685,503.85
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	181,930,259.91	152,472,393.44
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	158,712,597.81	25,001,016.05

§ 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

一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 1 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第三届董事会第十次会议审议通过，廖维坤先生自 2019 年 5 月 31 日起担任公司副总经理兼首席信息官。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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		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	
长江证券	2	278,519,792.56	56.76%	198,111.74	56.76%	-
招商证券	2	172,445,019.47	35.15%	122,660.15	35.15%	-
天风证券	2	39,694,704.76	8.09%	28,235.18	8.09%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

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		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
长江证券	-	-	762,700,000.00	80.56%	-	-
招商证券	47,920.80	100.00%	184,000,000.00	19.44%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信盈利驱动股票型证券投资基金基金合同生效公告	证券日报	2019-03-06
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长春高新(000661)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-03-06
3	安信盈利驱动股票型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报	2019-03-08
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持格力电器(000651)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-02
5	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-03
6	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、	2019-05-13

		证券日报	
7	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增开源证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、上海证券报	2019-05-15
8	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-20
9	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-01
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
11	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
12	关于安信基金管理有限责任公司暂停快速取现业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-29

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信盈利驱动股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信盈利驱动股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信盈利驱动股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信盈利驱动股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2019年8月27日