

# 安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信动态策略混合	
基金主代码	001185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	258,400,925.21 份	
下属分级基金的基金简称:	安信动态策略 A	安信动态策略 C
下属分级基金的交易代码:	001185	002029
报告期末下属分级基金的份额总额	211,050,549.10 份	47,350,376.11 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	95528
传真	0755-82799292	021-63602540

## 2.4 信息披露方式

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	安信基金管理有限责任公司 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

## 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

基金级别	安信动态策略 A	安信动态策略 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,460,783.93	2,538,092.33
本期利润	4,167,310.82	-3,328,041.08
加权平均基金份额本期利润	0.0181	-0.0141
本期基金份额净值增长率	1.73%	1.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0555	0.0578
期末基金资产净值	223,792,705.35	50,160,805.55
期末基金份额净值	1.060	1.059

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

安信动态策略 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	0.19%	0.05%	0.35%	0.01%	-0.16%	0.04%
过去三个月	0.28%	0.05%	1.07%	0.01%	-0.79%	0.04%
过去六个月	1.73%	0.08%	2.17%	0.01%	-0.44%	0.07%
过去一年	3.92%	0.09%	4.58%	0.01%	-0.66%	0.08%
自基金合同生效起至今	6.00%	0.09%	5.75%	0.01%	0.25%	0.08%

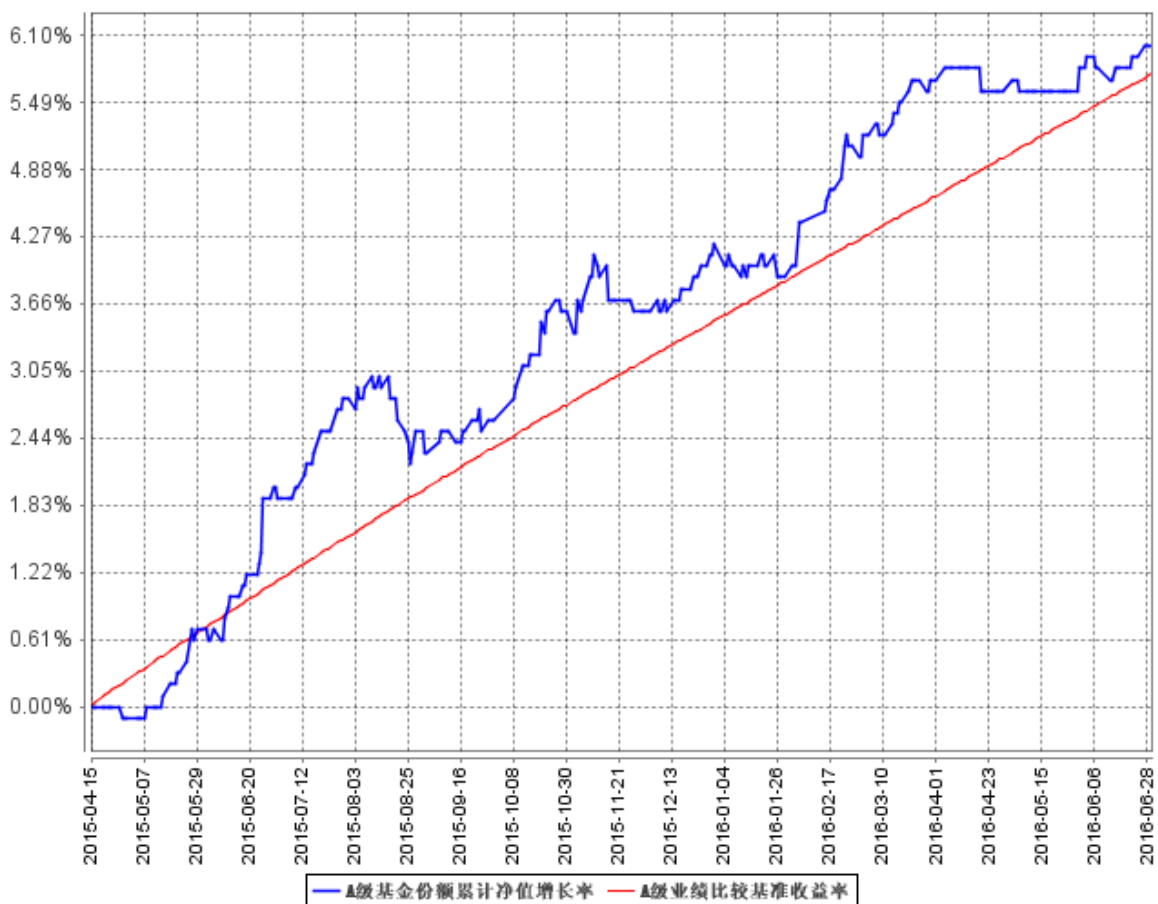
安信动态策略 C

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	0.19%	0.06%	0.36%	0.01%	-0.17%	0.05%
过去三个月	0.19%	0.06%	1.10%	0.01%	-0.91%	0.05%
过去六个月	1.73%	0.08%	2.23%	0.01%	-0.50%	0.07%
自基金合同生效起至今	2.12%	0.07%	2.79%	0.01%	-0.67%	0.06%

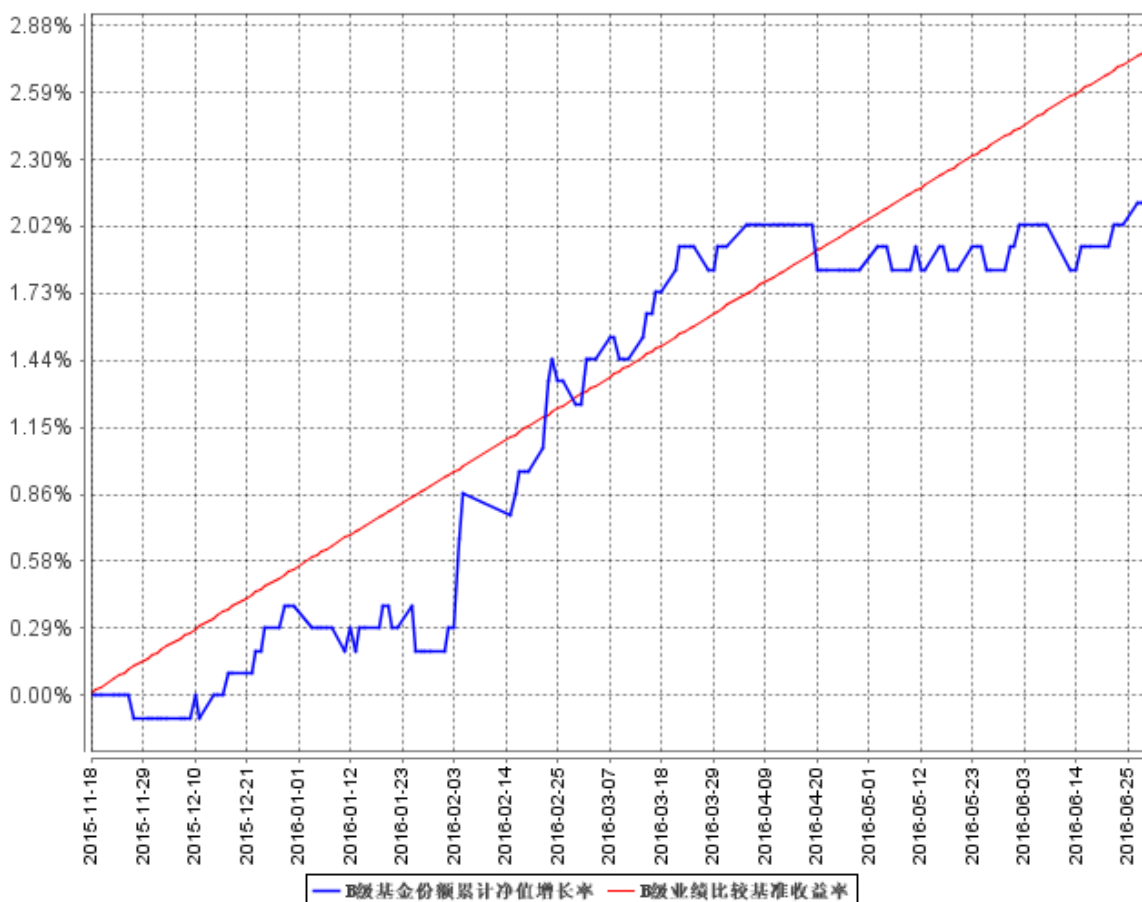
注：1、根据《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%

### 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

A级基金份额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



**B级基金份额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. 本基金的建仓期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 10 月 14 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2. 本基金合同生效日期为 2015 年 4 月 15 日。图示日期为 2015 年 4 月 15 日至 2016 年 6 月 30 日。

## § 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 3.5 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 38.72% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 19.71% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 8.57% 的股权。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 19 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 日起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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	9	蓝雁书先生，理学硕士。历任桂林理工大学（原桂林工学院）理学院教师，华西证券有限责任公司证券研究所研究员，安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长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的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015 年 7 月 10 日	-	6	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员、安信基金管理有限责任公司研究部研究员、安信基金管理有限责任公司投资部基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司投资部基金经理。现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新常态沪港深价值精选股票型证券投资基金的基金经理。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2016 年伊始，大幅贬值的人民币汇率引起投资者不安，加上不合理的交易制度安排，1 月份 A 股出现踩踏式下跌；进入 2 月份，经历大幅调整后的 A 股估值优势开始显现，同时经济基本面在需求端刺激下也开始有企稳回升迹象，加上美联储加息延后，A 股市场迎来难得的反弹；但进入二季度后，权威人士讲话扭转了之前市场对经济复苏的乐观预期，市场整体维持振荡走势。

期间，安信动态策略基金坚持绝对收益投资策略，以固定收益类投资策略为主，同时以较低权益仓位积极参与 A 股市场，获得了较好的投资收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在报告期内，安信动态策略 A 的收益率为 1.73%，安信动态策略 C 的收益率为 1.73%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济基本面方面，在权威人士讲话后，前期的热度已经逐渐被冷却，特别是房地产市场出现了销售放缓，但在“宽财政”下基建投资仍然可以支撑经济增长不至于失速，但需要关注水灾可能带来的冲击。在估值层面，继续通过利率下降提升估值水平的空间不大，而且在风险偏好方面还很容易被水灾或军事冲突改变，不利于估值水平提升；当然，国企改革试点全面铺开值得期待，如果地方国企改革推进力度超预期，不排除风险偏好上升。

因此，三季度 A 股市场大概率维持振荡走势。我们仍然将坚持较低权益仓位，同时以固定收益投资策略为主，力争为持有人争取较高的绝对收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责，运营部在日常估值管理中，必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定，及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施，建立并不断完善基金资产估值系统。另外，公司成立基金估值委员会，主任委员由公司总经理担任，成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成，投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

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，保证公司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。估值委员会采取临时会议的方式召开会议，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况时，运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过，并形成书面文件妥善保管。对于重大事项，应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上，再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下：运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

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。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

#### **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，本基金本报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照本基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### **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**

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形。

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由安信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	8,404,256.74	692,583,583.62
结算备付金	59,981.40	1,412,683.89
存出保证金	54,352.40	493,762.29
交易性金融资产	264,378,723.06	49,992,611.17
其中：股票投资	14,065,754.53	39,989,611.17
基金投资	-	-
债券投资	250,312,968.53	10,003,000.00
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	-	720,001,770.00
应收证券清算款	-	207,443,893.45
应收利息	3,391,433.44	1,147,106.17
应收股利	-	-
应收申购款	99,403.58	99.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	276,388,150.62	1,673,075,509.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年6月30日</b>	<b>2015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	-	3,521,493.89
应付赎回款	1,962,362.43	1,316,450.43
应付管理人报酬	207,970.71	1,988,121.66
应付托管费	41,594.15	397,624.35
应付销售服务费	4,105.16	353,052.58
应付交易费用	18,204.77	206,653.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,402.50	84,930.26
负债合计	2,434,639.72	7,868,327.00
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	258,400,925.21	1,598,716,618.70
未分配利润	15,552,585.69	66,490,564.29
所有者权益合计	273,953,510.90	1,665,207,182.99
负债和所有者权益总计	276,388,150.62	1,673,075,509.99

注：报告截止日为 2016 年 6 月 30 日，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.060 元，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.059 元；基金份额总额 258,400,925.21 份，其中安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 211,050,549.10 份，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 47,350,376.11 份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同 生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	4,468,721.05	218,906,614.92
1.利息收入	5,677,194.24	24,130,168.53
其中：存款利息收入	2,318,862.09	18,556,137.29
债券利息收入	1,789,041.53	511,688.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,569,290.62	5,062,342.82
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,911,093.65	192,681,605.95
其中：股票投资收益	3,031,131.67	192,416,868.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,770,973.02	-
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	108,988.96	264,737.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,159,606.52	1,381,497.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	40,039.68	713,343.32
<b>减：二、费用</b>	3,629,451.31	21,840,869.52
1. 管理人报酬	2,413,204.63	15,682,816.29
2. 托管费	482,640.91	3,136,563.23
3. 销售服务费	241,610.94	-
4. 交易费用	161,629.08	2,588,775.09
5. 利息支出	94,532.34	354,650.22
其中：卖出回购金融资产支出	94,532.34	354,650.22
6. 其他费用	235,833.41	78,064.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	839,269.74	197,065,745.40
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	839,269.74	197,065,745.40

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,598,716,618.70	66,490,564.29	1,665,207,182.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	839,269.74	839,269.74
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）	-1,340,315,693.49	-51,777,248.34	-1,392,092,941.83
其中：1.基金申购款	48,052,245.94	2,691,225.76	50,743,471.70
2.基金赎回款	-1,388,367,939.43	-54,468,474.10	-1,442,836,413.53
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）	258,400,925.21	15,552,585.69	273,953,510.90
项目	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015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）	613,282,800.57	-	613,282,800.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	197,065,745.40	197,065,745.40
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）	10,618,495,892.68	27,794,774.10	10,646,290,666.78
其中：1.基金申购款	10,786,641,875.39	28,995,375.51	10,815,637,250.90
2.基金赎回款	-168,145,982.71	-1,200,601.41	-169,346,584.12
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)	11, 231, 778, 693. 25	224, 860, 519. 50	11, 456, 639, 212. 75

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>尚尔航</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

安信动态策略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”)2015年3月25日下发的证监许可[2015]442号文“关于核准安信动态策略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《安信动态策略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,首次募集期间为2015年4月8日至2015年4月10日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集613,229,558.27元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(201)验字第60962175\_H24号验资报告。经向中国证监会备案,《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为613,282,800.57份基金份额,其中认购资金利息折合53,242.30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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、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资产(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基



准为：中国人民银行公布的金融机构 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

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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。

### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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，免征营业税。

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。

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。

### 6.4.6.3 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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：1、本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2、本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。

3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

##### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日） 至 2015 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	2,413,204.63	15,682,816.29
其中：支付销售机构的客户维护费	291,617.96	495,990.08

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	482,640.91	3,136,563.23

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信动态策略 A	安信动态策略 C	合计
安信基金管理有限责任公司	-	241,615.63	241,615.63
合计	-	241,615.63	241,615.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信动态策略 A	安信动态策略 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 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

份额单位：份

安信动态策略 A				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
安信乾宏投资有 限公司	49,999,000.00	23.6905%	49,999,000.00	20.1925%

份额单位：份

安信动态策略 C				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
安信乾宏投资有 限公司	47,348,484.85	99.9960%	-	-

#### 6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 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
上海浦东发展银行 股份有限公司	8,404,256.74	1,093,342.64	1,023,033,076.58	9,727,624.71

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金与浦发银行的协议存款按照协议约定的利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016 年 6 月 15 日	2016 年 7 月 1 日	新债未上市	99.99	99.99	3,590	358,968.53	358,968.53	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	6,806	23,616.82	142,381.52	-

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金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为 0 元，无质押债券。

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金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为 0 元，无质押债券。

## § 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	14,065,754.53	5.09
	其中：股票	14,065,754.53	5.09
2	固定收益投资	250,312,968.53	90.57
	其中：债券	250,312,968.53	90.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,464,238.14	3.06
7	其他各项资产	3,545,189.42	1.28
8	合计	276,388,150.62	100.00

### 7.2 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	-	-
C	制造业	4,667,446.41	1.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,882,096.24	2.51
E	建筑业	1,149,241.52	0.42
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,346,844.26	0.49
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	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	14,065,754.53	5.13

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港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	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	312,046	3,897,454.54	1.42
2	601985	中国核电	436,990	2,984,641.70	1.09
3	002007	华兰生物	52,320	1,642,848.00	0.60
4	600548	深高速	172,894	1,346,844.26	0.49
5	600068	XD 葛洲坝	173,000	1,006,860.00	0.37
6	300137	先河环保	58,000	857,820.00	0.31
7	600885	宏发股份	25,500	783,105.00	0.29
8	600271	航天信息	31,500	749,700.00	0.27
9	000513	丽珠集团	7,900	364,269.00	0.13
10	603737	三棵树	1,274	147,885.92	0.05

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公司网站 <http://www.essencefund.com> 上的半年度报告正文。



## 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	600009	上海机场	9,989,473.52	0.60
2	600900	长江电力	6,996,729.00	0.42
3	600201	生物股份	3,999,760.00	0.24
4	601985	中国核电	3,995,102.92	0.24
5	600548	深高速	3,597,219.00	0.22
6	600068	葛洲坝	3,299,236.00	0.20
7	600559	老白干酒	2,996,165.83	0.18
8	601333	广深铁路	1,999,858.00	0.12
9	603308	应流股份	1,637,879.00	0.10
10	002230	科大讯飞	1,635,422.00	0.10
11	002007	华兰生物	1,614,912.62	0.10
12	300137	先河环保	807,750.00	0.05
13	600271	航天信息	803,116.00	0.05
14	600885	宏发股份	798,093.00	0.05
15	000513	丽珠集团	346,629.36	0.02
16	002286	保龄宝	298,920.00	0.02
17	603377	东方时尚	113,750.40	0.01
18	601900	南方传媒	112,559.06	0.01
19	002788	鹭燕医药	61,656.90	0.00
20	601020	N 华钰	31,426.86	0.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；  
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，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	002230	科大讯飞	19,415,983.50	1.17
2	600009	上海机场	9,939,185.41	0.60
3	603308	应流股份	4,012,694.48	0.24

4	600900	长江电力	3,000,788.25	0.18
5	600201	生物股份	2,918,082.00	0.18
6	600559	老白干酒	2,690,113.73	0.16
7	600068	葛洲坝	2,235,120.00	0.13
8	601333	广深铁路	1,970,473.00	0.12
9	600548	深高速	1,944,672.94	0.12
10	002070	众和股份	1,855,369.00	0.11
11	603508	思维列控	1,563,638.00	0.09
12	300496	中科创达	1,462,880.00	0.09
13	603866	桃李面包	1,373,473.00	0.08
14	603800	道森股份	1,071,911.60	0.06
15	601985	中国核电	999,996.70	0.06
16	603999	读者传媒	960,551.40	0.06
17	603996	中新科技	787,768.61	0.05
18	002783	凯龙股份	758,043.00	0.05
19	300124	汇川技术	675,000.00	0.04
20	000762	西藏矿业	634,385.00	0.04

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，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	45,481,015.40
卖出股票收入（成交）总额	68,198,451.84

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、“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	199,915,000.00	72.97
	其中：政策性金融债	199,915,000.00	72.97
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	50,039,000.00	18.27
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	358,968.53	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	250,312,968.53	91.37

## 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	150419	15 农发 19	500,000	50,010,000.00	18.25
2	150416	15 农发 16	500,000	50,000,000.00	18.25
3	160211	16 国开 11	500,000	49,990,000.00	18.25
4	160209	16 国开 09	500,000	49,915,000.00	18.22
5	011699438	16 中金集 SCP001	200,000	20,004,000.00	7.30

## 7.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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 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

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。

### 7.12.2

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。

### 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	54,352.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,391,433.44
5	应收申购款	99,403.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,545,189.42

### 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的情况。

## § 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
安信动态策略 A	1,237	170,614.83	97,997,000.00	46.43%	113,053,549.10	53.57%
安信动态策略 C	3	15,783,458.70	47,348,484.85	100.00%	1,891.26	0.00%
合计	1,240	208,387.84	145,345,484.85	56.25%	113,055,440.36	43.75%

### 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	安信动态策略 A	-	-
	安信动态策略 C	946.97	-
	合计	946.97	-

### 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的情况

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	安信动态策略 A	0
	安信动态策略 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信动态策略 A	0
	安信动态策略 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信动态策略 A	安信动态策略 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	613,282,800.57	-
本报告期期初基金份额总额	247,611,986.03	1,351,104,632.67
本报告期基金总申购份额	700,922.86	47,351,323.08
减：本报告期基金总赎回份额	37,262,359.79	1,351,105,579.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	211,050,549.10	47,350,376.11

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本基金管理人于 2016 年 4 月 12 日发布公告，聘任陈振宇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理。

自 2016 年 1 月起，上海浦东发展银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 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

本报告期内本基金的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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 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和托管人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	
广发证券	2	80,836,529.60	71.53%	57,500.49	71.53%	-
华创证券	2	30,380,155.49	26.88%	21,608.65	26.88%	-
中信建投	2	1,798,033.00	1.59%	1,278.84	1.59%	-

注：公司制定《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》，对选择证券公司的标准和程序、以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度，由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分，评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等，由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

#### 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
广发证券	9,850,559.10	89.79%	650,000,000.00	98.04%	-	-
华创证券	1,119,781.00	10.21%	10,000,000.00	1.51%	-	-
中信建投	-	-	3,000,000.00	0.45%	-	-

安信基金管理有限责任公司  
2016 年 8 月 25 日