

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 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 01 月 01 日起至 06 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	4
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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	43
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	43

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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	安信阿尔法定开混合
基金主代码	005280
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	151,278,628.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用 Alpha 多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建 Alpha 股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	张燕
	联系电话	0755-82509999	0755-83199084
	电子邮箱	service@essencefund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95555
传真		0755-82799292	0755-83195201

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518026	518040
法定代表人	刘入领	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	126,094.10
本期利润	304,177.93
加权平均基金份额本期利润	0.0156
本期加权平均净值利润率	1.58%
本期基金份额净值增长率	0.02%
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	-1,889,835.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0125
期末基金资产净值	149,388,793.05
期末基金份额净值	0.9875
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	-1.25%

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。

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
过去一个月	0.20%	0.05%	0.12%	0.00%	0.08%	0.05%
过去三个月	-0.40%	0.07%	0.37%	0.00%	-0.77%	0.07%
过去六个月	0.02%	0.06%	0.73%	0.00%	-0.71%	0.06%
过去一年	-2.25%	0.10%	1.49%	0.00%	-3.74%	0.10%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.11%	2.35%	0.00%	-3.60%	0.11%

注：根据《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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

安信阿尔法定开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、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 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 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		
徐黄玮	本基金的 基金经理	2017 年 12 月 29 日	-	12	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点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、安信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
龙川	本基金的 基金经理， 量化投资 部总经理	2017 年 12 月 6 日	2019 年 5 月 7 日	17	龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化

					<p>投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信量化多因子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的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

上半年宏观经济仍处于回落区间，行业景气多数下行，同时中美贸易压力不断升温，华为断供事件、包商事件对市场情绪有影响，风险偏好不断下降，直至 G20 峰会市场情绪方才缓和。经济下行压力和美国降息预期继续催生市场对宽松政策的期待，货币政策中性偏宽松，市场流动性相对充裕。

本基金主要通过量化多因子的方法来构建多头，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素，精选优质、具有投资价值和合理估值的个股作为主要的投资标的，并积极把握指数分红、指数成分调整、新股等确定性增强机会。同时运用股指期货进行对冲，密切关注不同期货的基差波动带来的建平仓机会。

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 0.9875 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，本基金将持续关注经济数据以及中美贸易的进展。将市场及政策的变化当作变量，结合量化模型，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

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

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满 3 年，故报告期不存在需要说明的情况。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,355,333.14	1,900,982.39
结算备付金		6,308,474.76	340,005.58
存出保证金		9,712,636.53	10,549.79
交易性金融资产	6.4.7.2	103,689,604.49	3,799,500.00
其中：股票投资		98,882,804.49	-
基金投资		-	-
债券投资		4,806,800.00	3,799,500.00
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	24,000,000.00	3,900,000.00
应收证券清算款		51,182.01	-
应收利息	6.4.7.5	87,358.98	26,745.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		151,204,589.91	9,977,782.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 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		1,709,123.30	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,203.61	8,440.36
应付托管费		12,550.92	2,110.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	33,960.71	7,210.04
应交税费		41.33	35.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	9,916.99	20,000.00
负债合计		1,815,796.86	37,795.56
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	151,278,628.32	10,067,809.27
未分配利润	6.4.7.10	-1,889,835.27	-127,821.94
所有者权益合计		149,388,793.05	9,939,987.33
负债和所有者权益总计		151,204,589.91	9,977,782.89

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9875 元，基金份额总额 151,278,628.32 份。

6.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		480,096.19	251,279.29
1. 利息收入		138,157.06	129,201.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,614.85	7,735.91
债券利息收入		70,368.30	61,658.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		52,173.91	59,806.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		163,846.28	130,540.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-85,358.35	-93,065.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	61,375.00
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	15,894.17	148,135.92
股利收益	6.4.7.16	233,310.46	14,094.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	178,083.83	-8,735.79
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	9.02	273.83
减：二、费用		175,918.26	161,090.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	91,353.06	60,734.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,838.24	12,781.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	51,378.26	70,016.20
5. 利息支出		-	1,605.30
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,605.30
6. 税金及附加		286.71	533.28
7. 其他费用	6.4.7.20	10,061.99	15,419.39

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		304,177.93	90,188.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		304,177.93	90,188.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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)	10,067,809.27	-127,821.94	9,939,987.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	304,177.93	304,177.93
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)	141,210,819.05	-2,066,191.26	139,144,627.79
其中：1. 基金申购款	141,218,329.57	-2,066,265.56	139,152,064.01
2. 基金赎回款	-7,510.52	74.30	-7,436.22
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)	151,278,628.32	-1,889,835.27	149,388,793.05
项目	上年度可比期间 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)	10,298,649.48	14,482.34	10,313,131.82
二、本期经营活	-	90,188.73	90,188.73

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-162,759.76	-1,082.82	-163,842.58
其中：1. 基金申购款	2,018.33	-1.19	2,017.14
2. 基金赎回款	-164,778.09	-1,081.63	-165,859.72
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）	10,135,889.72	103,588.25	10,239,477.97

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

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金（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 11 月 20 日下发的证监许可[2015]2684 号文注册，并根据 2017 年 5 月 12 日机构部函[2017]1166 号文“关于同意安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函”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《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 30 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字第 60962175_H11 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 10,298,505.71 元。经向中国证监会备案，《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金》于 2017 年 12 月 6 日正式生效。截至 2017 年 12 月 4 日止，

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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 10,298,505.71 元，折合 10,298,505.71 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 143.77 元，折合 143.77 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 10,298,649.48 元，折合 10,298,649.48 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金各类资产投资比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

6.4.6.2 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

6.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 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	7,355,333.14
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	7,355,333.14

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	98,903,080.66	98,882,804.49	-20,276.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,806,800.00	7,291.61
	银行间市场	-	-
	合计	4,806,800.00	7,291.61
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	103,702,589.05	103,689,604.49	-12,984.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-97,111,500.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-97,111,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-97,111,500.00	-	-	-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 20 手 IF1907 卖出合约，其合约市值-22,830,000.00 元，85 手 IH1907 卖出合约，其合约市值-74,281,500.00 元。

2、买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	24,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	24,000,000.00	-

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	5,666.74
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	96.80
应收债券利息	81,594.74
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	0.70
合计	87,358.98

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	33,960.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,960.71

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	-
应付审计费	9,916.99
合计	9,916.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,067,809.27	10,067,809.27
本期申购	141,218,329.57	141,218,329.57
本期赎回（以“-”号填列）	-7,510.52	-7,510.52
本期末	151,278,628.32	151,278,628.32

注：总申购份额含转换入份额，总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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-127,973.86	151.92	-127,821.94
本期利润	126,094.10	178,083.83	304,177.93
本期基金份额交易	-850,258.49	-1,215,932.77	-2,066,191.26

产生的变动数			
其中：基金申购款	-850,334.33	-1,215,931.23	-2,066,265.56
基金赎回款	75.84	-1.54	74.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-852,138.25	-1,037,697.02	-1,889,835.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入		14,008.55
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		1,551.55
其他		54.75
合计		15,614.85

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出股票成交总额		5,053,354.04
减：卖出股票成本总额		5,138,712.39
买卖股票差价收入		-85,358.35

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
股指期货投资收益		15,894.17

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	

股票投资产生的股利收益	233,310.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	233,310.46

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1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,076.17
股票投资	-20,276.17
债券投资	7,200.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	191,160.00
权证投资	-
期货	191,160.00
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	178,083.83

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	9.02
合计	9.02

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	51,378.26
银行间市场交易费用	-
合计	51,378.26

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
银行汇划费用	145.00
合计	10,061.99

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

注：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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
安信证券	109,094,031.09	100.00	56,378,215.09	100.00

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	33,960.71	100.00	33,960.71	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	29,961.59	100.00	1,812.45	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 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1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	91,353.06
其中：支付销售机构的客户维护费	5,696.36	479.86

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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

2) 基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	22,838.24

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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

份额单位:份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2017 年 12 月 6 日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.61%	98.66%

注: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。

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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

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1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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
招商银行	7,355,333.14	14,008.55	626,909.13	5,440.29

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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股票投资、债券投资及权证投资等，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。

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.27%。（2018 年 12 月 31 日：4.02%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,404,400.00	3,400,340.00
合计	4,404,400.00	3,400,340.00

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
AAA	402,400.00	399,160.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	402,400.00	399,160.00

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

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	7,355,333.14	-	-	-	7,355,333.14
结算备付金	6,308,474.76	-	-	-	6,308,474.76
存出保证金	9,712,636.53	-	-	-	9,712,636.53
交易性金融资产	4,404,400.00	402,400.00	-	98,882,804.49	103,689,604.49
买入返售金融资产	24,000,000.00	-	-	-	24,000,000.00
应收利息	-	-	-	87,358.98	87,358.98
应收证券清算款	-	-	-	51,182.01	51,182.01
资产总计	51,780,844.43	402,400.00	-	99,021,345.48	151,204,589.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	50,203.61	50,203.61
应付托管费	-	-	-	12,550.92	12,550.92
应付证券清算款	-	-	-	1,709,123.30	1,709,123.30

应付交易费用	-	-	-	33,960.71	33,960.71
应交税费	-	-	-	41.33	41.33
其他负债	-	-	-	9,916.99	9,916.99
负债总计	-	-	-	1,815,796.86	1,815,796.86
利率敏感度缺口	51,780,844.43	402,400.00	-	97,205,548.62	149,388,793.05
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,900,982.39	-	-	-	1,900,982.39
结算备付金	340,005.58	-	-	-	340,005.58
存出保证金	10,549.79	-	-	-	10,549.79
交易性金融资产	3,799,500.00	-	-	-	3,799,500.00
买入返售金融资产	3,900,000.00	-	-	-	3,900,000.00
应收利息	-	-	-	26,745.13	26,745.13
资产总计	9,951,037.76	-	-	26,745.13	9,977,782.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,440.36	8,440.36
应付托管费	-	-	-	2,110.09	2,110.09
应付交易费用	-	-	-	7,210.04	7,210.04
应交税费	-	-	-	35.07	35.07
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	37,795.56	37,795.56
利率敏感度缺口	9,951,037.76	-	-	-11,050.43	9,939,987.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

假设	除市场利率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）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率上升 25 个基点	-5,774.51	-7,467.61
	2. 市场利率下降 25 个基点	5,793.98	7,497.80

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

金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。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		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	98,882,804.49	66.19	-	-
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	98,882,804.49	66.19	-	-

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）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	1、沪深 300 指数上	4,537,084.10	-

	升 5%		
	2、沪深 300 指数下 降 5%	-4,537,084.10	-

§ 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	98,882,804.49	65.40
	其中：股票	98,882,804.49	65.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,806,800.00	3.18
	其中：债券	4,806,800.00	3.18
	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	24,000,000.00	15.87
	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	13,663,807.90	9.04
8	其他各项资产	9,851,177.52	6.52
9	合计	151,204,589.91	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	335,619.00	0.22
B	采矿业	3,698,201.00	2.48
C	制造业	29,984,816.89	20.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	504,311.00	0.34
E	建筑业	3,887,768.00	2.60
F	批发和零售业	309,153.60	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,418,152.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,581,403.20	1.06
J	金融业	52,278,581.50	34.99
K	房地产业	3,014,921.00	2.02

L	租赁和商务服务业	1,470,674.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	156,024.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	26,486.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	111,973.30	0.07
R	文化、体育和娱乐业	104,720.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	98,882,804.49	66.19

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	601318	中国平安	167,150	14,811,161.50	9.91
2	600519	贵州茅台	8,100	7,970,400.00	5.34
3	601288	农业银行	1,384,900	4,985,640.00	3.34
4	601328	交通银行	630,100	3,856,212.00	2.58
5	601166	兴业银行	177,300	3,242,817.00	2.17
6	600276	恒瑞医药	46,800	3,088,800.00	2.07
7	600887	伊利股份	92,200	3,080,402.00	2.06
8	600030	中信证券	119,000	2,833,390.00	1.90
9	601601	中国太保	60,400	2,205,204.00	1.48
10	600016	民生银行	343,600	2,181,860.00	1.46
11	000001	平安银行	153,100	2,109,718.00	1.41
12	600000	浦发银行	177,500	2,073,200.00	1.39
13	601668	中国建筑	317,300	1,824,475.00	1.22
14	600837	海通证券	122,300	1,735,437.00	1.16
15	601398	工商银行	272,000	1,602,080.00	1.07
16	600048	保利地产	107,900	1,376,804.00	0.92
17	601211	国泰君安	73,800	1,354,230.00	0.91
18	600104	上汽集团	53,000	1,351,500.00	0.90
19	601939	建设银行	179,900	1,338,456.00	0.90
20	002142	宁波银行	54,400	1,318,656.00	0.88
21	601888	中国国旅	14,800	1,312,020.00	0.88
22	600585	海螺水泥	30,200	1,253,300.00	0.84
23	601688	华泰证券	55,100	1,229,832.00	0.82
24	601766	中国中车	147,100	1,190,039.00	0.80
25	600031	三一重工	88,600	1,158,888.00	0.78

26	600028	中国石化	202,300	1,106,581.00	0.74
27	601186	中国铁建	109,000	1,084,550.00	0.73
28	601628	中国人寿	37,300	1,056,336.00	0.71
29	601088	中国神华	49,900	1,016,962.00	0.68
30	600309	万华化学	23,700	1,014,123.00	0.68
31	601229	上海银行	82,600	978,810.00	0.66
32	600690	海尔智家	55,000	950,950.00	0.64
33	600340	华夏幸福	27,200	885,904.00	0.59
34	600019	宝钢股份	134,700	875,550.00	0.59
35	600050	中国联通	140,800	867,328.00	0.58
36	601857	中国石油	122,400	842,112.00	0.56
37	601818	光大银行	214,100	815,721.00	0.55
38	601989	中国重工	138,400	769,504.00	0.52
39	601390	中国中铁	112,700	734,804.00	0.49
40	601336	新华保险	11,500	632,845.00	0.42
41	000651	格力电器	11,400	627,000.00	0.42
42	601111	中国国航	49,000	468,930.00	0.31
43	000333	美的集团	8,600	445,996.00	0.30
44	000858	五粮液	3,600	424,620.00	0.28
45	603993	洛阳钼业	106,100	420,156.00	0.28
46	600703	三安光电	36,700	413,976.00	0.28
47	600029	南方航空	51,800	399,896.00	0.27
48	600196	复星医药	15,100	382,030.00	0.26
49	000002	万科A	9,000	250,290.00	0.17
50	300498	温氏股份	6,900	247,434.00	0.17
51	600900	长江电力	12,200	218,380.00	0.15
52	601138	工业富联	17,900	215,695.00	0.14
53	601988	中国银行	54,000	201,960.00	0.14
54	002415	海康威视	6,900	190,302.00	0.13
55	601169	北京银行	27,400	161,934.00	0.11
56	603288	海天味业	1,500	157,500.00	0.11
57	603259	药明康德	1,800	156,024.00	0.10
58	601319	中国人保	16,000	151,840.00	0.10
59	000725	京东方A	43,900	151,016.00	0.10
60	600009	上海机场	1,800	150,804.00	0.10
61	000063	中兴通讯	4,400	143,132.00	0.10
62	601066	中信建投	6,700	141,236.00	0.09
63	300059	东方财富	10,000	135,500.00	0.09
64	002304	洋河股份	1,100	133,716.00	0.09
65	002475	立讯精密	4,600	114,034.00	0.08
66	000568	泸州老窖	1,400	113,162.00	0.08
67	601012	隆基股份	4,740	109,541.40	0.07

68	000338	潍柴动力	8,900	109,381.00	0.07
69	000661	长春高新	300	101,400.00	0.07
70	002027	分众传媒	19,000	100,510.00	0.07
71	600919	江苏银行	12,800	92,928.00	0.06
72	001979	招商蛇口	4,400	91,960.00	0.06
73	601009	南京银行	11,000	90,860.00	0.06
74	002230	科大讯飞	2,700	89,748.00	0.06
75	601006	大秦铁路	11,000	88,990.00	0.06
76	002714	牧原股份	1,500	88,185.00	0.06
77	002594	比亚迪	1,700	86,224.00	0.06
78	601899	紫金矿业	22,400	84,448.00	0.06
79	000166	申万宏源	16,700	83,667.00	0.06
80	600109	国金证券	8,600	83,592.00	0.06
81	000538	云南白药	1,000	83,420.00	0.06
82	600570	恒生电子	1,200	81,780.00	0.05
83	002024	苏宁易购	6,900	79,212.00	0.05
84	600352	浙江龙盛	4,800	75,696.00	0.05
85	000776	广发证券	5,500	75,570.00	0.05
86	601669	中国电建	14,200	75,118.00	0.05
87	601933	永辉超市	7,100	72,491.00	0.05
88	300015	爱尔眼科	2,290	70,921.30	0.05
89	600958	东方证券	6,600	70,488.00	0.05
90	600436	片仔癀	600	69,120.00	0.05
91	601225	陕西煤业	7,400	68,376.00	0.05
92	000100	TCL 集团	20,100	66,933.00	0.04
93	600027	华电国际	17,700	66,729.00	0.04
94	000876	新 希 望	3,800	66,006.00	0.04
95	300142	沃森生物	2,300	65,228.00	0.04
96	601155	新城控股	1,600	63,696.00	0.04
97	002202	金风科技	5,100	63,393.00	0.04
98	600406	国电南瑞	3,400	63,376.00	0.04
99	600588	用友网络	2,290	61,555.20	0.04
100	600741	华域汽车	2,800	60,480.00	0.04
101	002736	国信证券	4,400	57,904.00	0.04
102	600660	福耀玻璃	2,500	56,825.00	0.04
103	601377	兴业证券	8,200	55,268.00	0.04
104	000157	中联重科	9,100	54,691.00	0.04
105	600010	包钢股份	32,100	54,249.00	0.04
106	600547	山东黄金	1,300	53,521.00	0.04
107	000069	华侨城 A	7,700	53,515.00	0.04
108	000783	长江证券	6,800	53,108.00	0.04
109	600795	国电电力	20,700	52,578.00	0.04

110	002008	大族激光	1,500	51,570.00	0.03
111	600705	中航资本	9,500	51,490.00	0.03
112	601901	方正证券	7,200	51,192.00	0.03
113	600111	北方稀土	3,800	48,792.00	0.03
114	600011	华能国际	7,800	48,594.00	0.03
115	600271	航天信息	2,100	48,405.00	0.03
116	601108	财通证券	4,400	48,312.00	0.03
117	002236	大华股份	3,300	47,916.00	0.03
118	600438	通威股份	3,400	47,804.00	0.03
119	600383	金地集团	4,000	47,720.00	0.03
120	002007	华兰生物	1,550	47,259.50	0.03
121	600089	特变电工	6,500	47,125.00	0.03
122	002311	海大集团	1,500	46,350.00	0.03
123	601985	中国核电	8,200	45,592.00	0.03
124	601600	中国铝业	11,600	45,472.00	0.03
125	002422	科伦药业	1,500	44,595.00	0.03
126	002001	新 和 成	2,300	44,367.00	0.03
127	300003	乐普医疗	1,900	43,738.00	0.03
128	600606	绿地控股	6,400	43,712.00	0.03
129	600115	东方航空	6,900	43,263.00	0.03
130	000963	华东医药	1,660	43,093.60	0.03
131	601555	东吴证券	4,200	43,050.00	0.03
132	000895	双汇发展	1,700	42,313.00	0.03
133	300124	汇川技术	1,800	41,238.00	0.03
134	002044	美年健康	3,300	41,052.00	0.03
135	600332	白云山	1,000	40,970.00	0.03
136	601618	中国中冶	13,000	39,520.00	0.03
137	002410	广联达	1,200	39,468.00	0.03
138	600522	中天科技	4,300	39,431.00	0.03
139	000768	中航飞机	2,500	39,375.00	0.03
140	600177	雅戈尔	6,200	39,370.00	0.03
141	300033	同花顺	400	39,344.00	0.03
142	600018	上港集团	5,700	38,874.00	0.03
143	601788	光大证券	3,400	38,828.00	0.03
144	300122	智飞生物	900	38,790.00	0.03
145	603019	中科曙光	1,100	38,610.00	0.03
146	600487	亨通光电	2,300	38,548.00	0.03
147	002271	东方雨虹	1,700	38,522.00	0.03
148	601607	上海医药	2,100	38,115.00	0.03
149	600100	同方股份	4,200	38,010.00	0.03
150	600637	东方明珠	3,600	37,944.00	0.03
151	002352	顺丰控股	1,100	37,356.00	0.03

152	000425	徐工机械	8,300	37,018.00	0.02
153	300408	三环集团	1,900	36,955.00	0.02
154	300017	网宿科技	3,400	36,652.00	0.02
155	600893	航发动力	1,600	36,336.00	0.02
156	600176	中国巨石	3,700	35,261.00	0.02
157	600516	方大炭素	2,831	34,792.99	0.02
158	601877	正泰电器	1,500	34,635.00	0.02
159	600004	白云机场	1,900	34,580.00	0.02
160	600809	山西汾酒	500	34,525.00	0.02
161	300136	信维通信	1,400	34,230.00	0.02
162	601919	中远海控	6,800	34,136.00	0.02
163	600498	烽火通信	1,200	33,432.00	0.02
164	601727	上海电气	6,200	33,356.00	0.02
165	000728	国元证券	3,600	33,012.00	0.02
166	002460	赣锋锂业	1,400	32,802.00	0.02
167	600066	宇通客车	2,500	32,550.00	0.02
168	600867	通化东宝	2,100	32,340.00	0.02
169	601998	XD 中信银	5,400	32,238.00	0.02
170	000423	东阿阿胶	800	31,856.00	0.02
171	600023	浙能电力	7,200	31,824.00	0.02
172	601021	春秋航空	700	31,500.00	0.02
173	002673	西部证券	3,100	31,248.00	0.02
174	600170	上海建工	8,200	30,832.00	0.02
175	600489	中金黄金	3,000	30,810.00	0.02
176	601018	宁波港	7,000	30,730.00	0.02
177	600068	葛洲坝	4,900	30,527.00	0.02
178	002466	天齐锂业	1,200	30,336.00	0.02
179	002241	歌尔股份	3,400	30,226.00	0.02
180	002179	中航光电	900	30,114.00	0.02
181	300144	宋城演艺	1,300	30,082.00	0.02
182	600926	杭州银行	3,600	29,988.00	0.02
183	600362	江西铜业	1,900	29,906.00	0.02
184	603156	养元饮品	800	29,664.00	0.02
185	601997	贵阳银行	3,400	29,410.00	0.02
186	600015	华夏银行	3,800	29,260.00	0.02
187	600398	海澜之家	3,200	29,024.00	0.02
188	600085	同仁堂	1,000	29,000.00	0.02
189	300024	机器人	1,900	28,937.00	0.02
190	002081	金螳螂	2,800	28,868.00	0.02
191	000630	铜陵有色	11,700	28,782.00	0.02
192	601198	东兴证券	2,400	28,512.00	0.02
193	600219	南山铝业	12,600	28,476.00	0.02

194	002602	世纪华通	2,600	28,392.00	0.02
195	600482	中国动力	1,200	28,344.00	0.02
196	601838	成都银行	3,200	28,256.00	0.02
197	601881	中国银河	2,300	28,175.00	0.02
198	002146	荣盛发展	3,000	28,170.00	0.02
199	603160	汇顶科技	200	27,760.00	0.02
200	000961	中南建设	3,200	27,712.00	0.02
201	002739	万达电影	1,500	27,660.00	0.02
202	600674	XD 川投能	3,100	27,590.00	0.02
203	000703	恒逸石化	2,000	27,320.00	0.02
204	000786	北新建材	1,500	27,195.00	0.02
205	002456	欧菲光	3,400	26,656.00	0.02
206	002493	荣盛石化	2,200	26,532.00	0.02
207	300070	碧水源	3,400	26,486.00	0.02
208	600535	天士力	1,600	26,480.00	0.02
209	002050	三花智控	2,500	26,375.00	0.02
210	603986	兆易创新	300	26,010.00	0.02
211	000629	攀钢钒钛	7,600	25,764.00	0.02
212	002555	三七互娱	1,900	25,745.00	0.02
213	600297	广汇汽车	5,700	25,422.00	0.02
214	603799	华友钴业	1,160	24,719.60	0.02
215	600369	西南证券	5,000	24,700.00	0.02
216	601992	金隅集团	6,500	24,440.00	0.02
217	002508	老板电器	900	24,426.00	0.02
218	600346	恒力石化	2,000	24,320.00	0.02
219	300296	利亚德	3,100	24,273.00	0.02
220	600208	新湖中宝	7,600	23,864.00	0.02
221	000596	古井贡酒	200	23,702.00	0.02
222	600663	陆家嘴	1,500	23,250.00	0.02
223	002624	完美世界	900	23,229.00	0.02
224	600760	中航沈飞	800	23,224.00	0.02
225	002065	东华软件	3,300	23,067.00	0.02
226	000656	金科股份	3,800	22,914.00	0.02
227	002032	苏泊尔	300	22,749.00	0.02
228	600118	中国卫星	1,000	22,550.00	0.02
229	000625	长安汽车	3,400	22,542.00	0.02
230	601117	中国化学	3,700	22,274.00	0.01
231	600153	建发股份	2,500	22,200.00	0.01
232	000709	河钢股份	7,400	22,126.00	0.01
233	000627	天茂集团	3,400	22,066.00	0.01
234	002153	石基信息	600	21,714.00	0.01
235	603833	欧派家居	200	21,524.00	0.01

236	601878	浙商证券	2,300	21,390.00	0.01
237	600583	海油工程	3,800	21,280.00	0.01
238	603858	步长制药	800	20,616.00	0.01
239	600038	中直股份	500	20,510.00	0.01
240	600977	中国电影	1,300	20,358.00	0.01
241	002558	巨人网络	1,100	19,987.00	0.01
242	600415	小商品城	4,800	19,776.00	0.01
243	600688	上海石化	3,800	19,608.00	0.01
244	601216	君正集团	5,900	19,411.00	0.01
245	000671	阳光城	2,900	18,792.00	0.01
246	601238	广汽集团	1,700	18,581.00	0.01
247	002252	上海莱士	2,600	18,070.00	0.01
248	600566	济川药业	600	18,066.00	0.01
249	601633	长城汽车	2,100	17,367.00	0.01
250	002010	传化智联	2,300	17,319.00	0.01
251	000402	金融街	2,200	17,248.00	0.01
252	002310	东方园林	2,800	16,800.00	0.01
253	300413	芒果超媒	400	16,420.00	0.01
254	002601	龙鳞佰利	1,100	16,313.00	0.01
255	600188	兖州煤业	1,500	16,305.00	0.01
256	600704	物产中大	3,000	16,260.00	0.01
257	000898	鞍钢股份	4,160	15,766.40	0.01
258	002294	信立泰	700	15,666.00	0.01
259	002120	韵达股份	500	15,410.00	0.01
260	601898	中煤能源	3,200	15,360.00	0.01
261	601360	三六零	700	14,966.00	0.01
262	002468	申通快递	600	14,964.00	0.01
263	002411	延安必康	800	13,920.00	0.01
264	000938	紫光股份	500	13,625.00	0.01
265	601228	广州港	3,200	13,376.00	0.01
266	600372	中航电子	900	13,356.00	0.01
267	002773	康弘药业	400	13,168.00	0.01
268	600025	华能水电	3,200	13,024.00	0.01
269	600339	中油工程	3,000	12,660.00	0.01
270	000415	渤海租赁	3,200	12,544.00	0.01
271	600998	九州通	1,000	12,360.00	0.01
272	002938	鹏鼎控股	400	11,744.00	0.01
273	300251	光线传媒	1,500	10,200.00	0.01
274	002939	长城证券	600	10,014.00	0.01
275	300433	蓝思科技	1,400	9,758.00	0.01
276	601162	天风证券	900	9,756.00	0.01
277	601808	中海油服	1,000	9,630.00	0.01

278	603260	合盛硅业	200	9,412.00	0.01
279	000408	藏格控股	1,100	9,097.00	0.01
280	600233	圆通速递	700	8,631.00	0.01
281	000553	安道麦 A	800	8,576.00	0.01
282	601828	美凯龙	700	8,505.00	0.01
283	002925	盈趣科技	200	7,802.00	0.01
284	002625	光启技术	800	7,432.00	0.00
285	601298	青岛港	800	6,712.00	0.00
286	601212	白银有色	1,500	6,585.00	0.00
287	600733	北汽蓝谷	700	5,782.00	0.00
288	601577	长沙银行	600	5,724.00	0.00
289	600299	安迪苏	500	5,185.00	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	601318	中国平安	14,726,168.50	148.15
2	600519	贵州茅台	7,911,961.55	79.60
3	601288	农业银行	5,209,590.00	52.41
4	601328	交通银行	3,932,107.00	39.56
5	601166	兴业银行	3,318,162.00	33.38
6	600276	恒瑞医药	3,136,363.07	31.55
7	600887	伊利股份	3,040,973.00	30.59
8	600030	中信证券	2,855,876.00	28.73
9	600016	民生银行	2,679,820.00	26.96
10	000001	平安银行	2,396,398.17	24.11
11	601601	中国太保	2,283,218.00	22.97
12	600000	浦发银行	2,155,530.00	21.69
13	601398	工商银行	2,054,699.00	20.67
14	601939	建设银行	1,901,315.00	19.13
15	601668	中国建筑	1,881,920.00	18.93
16	600837	海通证券	1,773,023.00	17.84
17	600048	保利地产	1,452,358.00	14.61
18	601211	国泰君安	1,378,895.00	13.87
19	002142	宁波银行	1,361,829.91	13.70
20	600104	上汽集团	1,361,088.00	13.69
21	601688	华泰证券	1,292,047.00	13.00
22	601888	中国国旅	1,269,876.00	12.78
23	600585	海螺水泥	1,228,901.00	12.36
24	601766	中国中车	1,203,247.00	12.11
25	600031	三一重工	1,203,171.00	12.10

26	601818	光大银行	1,113,891.00	11.21
27	601186	中国铁建	1,106,469.00	11.13
28	600028	中国石化	1,096,248.00	11.03
29	601628	中国人寿	1,070,876.88	10.77
30	601229	上海银行	1,051,130.00	10.57
31	600309	万华化学	1,020,606.00	10.27
32	601088	中国神华	1,014,673.00	10.21
33	600690	海尔智家	934,330.00	9.40
34	600019	宝钢股份	888,422.00	8.94
35	600050	中国联通	879,921.00	8.85
36	601857	中国石油	869,509.00	8.75
37	600340	华夏幸福	851,093.00	8.56
38	601989	中国重工	751,741.00	7.56
39	601390	中国中铁	745,848.00	7.50
40	000651	格力电器	645,079.00	6.49
41	601336	新华保险	628,213.00	6.32
42	601111	中国国航	488,864.00	4.92
43	000858	五粮液	478,546.00	4.81
44	000333	美的集团	476,105.00	4.79
45	603993	洛阳钼业	435,495.00	4.38
46	600703	三安光电	421,275.00	4.24
47	600029	南方航空	417,513.00	4.20
48	600196	复星医药	380,568.00	3.83
49	601800	中国交建	354,102.00	3.56
50	300498	温氏股份	300,299.09	3.02
51	000002	万科A	283,925.00	2.86
52	601138	工业富联	237,219.00	2.39
53	600900	长江电力	236,170.00	2.38
54	002415	海康威视	236,030.00	2.37
55	601988	中国银行	216,362.00	2.18

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	601939	建设银行	557,831.14	5.61
2	600016	民生银行	473,378.00	4.76
3	601398	工商银行	466,985.00	4.70
4	601800	中国交建	351,000.00	3.53
5	000001	平安银行	300,322.00	3.02
6	601818	光大银行	233,172.00	2.35
7	601288	农业银行	175,551.00	1.77

8	601318	中国平安	76,329.00	0.77
9	601229	上海银行	68,622.00	0.69
10	601601	中国太保	62,201.00	0.63
11	601211	国泰君安	57,536.00	0.58
12	002142	宁波银行	57,475.00	0.58
13	000858	五粮液	57,456.00	0.58
14	002714	牧原股份	51,638.00	0.52
15	000932	华菱钢铁	50,884.00	0.51
16	002304	洋河股份	48,910.00	0.49
17	000063	中兴通讯	48,895.00	0.49
18	600031	三一重工	45,290.00	0.46
19	300498	温氏股份	44,556.00	0.45
20	002508	老板电器	43,438.00	0.44

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	104,041,793.05
卖出股票收入（成交）总额	5,053,354.04

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	4,404,400.00	2.95
	其中：政策性金融债	4,404,400.00	2.95
4	企业债券	402,400.00	0.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,806,800.00	3.22

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	108901	农发 1801	44,000	4,404,400.00	2.95
2	136448	16 万达 03	4,000	402,400.00	0.27

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

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF1907	IF1907	-20	-22,830,000.00	4,020.00	-
IH1907	IH1907	-85	-74,281,500.00	187,140.00	-
公允价值变动总额合计(元)					191,160.00
股指期货投资本期收益(元)					15,894.17
股指期货投资本期公允价值变动(元)					191,160.00

注:1、股指期货投资主要是用于套期保值,有利于对冲大盘风险,降低组合亏损;

2、该部分投资符合既定的投资政策以及投资目标;

3、买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示,单位为手;

4、股指期货投资本期收益抵扣了增值税。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

现阶段本基金主要使用股指期货对冲市场系统性风险。基金经理根据对冲比率、期现市场相关性等因素,计算需要对冲的股指期货合约手数,并对风险敞口进行实时跟踪与动态调整。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行（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。

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件，未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试，不具备任职资格”的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于 2018 年 10 月 25 日前整改，健全基金托管业务内部控制制度，加强从业人员管理，并于 2018 年 10 月 25 日前提交整改报告。

兴业银行股份有限公司于 2018 年 8 月 21 日因违规经营被深圳市消委会监管（约见）谈话，责令改正。

兴业银行股份有限公司于 2018 年 9 月 12 日因违规经营被上海证监局责令整改。

兴业银行股份有限公司于 2019 年 3 月 31 日因未依法履行职责被鼓东市场监管局罚款（鼓市场监管字[2018]108 号）。

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	9,712,636.53
2	应收证券清算款	51,182.01
3	应收股利	-
4	应收利息	87,358.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,851,177.52

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		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 (%)
1,164	129,964.46	73,861,257.73	48.82	77,417,370.59	51.18

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	254,724.05	0.1684

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基金总 份 额 比 例 (%)	发起份 额 总 数	发起份 额 占 基 金 总 份 额 比 例 (%)	发起份 额 承 诺 持 有 期 限
基金管理人固有资 金	10,000,000.00	6.61	10,000,000.00	6.61	3年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	6.61	10,000,000.00	6.61	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日） 基金份额总额	10,298,649.48
本报告期期初基金份额总额	10,067,809.27
本报告期基金总申购份额	141,218,329.57
减：本报告期基金总赎回份额	7,510.52
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	151,278,628.32

§ 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

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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	
安信证券	2	109,094,031.09	100.00%	33,960.71	100.00%	-

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
安信证券	1,000,100.00	100.00%	422,500,000.00	100.00%	-	-

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	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2018年第2号）	上海证券报	2019-01-18
2	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	上海证券报	2019-01-19
3	安信基金管理有限责任公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司和北京钱景基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2019-01-30
4	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-02-28
5	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

6	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2019-03-07
7	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告摘要	上海证券报	2019-03-29
8	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
9	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
10	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报	2019-04-22
11	2019 年度安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报	2019-05-08
12	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	2019-05-13
13	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
14	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
15	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
16	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2019-06-11
17	关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金参加安信基金管理有限责任公司直销柜台费率优惠活动的公告	上海证券报	2019-06-12
18	关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增山西证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报	2019-06-14
19	关于暂停安信稳健阿尔法定期开放混	上海证券报	2019-06-19

	合型发起式证券投资基金大额申购、大额转换转入业务的公告		
20	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金和安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增东莞证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报	2019-06-20
21	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
22	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
23	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190101-20190617	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	6.61
	2	20190617;20190619-20190630	-	37,282,535.14	-	37,282,535.14	24.64
	3	20190618	-	20,297,371.36	-	20,297,371.36	13.42
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。

§ 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稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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