

安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：广发银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 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	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	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	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金	
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	43,052,029.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信鑫发优选混合 A	安信鑫发优选混合 C
下属分级基金的交易代码	000433	012891
报告期末下属分级基金的份额总额	38,806,387.70 份	4,245,641.52 份

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	孙晓奇
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	4008308003
传真	0755-82799292	010-65169555
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	广东省广州市越秀区东风东路 713 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	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦

	层	
邮政编码	518026	100053
法定代表人	刘入领	王凯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	安信鑫发优选混合 A	安信鑫发优选混合 C
本期已实现收益	-20,240,713.82	-3,128,919.55
本期利润	-18,132,524.53	-2,836,767.35
加权平均基金份额本期利润	-0.3850	-0.4356
本期加权平均净值利润率	-15.91%	-17.96%
本期基金份额净值增长率	-11.84%	-12.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	44,582,723.85	4,840,729.37
期末可供分配基金份额利润	1.1489	1.1402
期末基金资产净值	92,636,212.94	10,096,395.88
期末基金份额净值	2.3871	2.3781
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	138.71%	12.71%

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

除相关费用和信用减值损失后的余额，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

安信鑫发优选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.40%	0.92%	0.37%	0.01%	4.03%	0.91%
过去三个月	2.01%	1.12%	1.12%	0.01%	0.89%	1.11%
过去六个月	-11.84%	1.03%	2.23%	0.01%	-14.07%	1.02%
过去一年	12.18%	1.16%	4.50%	0.01%	7.68%	1.15%
过去三年	99.09%	1.22%	13.51%	0.01%	85.58%	1.21%
自基金合同生效起至今	138.71%	1.29%	40.36%	0.01%	98.35%	1.28%

安信鑫发优选混合 C

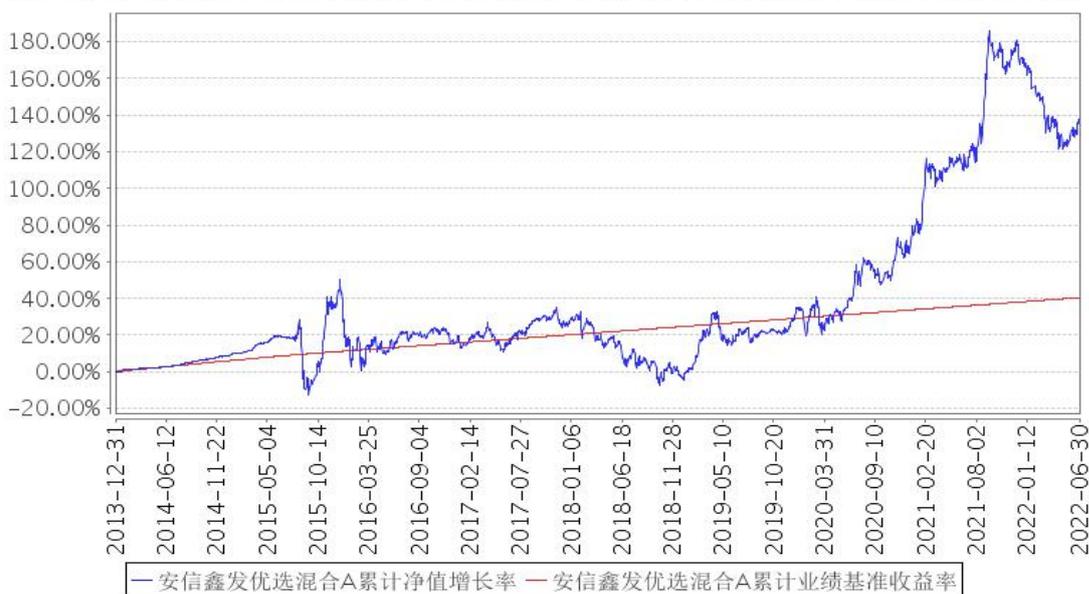
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.37%	0.92%	0.37%	0.01%	4.00%	0.91%
过去三个月	1.91%	1.12%	1.12%	0.01%	0.79%	1.11%
过去六个月	-12.01%	1.03%	2.23%	0.02%	-14.24%	1.01%

自基金合同生效起 至今	12.71%	1.15%	4.49%	0.01%	8.22%	1.14%
----------------	--------	-------	-------	-------	-------	-------

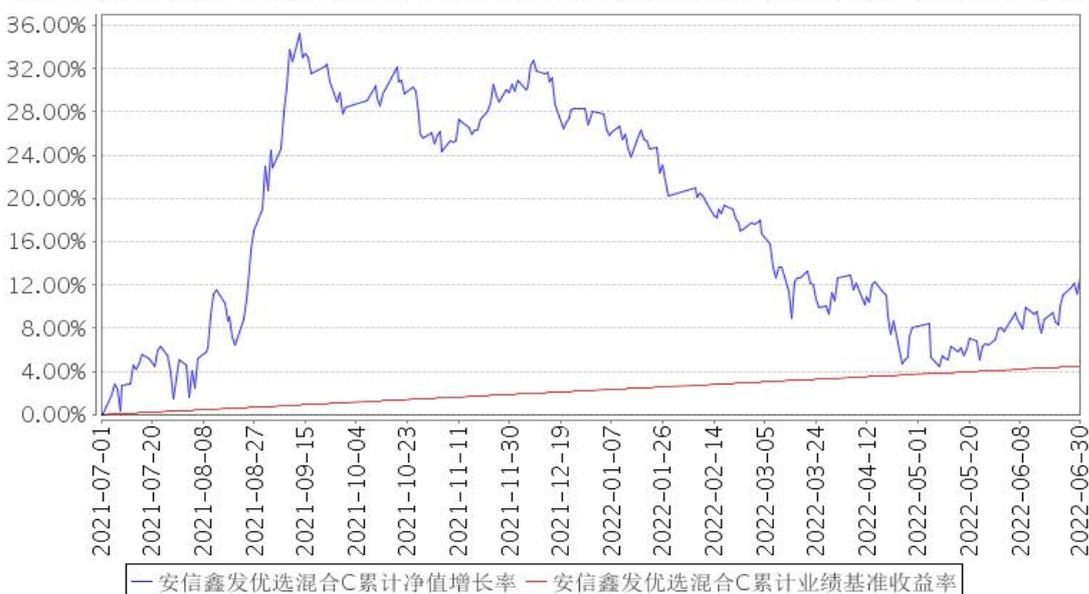
注：根据《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

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



安信鑫发优选混合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、根据基金管理人 2021 年 7 月 1 日《关于安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2021 年 7 月 1 日起，本基金增加 C 类份额。

§ 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 81 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型证券投资基金（原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（原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）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金。

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		
黎志军	本基金的基金经理	2021 年 11 月 12 日	-	7 年	黎志军先生，哲学博士。曾任上海璞盈投资管理有限公司投研部研究总监，安信基金有限责任管理公司研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任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的基金经理助理，安信鑫发优选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”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。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不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

今年上半年我们经历了俄乌战争的爆发，经历了上海疫情的防控升级和对供应链的较大影响，经历了美联储在 3 月首次加息 25BP 后在 5 月份再次大幅加息 75BP，经历了美股的暴跌和美债收益率的飙涨，这些极端事件对市场的影响从激化到缓和，造就了 A 股市场从暴跌到大涨的“V”形反弹。

相应的，我们在组合构建方面做了调整，4 月底之前，我们的配置以防守为主，主要持有稳

增长低估值的行业和个股，如银行，地产，基建等，而在市场开始反弹之后，我们相应的增加了受益于汽车和消费刺激政策的汽车和新能源供应链的配置，增加了受益于疫情复苏的白酒板块的配置，同时增加了不太受疫情影响的军工、水电、医药、食品、上游资源和半导体设备行业的配置，这些行业是为数不多的中报业绩好的行业。行业配置上，从原来偏防守的配置，转向优选个股和行业的偏均衡的配置，个股集中度也做了一定程度的提升。

总体上，组合构建上我们注重回撤的控制，组合调整的原则就是回避景气度走弱和需求走弱的行业，增配逻辑顺畅，能够跟踪验证，估值性价比合适，有新的增量，景气度和产业趋势有望改善的行业（或者左侧可能出现底部拐点）的行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信鑫发优选混合 A 基金份额净值为 2.3871 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.84%；安信鑫发优选混合 C 基金份额净值为 2.3781 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.01%；同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的宏观环境，经济预计是弱复苏的状态，主要是受地产和消费复苏较慢的影响：地产行业的修复，我们预计是弱复苏的状态，近期的停供断贷事件对涉险房企的品牌是有影响的，保交房是重点，地产公司的投资拿地的意愿和能力较弱，居民收入端受疫情影响也有个恢复的过程，买房意愿受影响。而消费的复苏又受疫情间歇性加重的影响，消费场景和区域之间的人群流动也因此而受到影响。由于地产投资的快速下滑，疫情逐渐缓解后出口增速有可能放缓，而消费复苏相对缓慢。在经济弱复苏的背景下，流动性预计会相对宽松，市场仍然有机会，另外，我们预计稳增长的政策会持续推动经济改善，经济复苏是趋势，受疫情影响较大的行业，也能环比的修复。

落地到投资上，我们重点关注两个方向：（1）景气度好的行业仍是需要持续关注方向，但需注意交易拥挤的问题；（2）上半年受疫情影响较大，下半年景气度逐季修复，明年增速较快的行业，特别是最近大宗商品价格大幅度下跌后，中下游行业将较为受益，景气度出现底部拐点，这将是我们需要重点挖掘的方向。我们将通过密集的产业调研来找到这些行业，并通过行业内公司比较，找出最有投资价值的公司，结合估值性价比来做配置，力争做到选股兼具 alpha 和 beta。

我们继续坚持把把握产业趋势和景气度变化精选个股的策略，同时坚持分散化的原则，即使再看好的单一行业，也不进行过多的风险暴露。长期通过坚持从个股和行业的研究的阿尔法中不断获得超额回报。

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公司领导担任，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、固定收益研究部、风险管理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、研究部及固定收益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；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；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

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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法

律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何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合规守信、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方面进行了必要的监督，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 托管人对本中期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、投资组合报告 等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,399,338.81	12,896,533.40
结算备付金		2,069,330.39	2,431,136.99
存出保证金		453,622.33	283,607.08
交易性金融资产	6.4.7.2	87,803,277.93	147,100,804.05
其中：股票投资		82,376,386.29	147,100,804.05
基金投资		-	-
债券投资		5,426,891.64	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	12,000,000.00	21,700,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,276,849.38	984,072.84
应收股利		-	-
应收申购款		87,938.49	159,886.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-3,510.83
资产总计		115,090,357.33	185,552,529.73
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		10,602,564.47	1,720,674.72
应付赎回款		989,652.74	1,432,192.16
应付管理人报酬		84,322.99	163,058.59
应付托管费		16,864.60	32,611.70
应付销售服务费		3,337.15	10,141.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	661,006.56	1,180,748.39
负债合计		12,357,748.51	4,539,426.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	43,052,029.22	66,870,833.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	59,680,579.60	114,142,269.64
净资产合计		102,732,608.82	181,013,102.81
负债和净资产总计		115,090,357.33	185,552,529.73

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 43,052,029.22 份，其中安信鑫发优选混合 A 基金份额总额 38,806,387.70 份，基金份额净值 2.3871 元；安信鑫发优选混合 C 基金份额总额 4,245,641.52 份，基金份额净值 2.3781 元。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-20,067,299.25	4,137,196.32
1. 利息收入		273,631.51	298,168.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	58,318.55	148,123.33
债券利息收入		-	150,045.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		215,312.96	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,877,340.00	6,754,234.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-23,906,388.82	5,924,746.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	91,822.81	-22,429.13
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	937,226.01	851,917.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,400,341.49	-4,847,126.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	136,067.75	1,931,918.86
减：二、营业总支出		901,992.63	1,507,636.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	649,711.39	637,074.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	129,942.23	127,414.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	31,834.95	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出			-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18		-	-
7. 税金及附加			-	0.02
8. 其他费用	6.4.7.19		90,504.06	743,147.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			-20,969,291.88	2,629,559.62
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			-20,969,291.88	2,629,559.62
五、其他综合收益的税后净额			-	-
六、综合收益总额			-20,969,291.88	2,629,559.62

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	66,870,833.17	-	114,142,269.64	181,013,102.81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	66,870,833.17	-	114,142,269.64	181,013,102.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,818,803.95	-	-54,461,690.04	-78,280,493.99
（一）、综合收益总额	-	-	-20,969,291.88	-20,969,291.88
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-23,818,803.95	-	-33,492,398.16	-57,311,202.11

号填列)				
其中：1. 基金申购款	8,865,875.01	-	13,188,426.93	22,054,301.94
2. 基金赎回款	-32,684,678.96	-	-46,680,825.09	-79,365,504.05
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	43,052,029.22	-	59,680,579.60	102,732,608.82
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	9,211,881.51	-	6,062,603.79	15,274,485.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	9,211,881.51	-	6,062,603.79	15,274,485.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	46,915,542.29	-	57,250,824.76	104,166,367.05
(一)、综合收益总额	-	-	2,629,559.62	2,629,559.62
(二)、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)	46,915,542.29	-	54,621,265.14	101,536,807.43
其中：1. 基金申购款	194,509,666.21	-	216,268,747.88	410,778,414.09
2. 基金赎回款	-147,594,123.92	-	-161,647,482.74	-309,241,606.66
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	56,127,423.80	-	63,313,428.55	119,440,852.35

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：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</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

6.4 报表附注

6.4.1 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。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，基金合同生效日的基金份额总额为 550,793,391.48 份，其中认购资金利息折合 129,002.71 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。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2021 年 7 月 1 日发布的《关于安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新的《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，经本基金管理人与基金托管人广发银行股份有限公司协商一致，本基金自 2021 年 7 月 1 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取

申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，分别计算基金份额净值。

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。本基金的资产投资比例为：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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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%。

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、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集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 3 号《半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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,896,533.40 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,907.23 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,902,440.63 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,431,136.99 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,203.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列

示的账面价值为人民币 2,432,340.39 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 283,607.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 140.36 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 283,747.44 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,700,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-10,761.82 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,689,238.18 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-3,510.83 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 5,907.23 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,203.40 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 140.36 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-10,761.82 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）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》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	11,399,338.81

等于：本金	11,398,699.99
加：应计利息	638.82
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,399,338.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	78,362,858.65	-	82,376,386.29	4,013,527.64	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,344,307.89	79,883.14	5,426,891.64	2,700.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,344,307.89	79,883.14	5,426,891.64	2,700.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	83,707,166.54	79,883.14	87,803,277.93	4,016,228.25	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,000,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	12,000,000.00	-

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	989.76
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	578,812.74
其中：交易所市场	578,812.74
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	12,396.69
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	661,006.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信鑫发优选混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,394,036.74	57,394,036.74
本期申购	7,368,161.07	7,368,161.07
本期赎回（以“-”号填列）	-25,955,810.11	-25,955,810.11
本期末	38,806,387.70	38,806,387.70

安信鑫发优选混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,476,796.43	9,476,796.43
本期申购	1,497,713.94	1,497,713.94
本期赎回（以“-”号填列）	-6,728,868.85	-6,728,868.85
本期末	4,245,641.52	4,245,641.52

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信鑫发优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	87,843,666.11	10,162,127.80	98,005,793.91
本期利润	-20,240,713.82	2,108,189.29	-18,132,524.53
本期基金份额交易产生的变动数	-23,020,228.44	-3,023,215.70	-26,043,444.14
其中：基金申购款	9,605,006.10	1,311,443.52	10,916,449.62
基金赎回款	-32,625,234.54	-4,334,659.22	-36,959,893.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,582,723.85	9,247,101.39	53,829,825.24

安信鑫发优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	14,460,146.83	1,676,328.90	16,136,475.73
本期利润	-3,128,919.55	292,152.20	-2,836,767.35
本期基金份额交易产生的变动数	-6,490,497.91	-958,456.11	-7,448,954.02
其中：基金申购款	2,000,509.84	271,467.47	2,271,977.31
基金赎回款	-8,491,007.75	-1,229,923.58	-9,720,931.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,840,729.37	1,010,024.99	5,850,754.36

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	25,090.39
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	29,357.09
其他	3,871.07
合计	58,318.55

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	866,233,044.05
减：卖出股票成本总额	887,895,495.24
减：交易费用	2,243,937.63

买卖股票差价收入	-23,906,388.82
----------	----------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	90,059.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,762.94
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	91,822.81

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,555,858.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,503,479.61
减：应计利息总额	50,603.84
减：交易费用	12.45
买卖债券差价收入	1,762.94

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	937,226.01
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	937,226.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,400,341.49
股票投资	2,397,640.88
债券投资	2,700.61
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	2,400,341.49

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	133,152.80
基金转换费收入	2,914.95
合计	136,067.75

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,600.00
合计	90,504.06

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

截至财务报表批准日，本基金无需披露的重大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（“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（“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（“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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	593,060,865.63	35.18	94,841,587.84	17.20

6.4.10.1.2 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。

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 2022年1月1日至2022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	430,345.48	35.01	266,458.18	46.04

关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	67,461.31	16.81	-	-

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	649,711.39	637,074.09
其中：支付销售机构的客户维护费	279,002.02	284,182.66

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	129,942.23	127,414.88

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

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	本期
-------------	----

方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信鑫发优选混合 A	安信鑫发优选混合 C	合计
安信基金	-	1,281.61	1,281.61
合计	-	1,281.61	1,281.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信鑫发优选混合 A	安信鑫发优选混合 C	合计
合计	-	-	-

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。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：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
广发银行	11,399,338.81	25,090.39	20,937,996.83	143,685.06

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	119	6,612.83	3,573.57	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	469	5,346.60	9,595.74	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	131	6,130.80	7,131.64	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	306	4,785.84	6,236.28	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	60	3,844.80	2,251.20	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	319	6,405.52	6,488.46	-

		日								
688163	赛伦生物	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股锁定	33.03	23.56	1,483	48,983.49	34,939.48	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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股票投资、债券投资等金融工具，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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：无）。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,426,891.64	-
合计	5,426,891.64	-

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。

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 2022 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	11,399,338.81	-	-	-	11,399,338.81
结算备付金	2,069,330.39	-	-	-	2,069,330.39
存出保证金	453,622.33	-	-	-	453,622.33
交易性金融资产	5,426,891.64	-	-	82,376,386.29	87,803,277.93
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00

应收申购款	-	-	-	87,938.49	87,938.49
应收清算款	-	-	-	1,276,849.38	1,276,849.38
资产总计	31,349,183.17	-	-	83,741,174.16	115,090,357.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	989,652.74	989,652.74
应付管理人报酬	-	-	-	84,322.99	84,322.99
应付托管费	-	-	-	16,864.60	16,864.60
应付清算款	-	-	-	10,602,564.47	10,602,564.47
应付销售服务费	-	-	-	3,337.15	3,337.15
其他负债	-	-	-	661,006.56	661,006.56
负债总计	-	-	-	12,357,748.51	12,357,748.51
利率敏感度缺口	31,349,183.17	-	-	71,383,425.65	102,732,608.82
上年度末 2021 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	12,896,533.40	-	-	-	12,896,533.40
结算备付金	2,431,136.99	-	-	-	2,431,136.99
存出保证金	283,607.08	-	-	-	283,607.08
交易性金融资产	-	-	-	147,100,804.05	147,100,804.05
买入返售金融资产	21,700,000.00	-	-	-	21,700,000.00
应收申购款	-	-	-	159,886.20	159,886.20
应收证券清算款	-	-	-	984,072.84	984,072.84
其他资产	-	-	-	-3,510.83	-3,510.83
资产总计	37,311,277.47	-	-	148,241,252.26	185,552,529.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,432,192.16	1,432,192.16
应付管理人报酬	-	-	-	163,058.59	163,058.59
应付托管费	-	-	-	32,611.70	32,611.70
应付证券清算款	-	-	-	1,720,674.72	1,720,674.72
应付销售服务费	-	-	-	10,141.36	10,141.36
其他负债	-	-	-	1,180,748.39	1,180,748.39
负债总计	-	-	-	4,539,426.92	4,539,426.92
利率敏感度缺口	37,311,277.47	-	-	143,701,825.34	181,013,102.81

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月	

			31 日)
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	4,438.75	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-4,431.50	-

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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	82,376,386.29	80.19	147,100,804.05	81.27
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	82,376,386.29	80.19	147,100,804.05	81.27

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	3,887,324.09	6,593,522.99
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,887,324.09	-6,593,522.99

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	82,306,169.92	146,451,763.61
第二层次	5,426,891.64	649,040.44
第三层次	70,216.37	-
合计	87,803,277.93	147,100,804.05

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属

第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

§ 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	82,376,386.29	71.58
	其中：股票	82,376,386.29	71.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,426,891.64	4.72
	其中：债券	5,426,891.64	4.72
	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	12,000,000.00	10.43
	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	13,468,669.20	11.70
8	其他各项资产	1,818,410.20	1.58
9	合计	115,090,357.33	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	1,070,325.00	1.04
C	制造业	51,920,056.91	50.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,991,212.88	5.83
E	建筑业	9,098,209.00	8.86
F	批发和零售业	3,244,242.40	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,016,064.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,131.64	0.01
J	金融业	5,446,390.00	5.30
K	房地产业	4,576,266.00	4.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,488.46	0.01
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	82,376,386.29	80.19

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	600025	华能水电	857,112	5,991,212.88	5.83
2	300750	宁德时代	10,700	5,713,800.00	5.56
3	600048	保利发展	262,100	4,576,266.00	4.45
4	300122	智飞生物	40,400	4,484,804.00	4.37
5	601838	成都银行	208,000	3,448,640.00	3.36
6	600521	华海药业	136,700	3,103,090.00	3.02
7	688082	盛美上海	32,354	3,066,188.58	2.98
8	601800	中国交建	328,300	3,046,624.00	2.97
9	603688	石英股份	20,350	2,698,613.50	2.63
10	600519	贵州茅台	1,200	2,454,000.00	2.39
11	600779	水井坊	24,542	2,271,116.68	2.21
12	002918	蒙娜丽莎	119,900	2,244,528.00	2.18
13	300737	科顺股份	165,000	2,174,700.00	2.12
14	002557	洽洽食品	38,100	2,169,033.00	2.11
15	603883	老百姓	62,730	2,125,292.40	2.07
16	603919	金徽酒	62,100	2,110,779.00	2.05
17	601636	旗滨集团	164,900	2,102,475.00	2.05
18	002371	北方华创	7,500	2,078,400.00	2.02
19	000090	天健集团	301,500	2,077,335.00	2.02
20	000999	华润三九	45,900	2,065,500.00	2.01
21	300775	三角防务	42,600	2,051,190.00	2.00
22	002966	苏州银行	327,500	1,997,750.00	1.94

23	601668	中国建筑	369,500	1,965,740.00	1.91
24	002340	格林美	213,100	1,939,210.00	1.89
25	600010	包钢股份	625,400	1,469,690.00	1.43
26	600702	舍得酒业	6,100	1,244,339.00	1.21
27	601012	隆基绿能	17,900	1,192,677.00	1.16
28	600546	山煤国际	57,500	1,118,950.00	1.09
29	688187	时代电气	16,505	1,072,659.95	1.04
30	601001	晋控煤业	60,300	1,070,325.00	1.04
31	600765	中航重机	32,800	1,055,504.00	1.03
32	603290	斯达半导	2,700	1,041,930.00	1.01
33	300593	新雷能	24,900	1,033,599.00	1.01
34	601872	招商轮船	176,400	1,016,064.00	0.99
35	002307	北新路桥	169,800	1,010,310.00	0.98
36	002941	新疆交建	64,400	998,200.00	0.97
37	002025	航天电器	14,000	977,480.00	0.95
38	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.04
39	688163	赛伦生物	1,483	34,939.48	0.03
40	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
41	301116	益客食品	469	9,595.74	0.01
42	301117	佳缘科技	131	7,131.64	0.01
43	301228	实朴检测	319	6,488.46	0.01
44	301158	德石股份	306	6,236.28	0.01
45	300834	星辉环材	119	3,573.57	0.00
46	301196	唯科科技	60	2,251.20	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	300750	宁德时代	16,402,304.75	9.06
2	600519	贵州茅台	12,449,552.00	6.88
3	000858	五粮液	11,420,772.41	6.31
4	000002	万科 A	10,431,209.80	5.76
5	603688	石英股份	10,107,866.00	5.58
6	600030	中信证券	9,414,310.55	5.20
7	601838	成都银行	8,647,601.00	4.78
8	000568	泸州老窖	8,095,585.29	4.47
9	603323	苏农银行	7,822,672.00	4.32
10	601166	兴业银行	7,806,586.00	4.31
11	601668	中国建筑	7,693,004.00	4.25
12	601012	隆基绿能	7,527,115.00	4.16

13	600809	山西汾酒	7,323,686.20	4.05
14	300122	智飞生物	7,160,419.00	3.96
15	002966	苏州银行	7,031,861.00	3.88
16	600702	舍得酒业	6,862,871.00	3.79
17	601800	中国交建	6,726,995.33	3.72
18	600048	保利发展	6,711,371.00	3.71
19	002557	洽洽食品	6,709,774.00	3.71
20	300373	扬杰科技	6,612,069.00	3.65
21	002371	北方华创	6,547,798.00	3.62
22	601088	中国神华	6,448,334.75	3.56
23	600779	水井坊	6,322,587.00	3.49
24	601688	华泰证券	6,317,288.00	3.49
25	002594	比亚迪	6,205,018.00	3.43
26	300144	宋城演艺	6,000,577.00	3.31
27	300902	国安达	5,827,808.00	3.22
28	600383	金地集团	5,430,733.00	3.00
29	600025	华能水电	5,381,486.92	2.97
30	688187	时代电气	5,288,024.76	2.92
31	000729	燕京啤酒	5,252,872.00	2.90
32	000792	盐湖股份	5,048,645.00	2.79
33	300073	当升科技	5,044,791.00	2.79
34	601857	中国石油	4,941,736.01	2.73
35	600521	华海药业	4,806,717.24	2.66
36	605111	新洁能	4,671,627.00	2.58
37	600089	特变电工	4,650,568.00	2.57
38	002466	天齐锂业	4,609,238.00	2.55
39	600600	青岛啤酒	4,608,351.63	2.55
40	300014	亿纬锂能	4,585,221.00	2.53
41	603856	东宏股份	4,553,881.00	2.52
42	000776	广发证券	4,541,088.00	2.51
43	300919	中伟股份	4,425,203.00	2.44
44	002245	蔚蓝锂芯	4,320,175.00	2.39
45	600754	锦江酒店	4,161,738.00	2.30
46	300274	阳光电源	4,159,113.10	2.30
47	601111	中国国航	4,123,504.00	2.28
48	000999	华润三九	4,096,709.00	2.26
49	002459	晶澳科技	4,077,953.00	2.25
50	601009	南京银行	3,912,416.00	2.16
51	600919	江苏银行	3,900,180.64	2.15
52	300666	江丰电子	3,876,446.24	2.14
53	001979	招商蛇口	3,823,938.00	2.11
54	000799	酒鬼酒	3,786,724.00	2.09

55	603919	金徽酒	3,783,167.00	2.09
56	000069	华侨城 A	3,767,302.00	2.08
57	002709	天赐材料	3,750,576.00	2.07
58	002850	科达利	3,745,529.00	2.07
59	603198	迎驾贡酒	3,639,810.00	2.01
60	301046	能辉科技	3,625,182.00	2.00

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	600383	金地集团	11,446,579.00	6.32
2	000858	五粮液	11,317,209.45	6.25
3	603688	石英股份	10,806,117.00	5.97
4	300902	国安达	10,559,772.00	5.83
5	000002	万科 A	10,320,726.81	5.70
6	300750	宁德时代	10,003,963.50	5.53
7	601688	华泰证券	9,867,441.52	5.45
8	600519	贵州茅台	9,654,749.00	5.33
9	600030	中信证券	9,046,972.11	5.00
10	000568	泸州老窖	7,887,860.60	4.36
11	603323	苏农银行	7,733,406.00	4.27
12	601166	兴业银行	7,693,479.00	4.25
13	603501	韦尔股份	7,473,399.36	4.13
14	600809	山西汾酒	7,080,236.00	3.91
15	300373	扬杰科技	7,069,524.00	3.91
16	002594	比亚迪	7,057,839.40	3.90
17	601012	隆基绿能	6,848,901.00	3.78
18	600741	华域汽车	6,745,105.00	3.73
19	600600	青岛啤酒	6,531,831.88	3.61
20	601088	中国神华	6,230,423.00	3.44
21	600018	上港集团	6,039,111.00	3.34
22	002557	洽洽食品	5,971,130.16	3.30
23	600702	舍得酒业	5,939,601.00	3.28
24	300666	江丰电子	5,777,292.00	3.19
25	601838	成都银行	5,772,565.00	3.19
26	300144	宋城演艺	5,710,390.00	3.15
27	001979	招商蛇口	5,297,725.43	2.93
28	300073	当升科技	5,213,853.00	2.88
29	600258	首旅酒店	5,185,979.00	2.86

30	603517	绝味食品	5,166,070.00	2.85
31	601668	中国建筑	5,109,273.00	2.82
32	000729	燕京啤酒	4,943,674.00	2.73
33	000333	美的集团	4,826,438.00	2.67
34	002966	苏州银行	4,783,136.20	2.64
35	300014	亿纬锂能	4,724,117.00	2.61
36	000792	盐湖股份	4,719,872.00	2.61
37	601857	中国石油	4,608,428.00	2.55
38	002245	蔚蓝锂芯	4,573,201.00	2.53
39	603856	东宏股份	4,559,950.00	2.52
40	000776	广发证券	4,538,133.00	2.51
41	600298	安琪酵母	4,515,099.00	2.49
42	600872	中炬高新	4,462,866.00	2.47
43	600089	特变电工	4,456,956.00	2.46
44	600048	保利发展	4,440,150.00	2.45
45	600172	黄河旋风	4,417,049.00	2.44
46	300919	中伟股份	4,395,103.72	2.43
47	002466	天齐锂业	4,314,737.00	2.38
48	601009	南京银行	4,258,100.00	2.35
49	600779	水井坊	4,245,561.80	2.35
50	688187	时代电气	4,215,336.26	2.33
51	600754	锦江酒店	4,192,985.00	2.32
52	605111	新洁能	4,091,934.00	2.26
53	000591	太阳能	4,084,445.00	2.26
54	002371	北方华创	4,056,068.00	2.24
55	600919	江苏银行	3,959,053.94	2.19
56	300274	阳光电源	3,931,661.00	2.17
57	000875	吉电股份	3,910,352.00	2.16
58	002459	晶澳科技	3,904,658.00	2.16
59	601111	中国国航	3,897,244.00	2.15
60	002850	科达利	3,858,025.58	2.13
61	601155	新城控股	3,823,544.00	2.11
62	601686	友发集团	3,731,194.00	2.06
63	603596	伯特利	3,688,606.00	2.04
64	002352	顺丰控股	3,656,987.00	2.02
65	002709	天赐材料	3,656,115.00	2.02
66	601800	中国交建	3,640,214.22	2.01

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	820,773,436.60
卖出股票收入（成交）总额	866,233,044.05

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	5,426,891.64	5.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
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	5,426,891.64	5.28

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	019664	21 国债 16	53,390	5,426,891.64	5.28

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 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。

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 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内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除中国交建（代码：601800 SH）外其他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。

1. 中国交通建设股份有限公司

2021 年 9 月-2022 年 6 月，中国交通建设股份有限公司因欠税、未依法履行职责被国家税务总局佛山市顺德区税务局大良税务分局通知整改。

2021 年 10 月 21 日，中国交通建设股份有限公司因未依法履行职责被广州南沙经济技术开发区建设和交通局警示。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	453,622.33
2	应收清算款	1,276,849.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	87,938.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,818,410.20
---	----	--------------

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 (%)
安信鑫发优选混合 A	15,946	2,433.61	56,265.65	0.14	38,750,122.05	99.86
安信鑫发优选混合 C	2,081	2,040.19	31,454.58	0.74	4,214,186.94	99.26
合计	17,824	2,415.40	87,720.23	0.20	42,964,308.99	99.80

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	安信鑫发优选混合 A	222,181.84	0.57
	安信鑫发优选混合 C	4,428.56	0.10
	合计	226,610.40	0.53

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信鑫发优选混合 A	0
	安信鑫发优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信鑫发优选混合 A	0~10
	安信鑫发优选混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信鑫发优选混合 A	安信鑫发优选混合 C
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	57,394,036.74	9,476,796.43
本报告期基金总申购份额	7,368,161.07	1,497,713.94
减：本报告期基金总赎回份额	25,955,810.11	6,728,868.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,806,387.70	4,245,641.52

§ 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

本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
海通证券	2	1,092,558,339.06	64.82	798,990.41	64.99	-
安信证券	2	593,060,865.63	35.18	430,345.48	35.01	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
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、交易部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 (%)
海通证券	-	-	1,716,800,000.00	75.95	-	-
安信证券	12,353,042.50	100.00	543,500,000.00	24.05	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

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	安信基金管理有限责任公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-01
2	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-21
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增国盛证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-26
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增众惠基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-02-16
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华宝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、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-03-30
6	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-03-31
7	安信基金管理有限责任公司关于对公司旗下 FOF 资产管理计划通过直销柜台办理旗下基金认购、申购、赎回及转换业务免收相关费用的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-15
8	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-04-21

§ 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、中国证监会核准安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信鑫发优选灵活配置混合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

2022年8月30日