

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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 3 月 24 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 2016 年度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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	474,016,159.74 份	
下属分级基金的基金简称:	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 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	407,852,052.47 份	66,164,107.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提,结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘,动态灵活调整投资策略,力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。	
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。	
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C

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	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

§ 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	2016 年		2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年	
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C
本期已实现收益	12,047,981.75	3,784,211.81	233,804,212.78	1,863,568.32	-	-
本期利润	11,093,153.94	-2,201,709.13	235,074,701.13	7,000,137.81	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0365	-0.0148	0.0673	0.0034	-	-
本期基金份额净值增长率	3.65%	3.46%	4.20%	0.39%	-	-
3.1.2 期末数据	2016 年末		2015 年末		2014 年末	

和指标						
期末可供分配基金份额利润	0.0760	0.0772	0.0364	0.0382	-	-
期末基金资产净值	440,298,592.72	71,286,135.61	258,075,045.18	1,407,132,137.81	-	-
期末基金份额净值	1.080	1.077	1.042	1.041	-	-

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
过去三个月	0.93%	0.09%	1.13%	0.02%	-0.20%	0.07%
过去六个月	1.89%	0.08%	2.27%	0.01%	-0.38%	0.07%
过去一年	3.65%	0.08%	4.51%	0.01%	-0.86%	0.07%
自基金合同生效起至今	8.00%	0.09%	8.02%	0.01%	-0.02%	0.08%

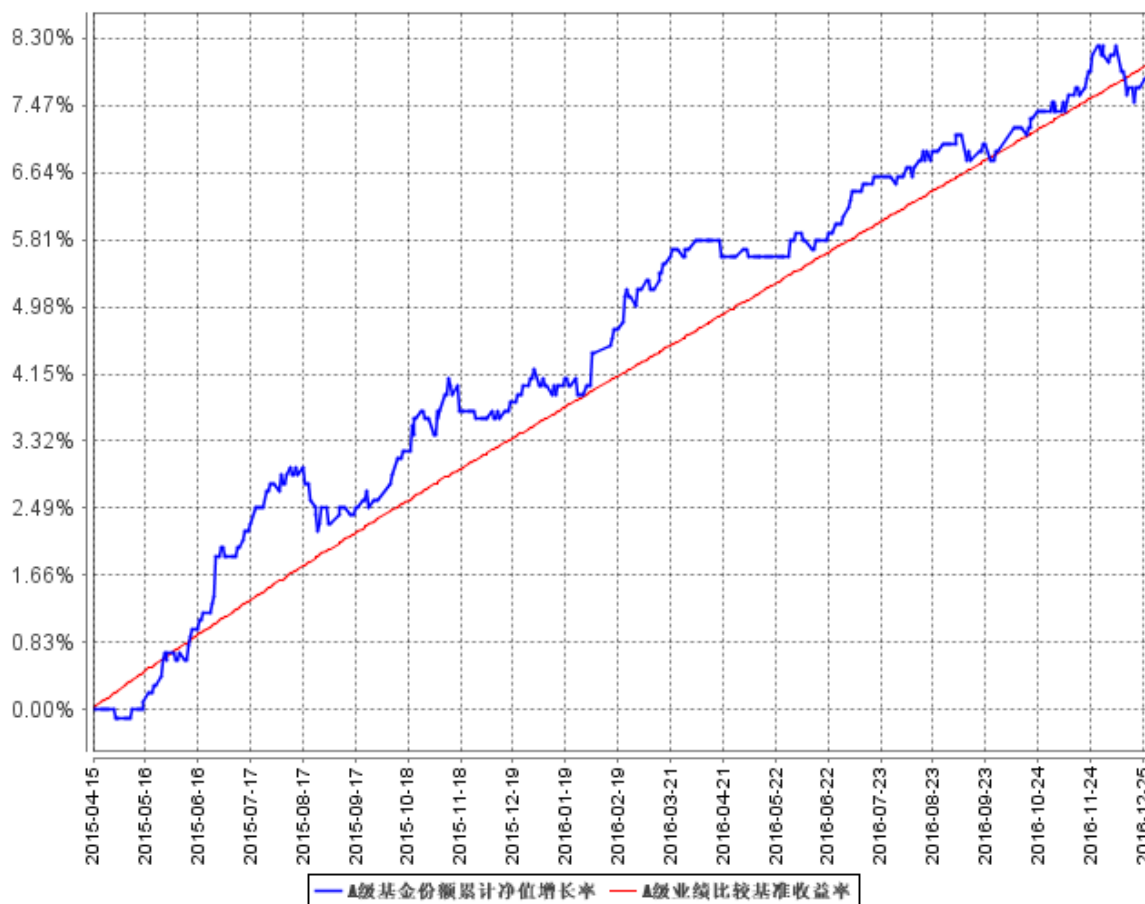
安信动态策略混合 C

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
过去三个月	0.84%	0.09%	1.13%	0.02%	-0.29%	0.07%
过去六个月	1.70%	0.08%	2.27%	0.01%	-0.57%	0.07%
过去一年	3.46%	0.08%	4.51%	0.01%	-1.05%	0.07%
自基金合同生效起至今	3.86%	0.08%	5.05%	0.01%	-1.19%	0.07%

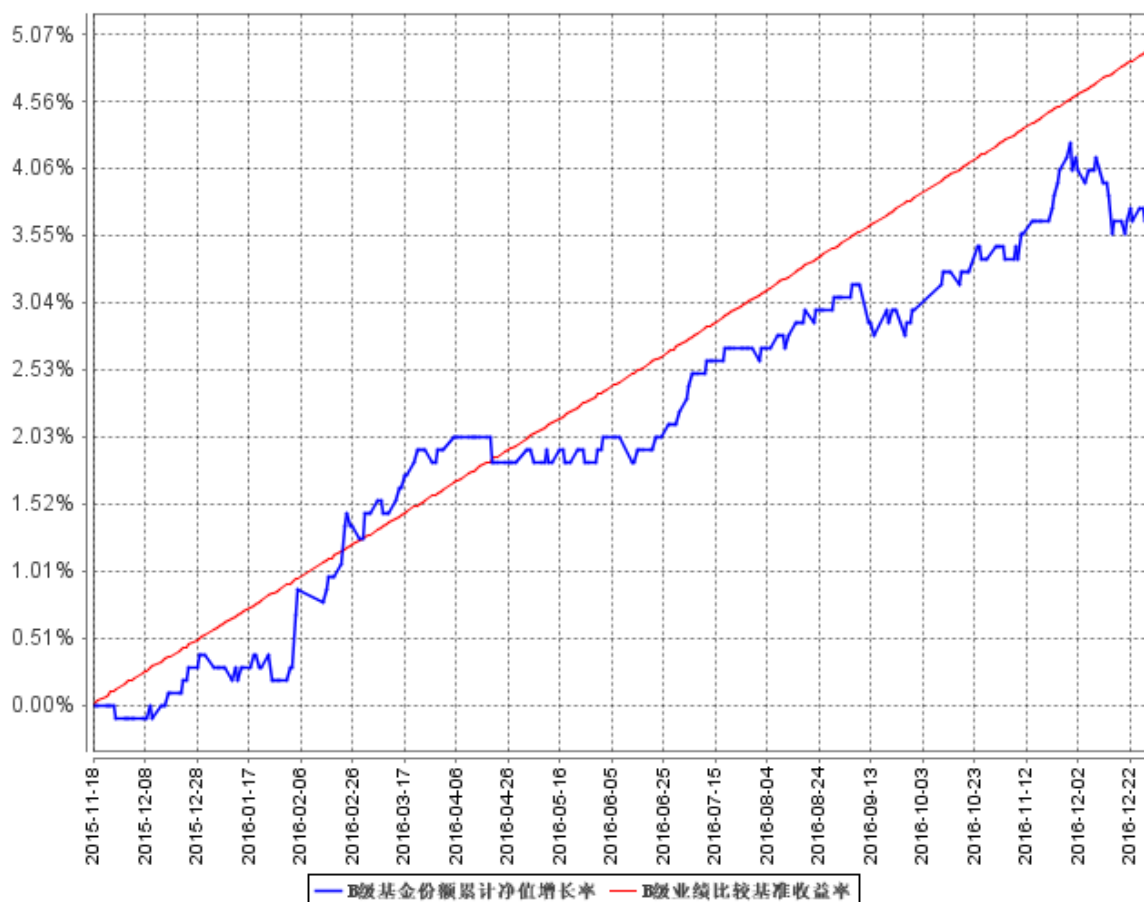
注：本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率 +3.00%

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

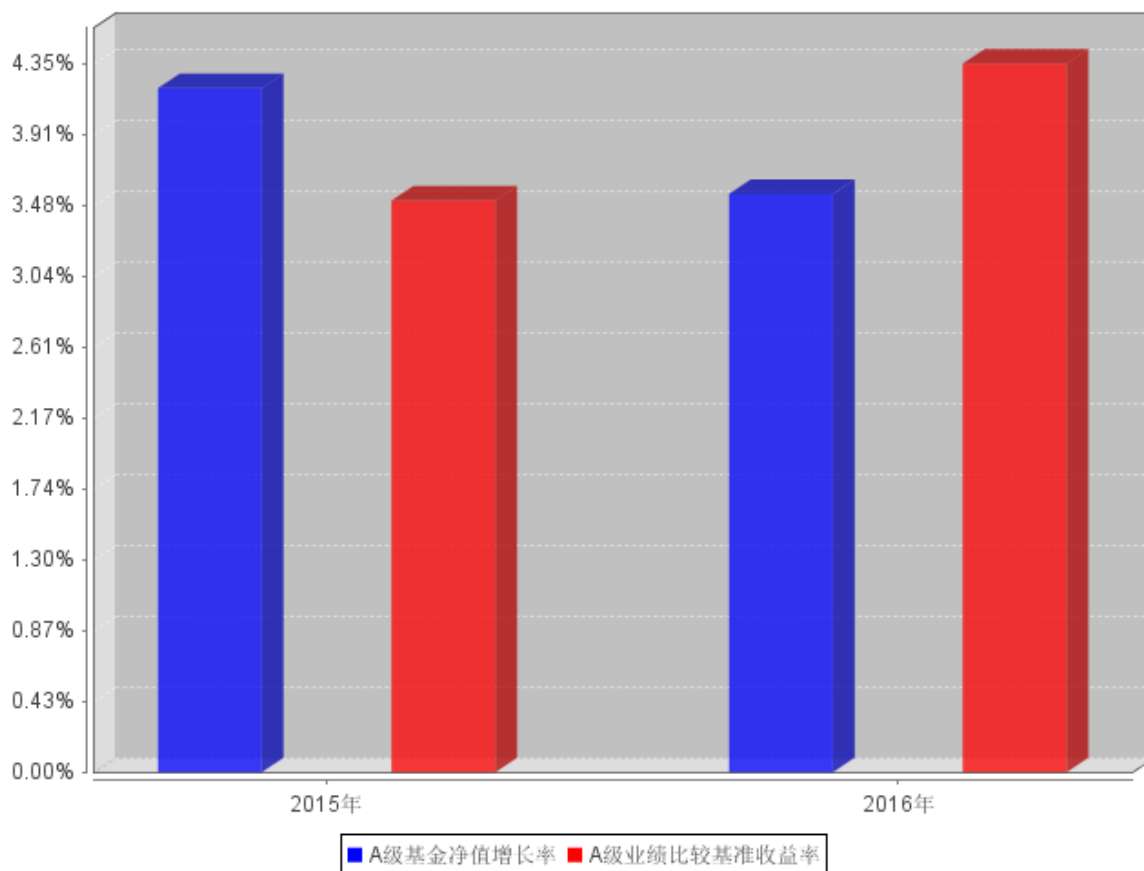


注：1、本基金的建仓期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 10 月 14 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

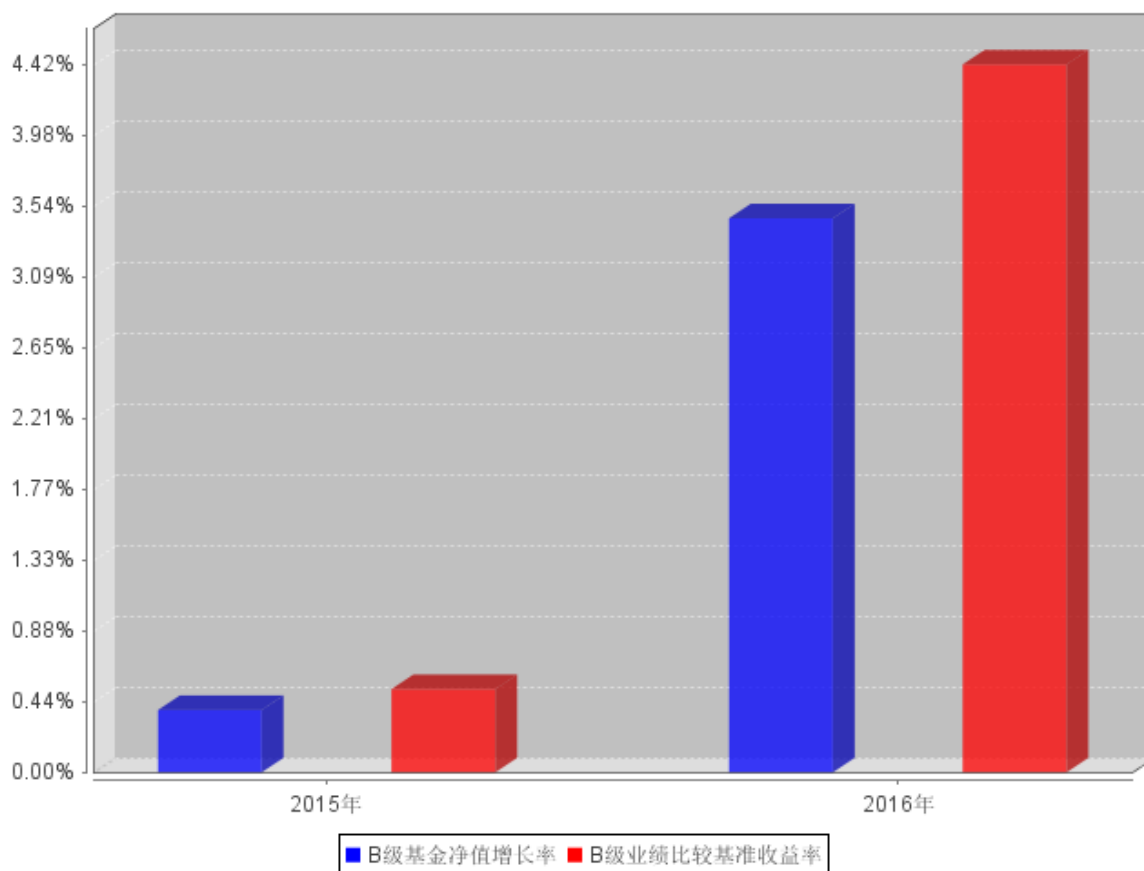
2、本基金基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日。图示日期为 2015 年 4 月 15 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

A级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对比图



B级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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2015 年 4 月 15 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 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 30 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；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 日起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。

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权益投资部。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，安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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、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。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理；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的基金经理助理，安信新常态沪港深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

2016 年伊始，人民币大幅贬值引起投资者不安，加上熔断机制的触发，造成 1 月份 A 股出现了踩踏式下跌。进入 2 月份，经历大幅调整后的 A 股估值优势开始显现，同时经济基本面也开始有企稳迹象，加上美联储加息预期延后，A 股市场迎来难得的反弹。二季度中后期，随着权威人士讲话对前期的稳增长措施重新定调，开闸放水式的刺激措施开始有所收敛，A 股市场进入调整期。

2016 年下半年，A 股市场走势出现分化，主板市场表现明显好于中小创。主板市场表现较好，主要是因为政策力推的供给侧改革效果开始显现，煤炭等上游资源出现价格反弹，同时叠加国企改革深入推进，A 股主板指数表现强劲；另一方面，无风险利率上升对高估值个股负面影响较大，

同时企业外延并购增长方式难以为继，中小创指数表现较差。

安信动态策略基金遵循绝对回报原则，权益头寸投资主要以低估值蓝筹和景气回升行业为主，2016 年上半年主要以白酒、造纸、非银、公用事业等行业为主；下半年，考虑到银行估值较低，且经济基本面回升带来银行坏账率改善，加大银行业配置比例。同时积极地参与网下新股申购，取得了领先市场同类产品的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.080 元，本报告期份额净值增长率为 3.65%，同期业绩比较基准增长率为 4.51%。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 C 类份额净值为 1.077 元，本报告期份额净值增长率为 3.46%，同期业绩比较基准增长率为 4.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

与市场一致预期不同，我们认为房地产投资增速长期看虽然处于下降通道，但是高库存拉长了地产销售好转对投资链条的传导周期，在一二线城市库存去化明显的背景下，房地产投资增速可能强于市场一致预期。受此影响，经济基本面很可能强于市场预期，增速平稳或者仅小幅下滑。

经济基本面强于预期，直接的结果是通胀可能高于市场预期，特别是在供给侧改革效果逐渐显现的 2017 年，通胀压力自上而下地传导很可能传导至 CPI，从而限制货币政策进一步宽松，当然美联储加息也限制了货币政策宽松空间。

正因为有预期差，我们认为市场是可为的，至少是有结构性机会的。房地产投资超预期，意味着整个房地产产业链都将受益，包括与房地产投资直接相关的建筑建材，以及饱受坏账率困扰的银行业将迎来明显改善，这些都将是未来重点投资方向之一。另外，从长期成长性角度看，我们仍然看好半导体行业。

总而言之，2017 年 A 股市场结构性机会仍然存在，我们仍将以绝对收益投资策略为主，力争为持有人争取更高收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 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应用性的情况时，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。

4.8 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。

4.9 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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60962175_H11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人安信基金管理有限责任公司的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	昌华	陈立群
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号、东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	19,083,391.35	692,583,583.62
结算备付金	2,603,506.86	1,412,683.89
存出保证金	39,219.29	493,762.29
交易性金融资产	400,484,888.27	49,992,611.17
其中：股票投资	102,674,888.27	39,989,611.17
基金投资	-	-
债券投资	297,810,000.00	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	90,000,255.00	720,001,770.00
应收证券清算款	-	207,443,893.45
应收利息	3,908,330.87	1,147,106.17
应收股利	-	-
应收申购款	-	99.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	516,119,591.64	1,673,075,509.99
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:		
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	3,494,017.81	3,521,493.89
应付赎回款	10,686.32	1,316,450.43
应付管理人报酬	434,683.19	1,988,121.66
应付托管费	86,936.64	397,624.35
应付销售服务费	12,072.48	353,052.58
应付交易费用	116,458.85	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	380,008.02	84,930.26
负债合计	4,534,863.31	7,868,327.00
所有者权益:		
实收基金	474,016,159.74	1,598,716,618.70
未分配利润	37,568,568.59	66,490,564.29
所有者权益合计	511,584,728.33	1,665,207,182.99

负债和所有者权益总计	516,119,591.64	1,673,075,509.99
------------	----------------	------------------

注：报告截止日为 2016 年 12 月 31 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 1.080 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 1.077 元；基金份额总额 474,016,159.74 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 407,852,052.47 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 66,164,107.27 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	15,984,310.51	279,780,261.66
1.利息收入	11,711,101.44	50,402,668.86
其中：存款利息收入	3,034,392.83	41,649,008.61
债券利息收入	4,688,672.26	1,731,412.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,988,036.35	7,022,247.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	11,157,182.57	183,178,215.94
其中：股票投资收益	8,882,762.05	186,494,031.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,963,686.53	-3,580,552.50
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	310,733.99	264,737.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,940,748.75	6,407,057.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	56,775.25	39,792,319.02
减：二、费用	6,940,310.66	37,705,422.72
1. 管理人报酬	4,628,931.89	27,673,173.85
2. 托管费	956,297.42	5,534,634.76
3. 销售服务费	311,597.51	510,816.10
4. 交易费用	501,117.61	3,289,114.18
5. 利息支出	99,308.44	385,911.50
其中：卖出回购金融资产支出	99,308.44	385,911.50
6. 其他费用	443,057.79	311,772.33

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,043,999.85	242,074,838.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,043,999.85	242,074,838.94

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	9,043,999.85	9,043,999.85
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）	-1,124,700,458.96	-37,965,995.55	-1,162,666,454.51
其中：1. 基金申购款	302,614,662.87	19,441,103.41	322,055,766.28
2. 基金赎回款	-1,427,315,121.83	-57,407,098.96	-1,484,722,220.79
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）	474,016,159.74	37,568,568.59	511,584,728.33
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 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）	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）	-	242,074,838.94	242,074,838.94

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）	985,433,818.13	-175,584,274.65	809,849,543.48
其中：1. 基金申购款	13,149,417,035.83	116,030,972.22	13,265,448,008.05
2. 基金赎回款	-12,163,983,217.70	-291,615,246.87	-12,455,598,464.57
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）	1,598,716,618.70	66,490,564.29	1,665,207,182.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘入领	_____ 廖维坤	_____ 尚尔航
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。

本基金募集期间为2015年4月8日至2015年4月10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(2015)验字60962175_H24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613,229,558.27元。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》（以下简称“基金合同”）于2015年4月15日正式生效。截至2015年4月15日止，安信动态策略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613,229,558.27元，折合613,229,558.27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53,242.30元，折合53,242.30份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币613,282,800.57元，折合613,282,800.57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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同，经基金管理人安信基金管理有限责任公司与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，本基金自 2015 年 11 月 17 日起增加 C 类份额。

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的股票）、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%，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%。

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《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 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〉》、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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5.3 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。

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 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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。

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

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 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，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
上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“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
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
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。

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

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,628,931.89	27,673,173.85
其中：支付销售机构的客户维护费	517,220.49	966,637.59

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的基金资产净值的

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 为每日应支付的基金管理费

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	956,297.42	5,534,634.76

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

7.4.8.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C	合计
安信基金直销	-	311,600.79	311,600.79
合计	-	311,600.79	311,600.79
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C	合计
安信基金直销	-	510,799.27	510,799.27
合计	-	510,799.27	510,799.27

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，安信动态策略混合 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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。

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

份额单位：份

安信动态策略混合 A				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	10.5480%	49,999,000.00	3.1274%

份额单位：份

安信动态策略混合 C				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	9.9888%	-	-

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 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
浦发银行	19,083,391.35	1,152,175.22	242,583,583.62	20,510,244.80

注：1、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、上述当期利息收入中包含了本基金资金托管账户利息收入和对手方为浦发银行的协议存款利息收入。

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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	

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 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 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、买入返售金融资产、其他应收款项类投资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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 102,437,181.05 元，划分为第二层级的余额为人民币 298,047,707.22 元，无划分为第三层级余额（于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 39,989,275.71 元，划分为第二层级的余额为人民币 10,003,335.46 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。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 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	102,674,888.27	19.89
	其中：股票	102,674,888.27	19.89
2	固定收益投资	297,810,000.00	57.70
	其中：债券	297,810,000.00	57.70
	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	90,000,255.00	17.44
	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	21,686,898.21	4.20
7	其他各项资产	3,947,550.16	0.76
8	合计	516,119,591.64	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,017,386.72	9.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	3,197,756.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,399,063.83	0.86
J	金融业	48,045,089.49	9.39
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	-	-
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	102,674,888.27	20.07

8.2.2 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。

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	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	1,913,469	17,412,567.90	3.40
2	601398	工商银行	1,587,700	7,001,757.00	1.37
3	601988	中国银行	1,707,200	5,872,768.00	1.15
4	601288	农业银行	1,756,700	5,445,770.00	1.06
5	000333	美的集团	188,171	5,300,777.07	1.04
6	002230	科大讯飞	162,387	4,399,063.83	0.86
7	002465	海格通信	368,834	4,296,916.10	0.84
8	601965	中国汽研	394,377	4,200,115.05	0.82
9	600271	航天信息	196,300	3,916,185.00	0.77
10	601939	建设银行	709,300	3,858,592.00	0.75

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

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	000001	平安银行	18,894,923.00	1.13
2	600009	上海机场	9,989,473.52	0.60
3	601965	中国汽研	8,460,352.45	0.51
4	002230	科大讯飞	8,419,523.50	0.51
5	600900	长江电力	6,996,729.00	0.42

6	601398	工商银行	6,994,501.00	0.42
7	600816	安信信托	6,492,575.27	0.39
8	600271	航天信息	6,100,018.00	0.37
9	601988	中国银行	5,999,353.00	0.36
10	000333	美的集团	5,717,940.00	0.34
11	601288	农业银行	5,499,676.00	0.33
12	002450	康得新	5,095,049.84	0.31
13	002465	海格通信	4,996,895.00	0.30
14	300054	鼎龙股份	4,990,887.00	0.30
15	600548	深高速	4,595,943.74	0.28
16	600201	生物股份	3,999,760.00	0.24
17	601985	中国核电	3,995,102.92	0.24
18	600104	上汽集团	3,993,762.00	0.24
19	600028	中国石化	3,798,134.00	0.23
20	600885	宏发股份	3,793,020.15	0.23

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	002230	科大讯飞	21,423,028.17	1.29
2	600009	上海机场	9,939,185.41	0.60
3	600900	长江电力	7,122,788.28	0.43
4	600816	安信信托	6,715,063.67	0.40
5	601965	中国汽研	4,516,107.39	0.27
6	600548	深高速	4,473,414.76	0.27
7	600028	中国石化	4,237,868.88	0.25
8	300124	汇川技术	4,044,782.04	0.24
9	603308	应流股份	4,012,694.48	0.24
10	601985	中国核电	3,917,720.00	0.24
11	600885	宏发股份	3,833,670.25	0.23
12	600741	华域汽车	3,373,640.28	0.20
13	600068	葛洲坝	3,329,480.00	0.20
14	600352	浙江龙盛	3,088,030.16	0.19

15	002078	太阳纸业	3,012,645.15	0.18
16	002450	康得新	3,000,495.16	0.18
17	000709	河钢股份	2,942,394.00	0.18
18	002594	比亚迪	2,941,760.40	0.18
19	600201	生物股份	2,918,082.00	0.18
20	002007	华兰生物	2,891,519.60	0.17

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。

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	233,677,212.59
卖出股票收入（成交）总额	172,745,030.56

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。

8.5 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	109,332,000.00	21.37
	其中：政策性金融债	109,332,000.00	21.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,198,000.00	7.86
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	148,280,000.00	28.98
9	其他	-	-
10	合计	297,810,000.00	58.21

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

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	160209	16 国开 09	500,000	49,950,000.00	9.76
2	111611447	16 平安 CD447	500,000	49,510,000.00	9.68
3	111680978	16 宁波银行 CD229	500,000	49,495,000.00	9.67
4	111616145	16 上海银行 CD145	500,000	49,275,000.00	9.63
5	160212	16 国开 12	300,000	29,874,000.00	5.84

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

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

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证券没有超出基金合同规定的备选证券库，本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

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	39,219.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,908,330.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,947,550.16

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处于转股期的可转换债券。

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。

§ 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

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
安信动态策略混合 A	997	409,079.29	324,518,937.81	79.57%	83,333,114.66	20.43%
安信动态策略混合 C	3	22,054,702.42	66,163,160.30	100.00%	946.97	0.00%
合计	1,000	474,016.16	390,682,098.11	82.42%	83,334,061.63	17.58%

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）。

9.2 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	安信动态策略混合 A	-	-
	安信动态策略混合 C	946.97	0.0014%
	合计	946.97	0.0002%

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）。

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信动态策略混 合 A	安信动态策略混 合 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	236,448,664.34	66,165,998.53
减:本报告期基金总赎回份额	76,208,597.90	1,351,106,523.93
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	407,852,052.47	66,164,107.27

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。

§ 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。

基金托管人进行组织架构优化调整并变更部门名称，自 2016 年 1 月起，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付的报酬为人民币 100,000 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、托管人及其相关高级管理人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	
中信建投	2	188,838,130.33	46.80%	134,319.80	46.80%	-
华创证券	2	133,816,391.70	33.16%	95,182.69	33.16%	-
广发证券	2	80,836,529.60	20.03%	57,500.49	20.03%	-

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。

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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	847,550.40	7.17%	770,100,000.00	32.84%	-	-
华创证券	1,119,781.00	9.48%	925,000,000.00	39.44%	-	-
广发证券	9,850,559.10	83.35%	650,000,000.00	27.72%	-	-

安信基金管理有限责任公司
2017 年 3 月 27 日