

# 安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型 证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

## 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信合作创新混合
基金主代码	004393
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	172,909,483.91 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上，在本基金关注的领域内精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	资产配置上，本基金以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，结合定量分析的方法，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资上，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活投资于具有合作创新（Public-Private-Partnership，简称 PPP）主题相关领域的上市公司证券，通过合作创新（PPP）主题股票池的构建和个股精选，谋求基金资产的长期稳定增长。债券投资上，以企业债、公司债和可转债为主，并根据流动性管理的需要配置国债和货币市场工具。此外，本基金将投资于股指期货、权证、资产支持证券等，实现基金资产保值增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	王永民
	联系电话	0755-82509999	010-66594896
	电子邮箱	service@essencefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95566
传真		0755-82799292	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 03 月 29 日（基金合同生效日）-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	15,953,365.36	25,081,970.51
本期利润	-39,329,075.20	64,951,205.58
加权平均基金份额本期利润	-0.2179	0.2022
本期基金份额净值增长率	-18.52%	21.55%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0096	0.1019
期末基金资产净值	171,247,284.84	262,590,383.39
期末基金份额净值	0.9904	1.2155

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.05%	1.49%	-5.50%	0.95%	-4.55%	0.54%
过去六个月	-15.75%	1.35%	-5.63%	0.85%	-10.12%	0.50%
过去一年	-18.52%	1.22%	-10.52%	0.79%	-8.00%	0.43%
自基金合同生效起至今	-0.96%	1.03%	-1.91%	0.66%	0.95%	0.37%

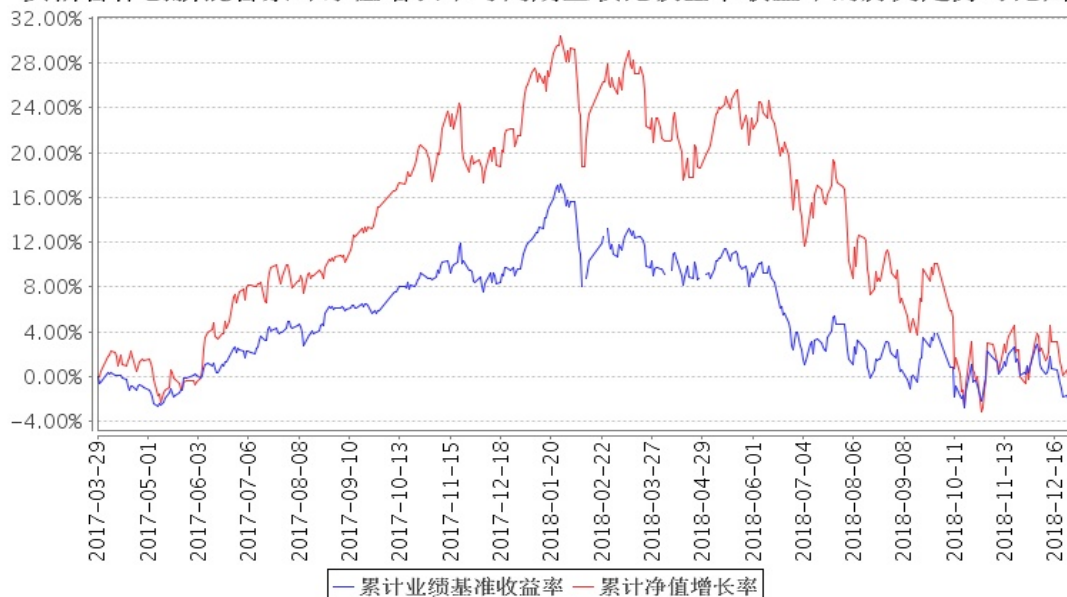
注：根据《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。其中沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、

流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。本基金选择该指数作为股票（不含港股通标的股票）投资部分的业绩比较基准。恒生 AH 指数系列包括同时以 A 股形式及 H 股形式上市，市值最大及成交最活跃的中国公司为成分股。其中，恒生 AH 股 H 指数用以量度成分股在 H 股市场的表现。本基金选择该指数作为港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基金。本基金选择该指数作为债券投资部分的业绩比较基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 40%、20%、40% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信合作创新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

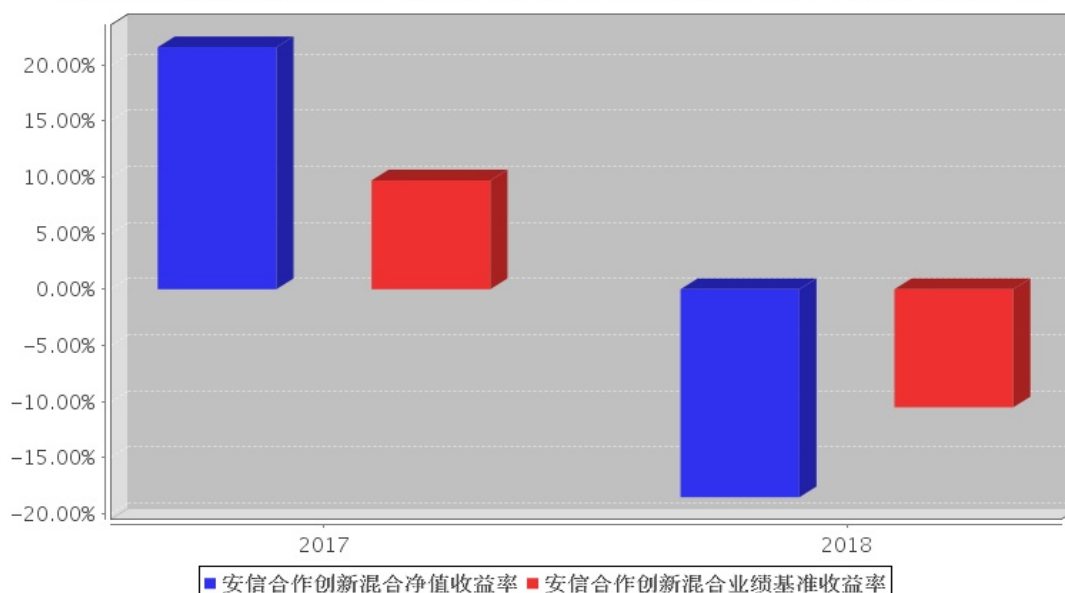


注:1、本基金合同生效日为 2017 年 03 月 29 日。

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

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信合作创新混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2017 年 03 月 29 日成立, 截至本报告期末尚未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2018 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 45 只开放式基金, 具体如下: 从 2012 年 6 月 20 日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金; 从 2012 年 9 月 25 日起管理安信目标收益债券型证券投资基金; 从 2012 年 12 月 18 日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金; 从 2013 年 2 月 5 日起管理安信现金管理货币市场基金; 从 2013 年 7 月 24 日起管理安信宝利债券型证券投资基金 (LOF) (原安信宝利分级债券型证券投资基金); 从 2013 年 11 月 8 日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金; 从 2013 年 12 月 31 日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金; 从 2014 年 4 月 21 日起管理安信价值精选股票型证券投资基

金；从 2014 年 11 月 24 日起管理安信现金增利货币市场基金；从 2015 年 3 月 19 日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从 2015 年 4 月 15 日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 14 日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从 2015 年 5 月 20 日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 25 日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 6 月 5 日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日至 2018 年 5 月 28 日管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日至 2018 年 9 月 26 日管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年 10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 6 月 11 日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 3 日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 20 日起管理安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 12 月 6 日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金；从 2017 年 12 月 28 日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 3 月 14 日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金；从 2018 年 3 月 21 日起管理安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金；从 2018 年 3 月 30 日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 6 月 1 日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 6 月 12 日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金；从 2018 年 6 月 21 日起管理安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金；从 2018 年 9 月 3 日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金；从 2018 年 9 月 26 日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金；从 2018 年 11 月 29 日起管理安信中证 500 指数增强型证券投资基金；从

2018 年 12 月 7 日起管理安信优享纯债债券型证券投资基金。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介**

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈一峰	本基金的基金经理，总经理助理兼研究总监	2017 年 3 月 29 日	-	10	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张明	本基金的基金经理	2017 年 5 月 5 日	-	7	张明先生，管理学硕士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员，2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、特定资产管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信中国制造 2025 港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
谭珏娜	本基金的	2017 年	-	12	谭珏娜女士，经济学学士。历任招



	基金经理	12 月 6 日			商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员，2013 年 4 月加入安信基金管理有限责任公司，历任运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理、研究部研究员，现任权益投资部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信中国制造 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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李巍	本基金的基金经理助理	2017 年 3 月 29 日	-	5	李巍先生，理学硕士。历任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员，富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，现任安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注:1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告(生效)日期填写;基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告(生效)日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合,未出现违反公平交易制度的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金一直坚持自下而上的投资选股思路,在充分研究公司商业模式,竞争优势,公司成长空间,行业竞争格局的背景下,结合估值水平,在“好价格”下买入并持有“好公司”,长期获得企业内在价值增长的收益。

本基金全年的运作总体与前述投资思路保持一致,始终在符合合作创新主题范围的公司中,

按照前述选股标准，筛选出便宜的好公司，我们相信长期投资这些优秀公司会给基金带来不错的收益，今年以来虽然市场指数出现大幅下跌，许多个股跌幅更大，但是我们始终相信我们关注的好公司的内在价值并没有出现这么大的贬损，长期来说，股票价格围绕公司价值波动，短期股票价格的下跌是我们能够以较低价格买到盈利较好资产的机会，我们认为在市场恐慌的时候应该保持理性，以 1 年的维度来看市场可能还是一个震荡筑底的态势，但站在 3 年的时间维度，市场上涨的概率明显大于下跌的概率，我们认为现在是一个很好的投资时点。

2018 年全年股票市场基本呈现单边下跌态势，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 指数下跌 33.32%，全部 A 股上市公司的跌幅中位数超过 30%。分行业来看，2018 年休闲服务、银行、食品饮料等行业跌幅较少，电子、传媒、有色等行业跌幅较大。截至 2018 年四季度末，全年产品收益率明显跑赢几大市场指数。

#### 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 0.9904 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.52%，同期业绩比较基准收益率为-10.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2018 年全年市场的下跌，总结可能有几方面原因，第一是国内经济自 2015-2017 年小周期复苏以后，2018 年存在内在放缓的压力，叠加中美贸易战持续发酵，引发市场对中国经济长期增长前景担忧。第二个原因可能是上半年执行的去杠杆政策导致上市公司股权质押问题频发。

我们认为市场指数的大幅下跌，体现当前市场情绪十分低迷，从 2018 年各项经济数据来看，尤其是发电量、工业增加值、汽车销量、商品房销售面积等数据表明整个经济放缓趋势比较明显，我们认为 2019 年上半年宏观经济依然存在继续走弱的可能。但与此同时，国家层面各种稳增长的政策也在陆续出台，包括减税降费，降准等利好政策，从近期央行的表态来看，货币政策也在转向适当宽松，我们认为对中国经济的长期前景不必过分担忧，市场层面来看，无论是从各大指数的估值角度，还是上市公司破净股的个数等方面，都可以看出市场指数已经处于历史低估的状态，与历史上几次底部区域的估值已经十分接近。

截至 2018 年四季度末，产品的股票持仓比例有所上升，如果未来市场继续下跌，我们会适时提高股票持仓比例，站在这个时间点我们选择提高仓位的主要理由是长期来说仓位与指数点位负相关能够获得较好的择时收益。长期看好的公司继续集中在家电、食品饮料、建材、轻工、新能源发电等细分行业的优秀公司。短期会关注一些低 PB（市净率），PB 一般不超过 3 倍，中高 ROE（净资产收益率），ROE 一般在 10%以上，当前股价从高点下来跌幅超过 50%，历史经营情况

稳定，杠杆不高的企业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》

及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

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

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	26,597,720.46	54,605,654.52
结算备付金	86,869.61	55,794.44
存出保证金	24,841.65	88,007.59
交易性金融资产	145,534,198.12	209,837,308.57
其中：股票投资	145,534,198.12	209,509,010.51
基金投资	-	-
债券投资	-	328,298.06
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,006.78	12,166.61
应收股利	-	-
应收申购款	-	844,766.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	172,249,636.62	265,443,698.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018年12月31日</b>	<b>2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	450,440.31	552.60
应付赎回款	-	2,201,992.32
应付管理人报酬	225,142.52	340,328.10
应付托管费	37,523.75	56,721.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	29,245.20	50,501.84
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,000.00	203,218.86
负债合计	1,002,351.78	2,853,315.09
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	172,909,483.91	216,033,897.55
未分配利润	-1,662,199.07	46,556,485.84
所有者权益合计	171,247,284.84	262,590,383.39
负债和所有者权益总计	172,249,636.62	265,443,698.48

注： 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值人民币 0.9904 元，基金份额总额 172,909,483.91 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年	2017 年 3 月 29 日（基金合

	12 月 31 日	同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-34,986,995.58	70,939,970.88
1. 利息收入	324,631.89	1,700,129.03
其中：存款利息收入	324,592.20	411,944.24
债券利息收入	39.69	168.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,288,016.79
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	19,578,156.01	27,470,536.15
其中：股票投资收益	15,917,644.34	20,885,544.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	67,693.07	215,653.72
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,592,818.60	6,369,337.65
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-55,282,440.56	39,869,235.07
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	392,657.08	1,900,070.63
减：二、费用	4,342,079.62	5,988,765.30
1. 管理人报酬	3,130,784.04	3,972,135.43
2. 托管费	521,797.30	662,022.55
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	305,489.20	1,065,236.15
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.11	-
7. 其他费用	384,008.97	289,371.17
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-39,329,075.20	64,951,205.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-39,329,075.20	64,951,205.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	216,033,897.55	46,556,485.84	262,590,383.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,329,075.20	-39,329,075.20
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）	-43,124,413.64	-8,889,609.71	-52,014,023.35
其中：1. 基金申购款	118,457,187.46	29,043,776.83	147,500,964.29
2. 基金赎回款	-161,581,601.10	-37,933,386.54	-199,514,987.64
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）	172,909,483.91	-1,662,199.07	171,247,284.84
项目	上年度可比期间 2017年3月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	530,344,288.39	-	530,344,288.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,951,205.58	64,951,205.58
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）	-314,310,390.84	-18,394,719.74	-332,705,110.58
其中：1. 基金申购款	210,942,059.11	26,851,865.19	237,793,924.30
2. 基金赎回款	-525,252,449.95	-45,246,584.93	-570,499,034.88
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）	216,033,897.55	46,556,485.84	262,590,383.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信合作创新主题沪港深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”）2016年10月21日下发的证监许可[2016]2403号文“关于准予准安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信合作创新主题沪港深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2017年2月27日至2017年3月24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 60962175\_H04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530,202,398.01元。经向中国证监会备案，《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月29日正式生效。截至2017年3月28日止，安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币530,202,398.01元，折合530,202,398.01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141,890.38元，折合141,890.38份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币530,344,288.39元，折合530,344,288.39份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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）、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券（包括国债、公司债、企业债、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、股指期货、权证等金融衍生工具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：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0%-95%）；本基金投资于合作创新主题相关证券的比例不低于本基金持有的非现金基金资产的80%；持有全部权证的市值不超过基金资

产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### 7.4.6.2 企业所得税

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

##### 7.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年3月29日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
安信证券	30,570,318.94	13.70	736,689,169.98	84.23

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
安信证券	21,744.70	13.69	3,248.93	11.11
关联方名称	上年度可比期间 2017年3月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
安信证券	524,006.68	84.22	40,981.29	81.15

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

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年3月29日（基金合
----	-----------------------	---------------------------

	12 月 31 日	同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,130,784.04	3,972,135.43
其中: 支付销售机构的客户维护费	781,257.99	1,385,010.91

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 1.50% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 29 日 (基金 合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	521,797.30	662,022.55

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

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017年3月29日（基金合同生效日）至 2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	26,597,720.46	322,729.06	54,605,654.52	369,487.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
601860	紫金 银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未 上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.10.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 145,484,052.32 元，划分为第二层级的余额为人民币 50,145.80 元，无划分为第三层级余额（于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 203,667,225.91 元，划分为第二层级的余额为人民币 6,170,082.66 元，无划分为第三层级余额）。

公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	145,534,198.12	84.49
	其中：股票	145,534,198.12	84.49

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,684,590.07	15.49
8	其他各项资产	30,848.43	0.02
9	合计	172,249,636.62	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,241,487.32	4.81
C	制造业	106,066,629.02	61.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	982,100.00	0.57
E	建筑业	5,560,920.00	3.25
F	批发和零售业	5,046,693.48	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	902,580.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	8,230,345.00	4.81
K	房地产业	3,618,351.00	2.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,295,400.00	0.76
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	4,212,744.00	2.46
S	综合	-	-
	合计	144,157,249.82	84.18

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------



非必需消费品	1,376,948.30	0.80
合计	1,376,948.30	0.80

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000786	北新建材	550,000	7,568,000.00	4.42
2	600352	浙江龙盛	694,100	6,698,065.00	3.91
3	601088	中国神华	360,467	6,473,987.32	3.78
4	002508	老板电器	315,389	6,367,703.91	3.72
5	600519	贵州茅台	10,553	6,226,375.53	3.64
6	600612	老凤祥	135,100	6,079,500.00	3.55
7	000651	格力电器	160,003	5,710,507.07	3.33
8	601668	中国建筑	975,600	5,560,920.00	3.25
9	600104	上汽集团	197,544	5,268,498.48	3.08
10	601222	林洋能源	895,200	4,332,768.00	2.53

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

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002508	老板电器	5,638,730.00	2.15
2	600612	老凤祥	4,693,696.00	1.79
3	601222	林洋能源	4,176,484.84	1.59
4	002035	华帝股份	4,164,589.39	1.59
5	600066	宇通客车	4,150,870.00	1.58
6	600048	保利地产	4,034,047.00	1.54
7	000726	鲁泰 A	3,492,286.00	1.33
8	600757	长江传媒	3,476,449.75	1.32
9	300296	利亚德	3,316,300.00	1.26
10	000786	北新建材	2,739,267.00	1.04
11	601939	建设银行	2,627,928.00	1.00
12	002367	康力电梯	2,598,944.10	0.99
13	603365	水星家纺	2,566,717.29	0.98
14	000501	鄂武商 A	2,548,005.94	0.97
15	600352	浙江龙盛	2,438,794.00	0.93
16	601668	中国建筑	2,394,514.20	0.91
17	000651	格力电器	2,292,859.00	0.87

18	600837	海通证券	2,285,068.00	0.87
19	600519	贵州茅台	2,187,172.00	0.83
20	600104	上汽集团	2,021,279.00	0.77

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600068	葛洲坝	6,801,733.73	2.59
2	600566	济川药业	6,737,372.00	2.57
3	000963	华东医药	6,520,477.90	2.48
4	000651	格力电器	6,126,840.52	2.33
5	000488	晨鸣纸业	5,894,958.36	2.24
6	002372	伟星新材	5,847,540.70	2.23
7	002563	森马服饰	5,099,195.10	1.94
8	601799	星宇股份	4,855,508.96	1.85
9	002310	东方园林	4,568,636.69	1.74
10	600487	亨通光电	3,653,191.00	1.39
11	002202	金风科技	3,529,725.00	1.34
12	601088	中国神华	3,403,708.00	1.30
13	600036	招商银行	3,397,792.00	1.29
14	600309	万华化学	3,104,230.00	1.18
15	002271	东方雨虹	2,990,723.00	1.14
16	000786	北新建材	2,692,733.32	1.03
17	002508	老板电器	2,512,494.00	0.96
18	300197	铁汉生态	2,325,506.99	0.89
19	002367	康力电梯	2,323,925.00	0.89
20	000910	大亚圣象	2,290,658.00	0.87

注:本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	100,961,277.52
卖出股票收入(成交)总额	125,571,293.69

注:“买入股票成本(成交)总额”、“卖出股票收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,841.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,006.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,848.43

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,310	52,238.51	48,019,569.72	27.77	124,889,914.19	72.23

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)

基金管理人所有从业人员持有本基金	924,768.46	0.5348
------------------	------------	--------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月29日）基金份额总额	530,344,288.39
本报告期期初基金份额总额	216,033,897.55
本报告期基金总申购份额	118,457,187.46
减：本报告期基金总赎回份额	161,581,601.10
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	172,909,483.91

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币60,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	110,761,482.97	49.65%	78,784.38	49.61%	-
招商证券	2	62,457,740.73	28.00%	44,529.95	28.04%	-
安信证券	2	30,570,318.94	13.70%	21,744.70	13.69%	-
渤海证券	1	19,306,255.55	8.65%	13,732.67	8.65%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
渤海证券	386,303.76	86.60%	-	-	-	-
招商证券	59,755.00	13.40%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20180327-20180418;20180424-20180425;20180508-20180529;20180706-20181231;	-	35,886,180.34	-	35,886,180.34	20.75
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(1) 基金在短期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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2019 年 03 月 29 日