

安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 5 月 9 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| §5 托管人报告 | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| §6 审计报告 | 19 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 20 |
| §7 年度财务报表 | 21 |
| 7.1 资产负债表..... | 21 |
| 7.2 利润表..... | 22 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |
| 7.4 报表附注..... | 24 |
| §8 投资组合报告 | 46 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 46 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 47 |
| 8.3 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..... | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 8.7 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..... | 51 |

| | | |
|------------|---|-----------|
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 52 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 52 |
| §9 | 基金份额持有人信息 | 53 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| 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 | 54 |
| §10 | 开放式基金份额变动 | 54 |
| §11 | 重大事件揭示 | 55 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 55 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 56 |
| §12 | 备查文件目录 | 59 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 59 |
| 12.2 | 存放地点 | 59 |
| 12.3 | 查阅方式 | 59 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 安信新回报混合 | |
| 基金主代码 | 002770 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 9 日 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 798,003,538.17 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 安信新回报混合 A | 安信新回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 002770 | 002771 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 767,613,352.40 份 | 30,390,185.77 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超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 资产配置方面,本基金以定性研究为主,结合定量分析,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;固定收益类投资方面,本基金将灵活采用品种配置、久期配置、信用配置、利率和回购等投资策略,选择流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种;股票投资方面,本基金秉承价值投资理念,深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司,把握市场定价偏差带来的投资机会;此外,本基金将合理利用权证等衍生工具做套保或套利投资,通过投资高质量的资产支持证券实现基金资产增值增厚。 |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数(全价)收益率 |
| 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 | 宁波银行股份有限公司 |
| 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 | 95574 |

| | | |
|-------|-------------------------------------|----------------------|
| 传真 | 0755-82799292 | 0574-89103213 |
| 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 | 中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 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 层 | 中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号 |
| 邮政编码 | 518026 | 315100 |
| 法定代表人 | 刘入领 | 陆华裕 |

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、上海证券报、证券时报 |
| 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号， 东方广场安永大楼 16 层 |
| 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、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 5 月 9 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-------------|
| | 安信新回报混合 A | 安信新回报混合 C |
| 本期已实现收益 | 20,664,944.59 | 605,148.30 |
| 本期利润 | 17,253,482.27 | -420,985.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0279 | -0.0293 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.70% | -2.80% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.70% | 3.70% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | |

| | | |
|--------------|----------------|---------------|
| 期末可供分配利润 | 24,909,342.20 | 978,055.48 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0325 | 0.0322 |
| 期末基金资产净值 | 795,915,772.19 | 31,502,065.85 |
| 期末基金份额净值 | 1.037 | 1.037 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.70% | 3.70% |

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

安信新回报混合 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 | -0.77% | 0.14% | -0.40% | 0.40% | -0.37% | -0.26% |
| 过去六个月 | 2.67% | 0.12% | 1.83% | 0.40% | 0.84% | -0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.70% | 0.11% | 2.49% | 0.43% | 1.21% | -0.32% |

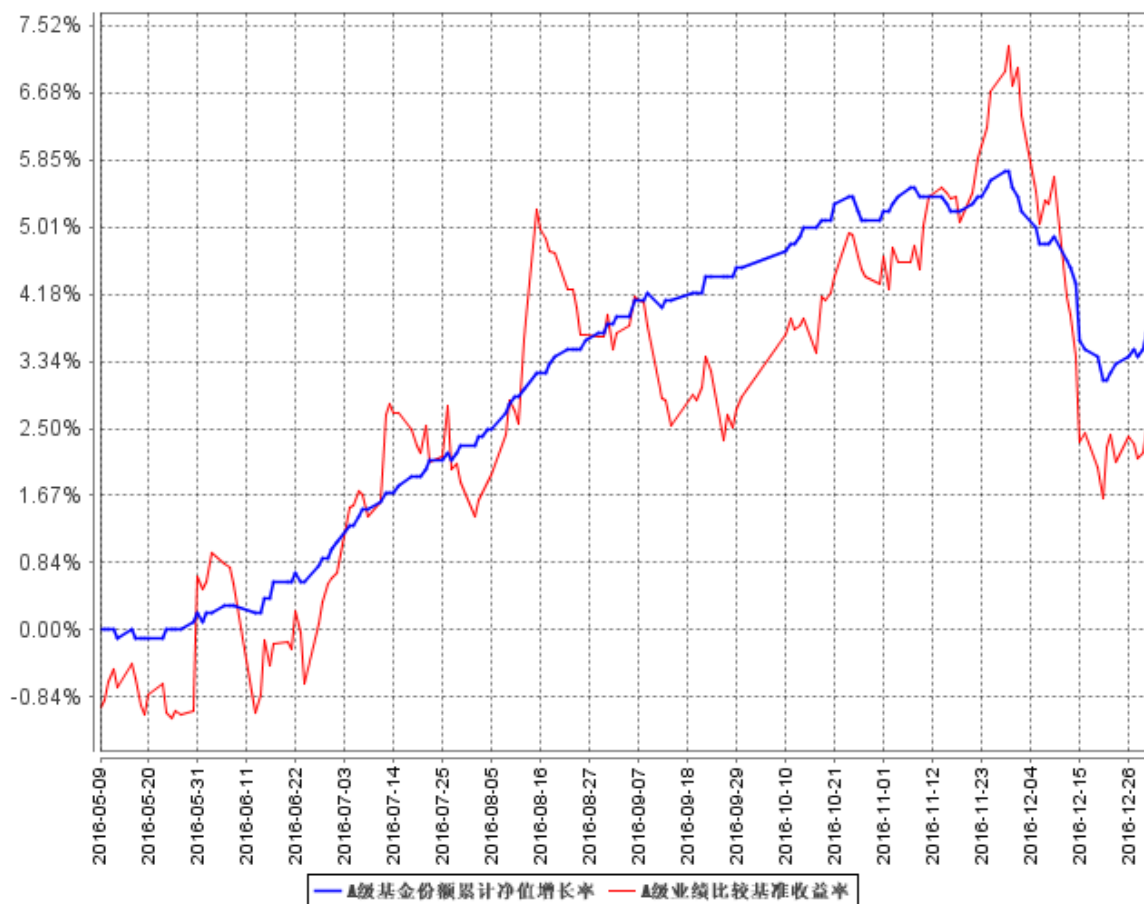
安信新回报混合 C

| 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 | -0.77% | 0.14% | -0.40% | 0.40% | -0.37% | -0.26% |
| 过去六个月 | 2.67% | 0.11% | 1.83% | 0.40% | 0.84% | -0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.70% | 0.11% | 2.49% | 0.43% | 1.21% | -0.32% |

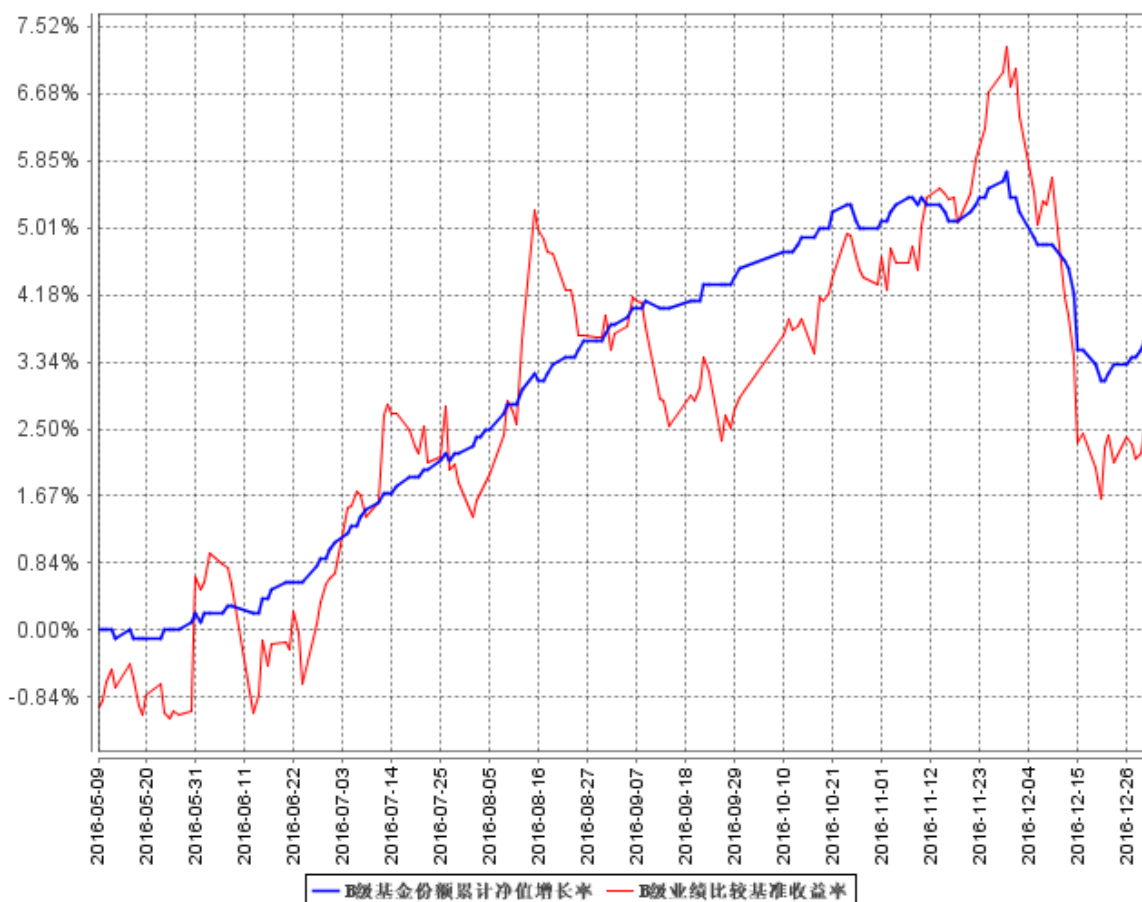
注：根据《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%。

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

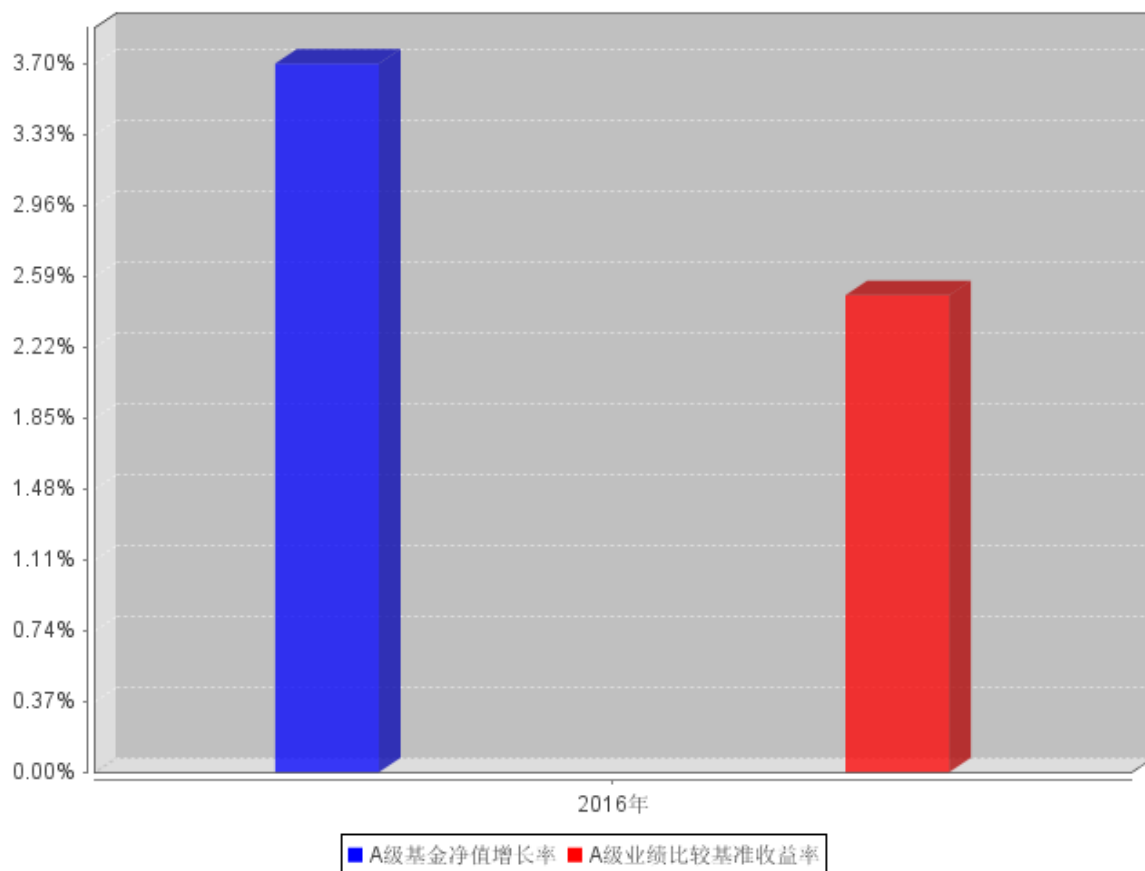


注：1、本基金的建仓期为 2016 年 5 月 9 日至 2016 年 11 月 8 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

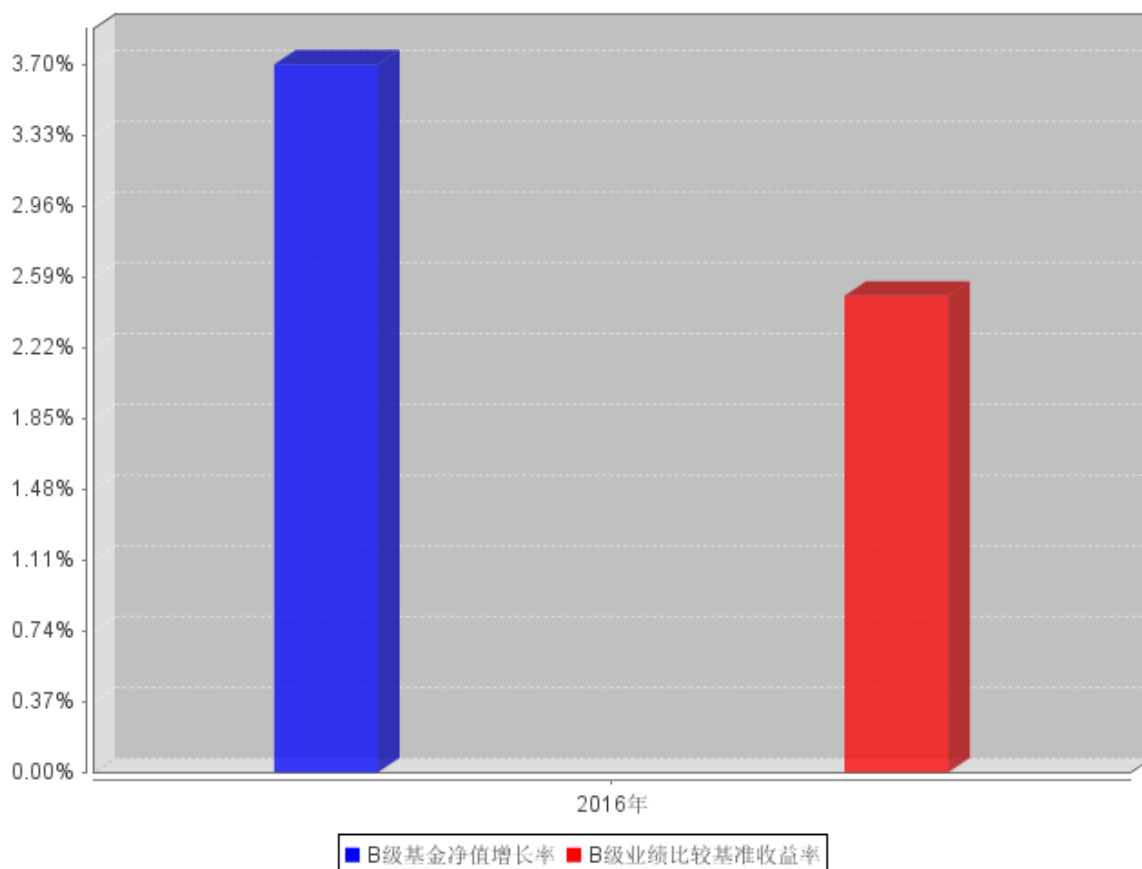
2、本基金基金合同生效日为 2016 年 5 月 9 日。图示日期为 2016 年 5 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日。

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



注：本基金基金合同生效日为 2016 年 5 月 9 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未滿一年。图示日期为 2016 年 5 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2016 年 5 月 9 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 | | |
| 庄园 | 本基金基金经理 | 2016年5月9日 | - | 12 | 庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股 |

| | | | | | |
|----|-----------|-------------|---|---|--|
| | | | | | <p>份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理，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）、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、安信安盈保本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、安信新回报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的基金经理。</p> |
| 李巍 | 本基金基金经理助理 | 2016年10月25日 | - | 4 | <p>李巍先生，理学硕士。曾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</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>级债券交易员。现任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、安信新趋势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的基金经理助理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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 年债券市场波动很大，前三个季度债券市场继续走出了牛市行情，主要受资金面和基本面的影响，加上银行理财资金持续不断增加，新增资金配置压力较大。但四季度债券市场经历了大幅调整，调整幅度之大远甚于 2013 年钱荒，基本吞掉了前三季度的盈余，且调整速度也是非常迅速。

国庆期间，楼市限购限贷政策频繁出台，市场预期房地产销售下行将带来基本面进一步下行，经济预期走弱叠加资产荒担忧；此外 10 月人民币加入 SDR 后海外央行配置需求助兴；10 月 21 日，收益率创年内低点，10 年国债降至 2.64%，10 年国开降至 3.0%。10 月下旬，表外理财纳入 MPA 考核再次引发市场对监管去杠杆决心的担忧，收益率小幅上行。

11 月 9 日，特朗普当选美国总统再次掀起全球风险偏好以及再通胀担忧，全球避险资产应声下跌风险资产上涨。11 月底，由于临近年末，在冲规模、冲基数需求下，同业理财、同业存单利率明显上行；银行也收紧了对非银的融资；流动性极度紧张，隔夜利率飙升，委外、代持等生态下，机构纷纷自保也引发市场踩踏，收益率快速上行，并进入大跌、赎回、货基负偏离、国债期货跌停的负循环中。

12 月 16 日，中央经济工作会议提及货币政策稳健中性，把控货币闸门，且要处置一批金融

风险点；叠加国海代持事件或牵涉其他机构，影响债市固有的以信任为基石的交易结构，导致市场情绪进一步恶化，收益率进一步上行，12月19日，10Y国债和国开YTM分别达3.37%和3.93%，为今年以来最高值。12月最后一周，债券市场出现了非常快速的反弹行情，尤其是国债期货大幅上涨。其暴涨本质上是对前期超大幅贴水的修复，现货金融债表现稍逊色。

随后，在监管出面协调代持事件、央行投放流动性、银行提高对非银拆借之后，市场情绪稳住；并在年末估值需求、保险公司报表需求配置利率债等带动下，最后几天债券收益率有所修复。四季度债券市场调整速度和幅度是历史上所罕见的，这直接导致一级市场信用债大面积取消发行，新增发行额度几乎为零，对实体经济再融资产生了较大影响。

由于我国市场一级市场与二级市场存在着较大的价差，自2015年证监会重启IPO以来，大多数的灵活配置型基金均积极参与一级市场新股申购，即被称之为“打新型”灵活配置型基金。加之2016年以来市场呈现震荡态势，这种收益表现相对较好的灵活配置型基金逐步受到市场的认可。截至2016年年末，市场共有1688只基金在网下参与获配新股，总获配金额为624767.73万元。而无论是获配新股的金额还是获配数量而言，灵活配置型基金均表现出明显的优势。目前市场上积极参与新股申购策略的灵活配置型基金共727只，总的获配金额为238397.63万元，占据全部基金获配金额的38.16%。

之所以运用此类策略的灵活配置型基金受到投资者广泛关注，主要在于主动偏股基金、指数型基金等因其自身仓位的限制，用于参与新股申购的资产比例较低，而以绝对收益为目标且股票仓位设置更加灵活的基金产品，至多可以运用90%的资金积极参与新股申购，同时可以实时的随着市场行情的变化进行调整。因此，对于灵活配置型基金而言，通过新股申购策略以分析2016年以来IPO上市的215家公司为样本，上市首日的平均涨跌幅为44.00%；以上市首日收盘价为基准，至2016年年末的平均区间涨幅为224.28%，网上发行中签率为0.047%，公募基金获配数量占网下发行总量的平均占比为45.86%。这表明在目前的中签率及市场环境下，申购新股仍能获得较不错的回报。而2016年市场主动股混基金的平均收益仅-6.53%，市场所有灵活配置型基金的收益为-3.66%，相比而言，积极参与新股申购所能带来的收益效应高于市场主动股混基金。

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1.037元，本报告期份额净值增长率为3.70%，同期业绩比较基准增长率为2.49%。截至2016年12月31日，本基金C类份额净值为1.037元，本报告期份额净值增长率为3.70%，同期业绩比较基准增长率为2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2016 年三季度以来,宏观经济回暖迹象逐渐增多。由于房地产行业受到了严厉的调控措施,明年房地产增速预计下滑,但是制造业在 2017 年仍然保持复苏态势,综合来看 2017 年宏观经济有望持续 6%以上增速。基本面对 2017 年债市的影响整体是中性的;消费方面,社会零售规模在新兴业态消费快速增长的带领下,有望继续保持增长势头;16 年 11 月,进出口同比从降幅收窄,到进口同比转正,显示贸易对实体经济的拉动作用也有所增强。

在稳健中性的货币政策基调下,央行保持货币供给平稳增长存在着来自基础货币和乘数波动的双重压力。在此背景下,预计 2017 年货币环境整体偏紧。因为中央经济工作会议明确提出要管控好货币阀门,我们认为货币供给不会给通胀带来明显压力,价格波动更多的实体经济供需作用的结果,明年翘尾因素或对 PPI 同比形成一定的支撑,但对 CPI 的压力并不显著,预计明年 PPI 先升后降,CPI 整体仍然会保持平稳运行的态势。总体来看,我们认为货币政策方面,官方已经将总基调定义为稳健中性,而在以往强调稳健的基础上增加了“中性”,更像是一种偏紧的信号,而当前货币政策的操作模式又有潜在的自我紧缩的可能性,所以明年货币政策对债市的整体影响是偏负面的。

国际市场方面,由于特朗普上台后明确表示了宽松财政政策的主张,欧佩克也达成冻产协议,近期国际原油和金属价格都快速上涨。如果 17 年特朗普的宽松财政政策落地,会给大宗商品带来进一步上涨的压力,预计明年通胀的压力更多来自海外。

整体上,我们认为明年债券市场没有趋势性行情,降杠杆延续会继续让债券市场承压,预计 10 年期国债收益率将会在 3%-3.5%的区间内波动。如果央行期间出现降准操作,则下修 10 年期国债收益率上下限各 10 个 BP,调整至 2.9%-3.4%。

目前的股票市场,从去年底到今年初,由于债市去杠杆导致全市场流动性收紧等市场内外的原因,股市出现了一定的调整。但调整之后,我们看到了更大的希望。调整中积累优秀股票正是投资的本源。牛市入场难以赚钱,一是因为泡沫阶段上去快下来也快,二是因为牛市里很难买到合理价格的股票,三是因为牛市时企业业绩的变动方向常常是向下而不是向上。进入市场的时候,后面一群犹犹豫豫的人,要远好于前面一群熙熙攘攘的人,因为后面的人都是潜在的多头,而前面的人都是潜在的空头。在现在的盈利和流动性预测的基础上,不少股票已经进入历史上最便宜的 1/3 区间,而全市场的仓位因为年初恐慌降到一个非常低的水平后,现在仍然没有明显提高,因此我们对股票的态度可以更加积极。

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。

4.8 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，本托管人在对安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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_H19 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 | 安信新回报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新回报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 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日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，公允反映了安信新回报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 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日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 | 2017-03-24 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信新回报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 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 13,990,715.38 |
| 结算备付金 | | 13,126,090.38 |
| 存出保证金 | | 68,753.52 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 846,159,512.60 |
| 其中：股票投资 | | 57,980,937.60 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 788,178,575.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 128,700,313.05 |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 11,802,293.80 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 250,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 1,014,097,678.73 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 185,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 24,857.64 |
| 应付赎回款 | | 700,271.79 |
| 应付管理人报酬 | | 569,102.98 |
| 应付托管费 | | 71,137.88 |
| 应付销售服务费 | | 6,742.92 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 72,613.48 |
| 应交税费 | | - |

| | | |
|---------------|----------|------------------|
| 应付利息 | | 5,113.23 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 230,000.77 |
| 负债合计 | | 186,679,840.69 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 798,003,538.17 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 29,414,299.87 |
| 所有者权益合计 | | 827,417,838.04 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,014,097,678.73 |

注：报告截止日为 2016 年 12 月 31 日，安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.037 元，安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.037 元；基金份额总额 798,003,538.17 份，其中安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 767,613,352.40 份，安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 30,390,185.77 份。

7.2 利润表

会计主体：安信新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|----------|---|
| | | 2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 23,098,726.14 |
| 1.利息收入 | | 19,378,732.46 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 362,647.54 |
| 债券利息收入 | | 18,728,945.40 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 287,139.52 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 8,084,814.87 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 10,053,567.95 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -2,196,843.14 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.15 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.16 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.17 | 228,090.06 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | -4,437,596.01 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.19 | 72,774.82 |

| | | |
|----------------------------|----------|---------------|
| 减：二、费用 | | 6,266,229.26 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2 | 3,402,770.50 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2 | 425,346.27 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2 | 19,148.07 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.20 | 272,701.13 |
| 5. 利息支出 | | 1,903,463.29 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,903,463.29 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.21 | 242,800.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 16,832,496.88 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 16,832,496.88 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)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） | 501,083,899.28 | - | 501,083,899.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 16,832,496.88 | 16,832,496.88 |
| 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） | 296,919,638.89 | 12,581,802.99 | 309,501,441.88 |
| 其中：1. 基金申购款 | 339,148,988.41 | 14,489,811.16 | 353,638,799.57 |
| 2. 基金赎回款 | -42,229,349.52 | -1,908,008.17 | -44,137,357.69 |
| 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） | 798,003,538.17 | 29,414,299.87 | 827,417,838.04 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <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 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信新回报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 4 月 25 日下发的证监许可[2016]914 号文“关于准予安信新回报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《安信新回报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。

本基金募集期为 2016 年 5 月 4 日至 2016 年 5 月 5 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(2016)验字 60962175_H27 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 501,083,744.43 元。经向中国证监会备案，《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 9 日正式生效。截至 2016 年 5 月 9 日止，安信新回报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 501,083,744.43 元，折合 501,083,744.43 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 154.85 元，折合 154.85 份基金份额。其中 A 类基金份额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 500,954,744.43 元，折合 500,954,744.43 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 133.60 元，折合 133.60 份基金份额。C 类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 129,000.00 元，折合 129,000.00 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 21.25 元，折合 21.25 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 501,083,899.28 元，折合 501,083,899.28 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、其他货币市场工具等固定收益类品种，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）、权证等权益类品种，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：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：沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%。

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 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟本会计期间为自 2016 年 5 月 9 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止会计期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：交易性金融资产和应收款项；

本基金目前持有的交易性金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移

也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入

账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提；

(3) 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；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；

同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款 | 13,990,715.38 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 13,990,715.38 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 57,254,489.01 | 57,980,937.60 | 726,448.59 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 392,810,246.34 | 389,276,575.00 |
| | 银行间市场 | 400,532,373.26 | 398,902,000.00 |
| | 合计 | 793,342,619.60 | 788,178,575.00 |
| | | | -3,533,671.34 |
| | | | -1,630,373.26 |
| | | | -5,164,044.60 |

| | | | |
|--------|----------------|----------------|---------------|
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 850,597,108.61 | 846,159,512.60 | -4,437,596.01 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2016年12月31日 | |
|------------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 128,700,313.05 | - |
| 合计 | 128,700,313.05 | - |

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 12,533.43 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 6,497.37 |
| 应收债券利息 | 11,757,966.72 |
| 应收买入返售证券利息 | 25,262.18 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 34.10 |
| 合计 | 11,802,293.80 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 68,906.09 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,707.39 |
| 合计 | 72,613.48 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 0.77 |
| 预提审计费 | 80,000.00 |
| 预提信息披露费 | 150,000.00 |
| 合计 | 230,000.77 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 安信新回报混合 A | | |
|---------------|---|----------------|
| 项目 | 本期 2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 500,954,878.03 | 500,954,878.03 |
| 本期申购 | 271,602,354.61 | 271,602,354.61 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,943,880.24 | -4,943,880.24 |
| 本期末 | 767,613,352.40 | 767,613,352.40 |

金额单位：人民币元

| 安信新回报混合 C | | |
|---------------|---|----------------|
| 项目 | 本期 2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 129,021.25 | 129,021.25 |
| 本期申购 | 67,546,633.80 | 67,546,633.80 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -37,285,469.28 | -37,285,469.28 |
| 本期末 | 30,390,185.77 | 30,390,185.77 |

注：本期申购份额含红利再投、转换入份额；本期赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 安信新回报混合 A | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 20,664,944.59 | -3,411,462.32 | 17,253,482.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,244,397.61 | 6,804,539.91 | 11,048,937.52 |
| 其中：基金申购款 | 4,361,465.21 | 6,887,900.40 | 11,249,365.61 |
| 基金赎回款 | -117,067.60 | -83,360.49 | -200,428.09 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 24,909,342.20 | 3,393,077.59 | 28,302,419.79 |

单位：人民币元

| 安信新回报混合 C | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 605,148.30 | -1,026,133.69 | -420,985.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 372,907.18 | 1,159,958.29 | 1,532,865.47 |
| 其中：基金申购款 | 1,387,509.67 | 1,852,935.88 | 3,240,445.55 |
| 基金赎回款 | -1,014,602.49 | -692,977.59 | -1,707,580.08 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 978,055.48 | 133,824.60 | 1,111,880.08 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 225,448.10 |
| 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 | 134,111.25 |
| 其他 | 3,088.19 |
| 合计 | 362,647.54 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至 2016年12月31日 |
|-------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 88,328,063.55 |
| 减: 卖出股票成本总额 | 78,274,495.60 |
| 买卖股票差价收入 | 10,053,567.95 |

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至 2016年12月31日 |
|--------------------------|--|
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额 | 392,641,542.73 |
| 减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 385,126,407.03 |
| 减: 应收利息总额 | 9,711,978.84 |
| 买卖债券差价收入 | -2,196,843.14 |

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年12 月31日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 228,090.06 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 228,090.06 |

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016 年12月31日 |
|------|--|
|------|--|

| | |
|------------|---------------|
| 1. 交易性金融资产 | -4,437,596.01 |
| ——股票投资 | 726,448.59 |
| ——债券投资 | -5,164,044.60 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -4,437,596.01 |

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年 12月31日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 72,774.82 |
| 合计 | 72,774.82 |

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年 12月31日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 265,913.63 |
| 银行间市场交易费用 | 6,787.50 |
| 合计 | 272,701.13 |

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016 年12月31日 |
|----------|--|
| 审计费用 | 80,000.00 |
| 信息披露费 | 150,000.00 |
| 其他 | 400.00 |
| 银行间帐户维护费 | 12,400.00 |
| 合计 | 242,800.00 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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 |
| 宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”） | 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 |
| 佛山市顺德区新碧贸易有限公司 | 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 |
| 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|--------------------------------|
| | 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,402,770.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 23,997.44 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|--------------------------------|
| | 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 425,346.27 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|--------------------------------|-----------|--------|
| | 2016年5月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信新回报混合 A | 安信新回报混合 C | 合计 |
| 宁波银行 | - | 585.62 | 585.62 |
| 安信基金直销 | - | 683.39 | 683.39 |

| | | | |
|------|---|-----------|-----------|
| 安信证券 | - | 14,896.68 | 14,896.68 |
| 合计 | - | 16,165.69 | 16,165.69 |

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末未持有本基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | |
|-------|---|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 宁波银行 | 13,990,715.38 | 225,448.10 |

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

| 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 | |

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 185,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期，该类交易要求本基金在回购期内持

有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金

资产净值的比例为 90.40%。

7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 143,652,985.98 |
| 合计 | 143,652,985.98 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA | 81,113,628.46 |
| AAA 以下 | 446,385,740.57 |
| 未评级 | 128,784,186.71 |
| 合计 | 656,283,555.74 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对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。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016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 | 13,990,715.38 | - | - | - | 13,990,715.38 |
| 结算备付金 | 13,126,090.38 | - | - | - | 13,126,090.38 |
| 存出保证金 | 68,753.52 | - | - | - | 68,753.52 |
| 交易性金融资产 | 318,510,000.00 | 419,477,503.20 | 50,191,071.80 | 57,980,937.60 | 846,159,512.60 |
| 买入返售金融资产 | 128,700,313.05 | - | - | - | 128,700,313.05 |
| 应收利息 | - | - | - | 11,802,293.80 | 11,802,293.80 |
| 应收申购款 | - | - | - | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 资产总计 | 474,395,872.33 | 419,477,503.20 | 50,191,071.80 | 70,033,231.40 | 1,014,097,678.73 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 185,000,000.00 | - | - | - | 185,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 24,857.64 | 24,857.64 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 700,271.79 | 700,271.79 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 569,102.98 | 569,102.98 |
| 应付托管费 | - | - | - | 71,137.88 | 71,137.88 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 6,742.92 | 6,742.92 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 72,613.48 | 72,613.48 |
| 应付利息 | - | - | - | 5,113.23 | 5,113.23 |
| 其他负债 | - | - | - | 230,000.77 | 230,000.77 |
| 负债总计 | 185,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,679,840.69 | 186,679,840.69 |
| 利率敏感度缺口 | 289,395,872.33 | 419,477,503.20 | 50,191,071.80 | 68,353,390.71 | 827,417,838.04 |
| 上年度末 2015年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 负债 | | | | | |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|--------------------|---|
| 假设 | 除市场利率意外的其他市场变量保持不变 | |
| 分析 | 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（2016年12月31日） |
| | 1、市场利率下降 25 个基点 | 3,774,018.63 |
| | 2、市场利率上升 25 个基点 | -3,754,859.35 |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金投资于股票的资金占基金资产的比例为 0%-95%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 57,980,937.60 | 7.01 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - |
| 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 | 57,980,937.60 | 7.01 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准意外的其他市场变量保持不变 | | |
|---------------|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 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（2016 年 12 月 31 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | 1、业绩比较基准上升 5% | 5,184,551.58 | - |
| 2、业绩比较基准下降 5% | -5,184,551.58 | - | |

7.4.14 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，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 57,743,230.38 元，划分为第二层级的余额为人民币 788,416,282.22 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 | 57,980,937.60 | 5.72 |
| | 其中：股票 | 57,980,937.60 | 5.72 |
| 2 | 固定收益投资 | 788,178,575.00 | 77.72 |
| | 其中：债券 | 788,178,575.00 | 77.72 |
| | 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 | 128,700,313.05 | 12.69 |
| | 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 | 27,116,805.76 | 2.67 |
| 7 | 其他各项资产 | 12,121,047.32 | 1.20 |
| 8 | 合计 | 1,014,097,678.73 | 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 | 22,724,565.37 | 2.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 3,625,592.23 | 0.44 |
| F | 批发和零售业 | 2,770,000.00 | 0.33 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,664,000.00 | 0.68 |
| 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 | 23,196,780.00 | 2.80 |
| 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 | 57,980,937.60 | 7.01 |

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 300,000 | 10,629,000.00 | 1.28 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 2,000,000 | 8,820,000.00 | 1.07 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 800,000 | 5,664,000.00 | 0.68 |
| 4 | 002202 | 金风科技 | 300,000 | 5,133,000.00 | 0.62 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 15,000 | 5,012,250.00 | 0.61 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 250,000 | 4,400,000.00 | 0.53 |
| 7 | 600104 | 上汽集团 | 150,000 | 3,517,500.00 | 0.43 |
| 8 | 601258 | 庞大集团 | 1,000,000 | 2,770,000.00 | 0.33 |
| 9 | 601288 | 农业银行 | 650,000 | 2,015,000.00 | 0.24 |
| 10 | 600068 | 葛洲坝 | 200,000 | 1,838,000.00 | 0.22 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 200,000 | 1,772,000.00 | 0.21 |
| 12 | 601009 | 南京银行 | 150,000 | 1,626,000.00 | 0.20 |
| 13 | 600741 | 华域汽车 | 100,000 | 1,595,000.00 | 0.19 |
| 14 | 002508 | 老板电器 | 30,000 | 1,104,000.00 | 0.13 |
| 15 | 600066 | 宇通客车 | 50,000 | 979,500.00 | 0.12 |
| 16 | 600332 | 白云山 | 21,400 | 513,172.00 | 0.06 |
| 17 | 601375 | 中原证券 | 26,695 | 106,780.00 | 0.01 |
| 18 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641 | 88,403.48 | 0.01 |
| 19 | 603218 | 日月股份 | 1,652 | 68,805.80 | 0.01 |
| 20 | 603877 | 太平鸟 | 3,180 | 67,734.00 | 0.01 |
| 21 | 603416 | 信捷电气 | 1,076 | 53,886.08 | 0.01 |
| 22 | 603886 | 元祖股份 | 2,242 | 39,683.40 | 0.00 |
| 23 | 300582 | 英飞特 | 1,359 | 35,157.33 | 0.00 |
| 24 | 603239 | 浙江仙通 | 924 | 29,059.80 | 0.00 |
| 25 | 002835 | 同为股份 | 1,126 | 24,220.26 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 26 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | 0.00 |
| 27 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | 0.00 |
| 28 | 002840 | 华统股份 | 1,814 | 11,881.70 | 0.00 |
| 29 | 002838 | 道恩股份 | 682 | 10,420.96 | 0.00 |
| 30 | 300586 | 美联新材 | 1,006 | 9,355.80 | 0.00 |
| 31 | 300591 | 万里马 | 2,396 | 7,355.72 | 0.00 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1 | 000001 | 平安银行 | 20,497,000.00 | 2.48 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 17,988,519.30 | 2.17 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 15,613,460.20 | 1.89 |
| 4 | 601857 | 中国石油 | 9,636,300.00 | 1.16 |
| 5 | 601006 | 大秦铁路 | 8,413,391.00 | 1.02 |
| 6 | 601668 | 中国建筑 | 6,870,400.00 | 0.83 |
| 7 | 002202 | 金风科技 | 5,511,820.02 | 0.67 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 4,883,218.00 | 0.59 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 4,476,921.00 | 0.54 |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 3,701,500.00 | 0.45 |
| 11 | 002594 | 比亚迪 | 3,581,879.80 | 0.43 |
| 12 | 002196 | 方正电机 | 3,460,200.00 | 0.42 |
| 13 | 601258 | 庞大集团 | 2,890,000.00 | 0.35 |
| 14 | 000725 | 京东方 A | 2,887,500.00 | 0.35 |
| 15 | 000858 | 五粮液 | 2,268,134.00 | 0.27 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 2,190,000.00 | 0.26 |
| 17 | 601288 | 农业银行 | 2,047,500.00 | 0.25 |
| 18 | 601336 | 新华保险 | 1,958,000.00 | 0.24 |
| 19 | 600068 | 葛洲坝 | 1,664,000.00 | 0.20 |
| 20 | 600741 | 华域汽车 | 1,597,000.00 | 0.19 |

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------------|-----------------|
| 1 | 000001 | 平安银行 | 20,842,200.00 | 2.52 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 9,567,700.00 | 1.16 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 9,218,517.10 | 1.11 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 8,950,823.00 | 1.08 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 5,524,150.00 | 0.67 |
| 6 | 000725 | 京东方 A | 3,350,000.00 | 0.40 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 3,052,874.00 | 0.37 |
| 8 | 002196 | 方正电机 | 2,956,696.94 | 0.36 |
| 9 | 601006 | 大秦铁路 | 2,687,500.00 | 0.32 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 2,478,000.00 | 0.30 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 2,467,000.00 | 0.30 |
| 12 | 601336 | 新华保险 | 2,125,563.00 | 0.26 |
| 13 | 002271 | 东方雨虹 | 1,393,200.00 | 0.17 |
| 14 | 002367 | 康力电梯 | 1,368,286.28 | 0.17 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 1,274,596.33 | 0.15 |
| 16 | 600168 | 武汉控股 | 1,084,000.00 | 0.13 |
| 17 | 002202 | 金风科技 | 852,500.00 | 0.10 |
| 18 | 600909 | 华安证券 | 567,488.80 | 0.07 |
| 19 | 000786 | 北新建材 | 531,500.00 | 0.06 |
| 20 | 002245 | 澳洋顺昌 | 465,500.00 | 0.06 |

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 | 135,528,984.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 88,328,063.55 |

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 | 29,883,000.00 | 3.61 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,243,000.00 | 1.24 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,243,000.00 | 1.24 |
| 4 | 企业债券 | 357,595,804.00 | 43.22 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 159,646,000.00 | 19.29 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,797,771.00 | 0.22 |
| 8 | 同业存单 | 229,013,000.00 | 27.68 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 788,178,575.00 | 95.26 |

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 | 111619095 | 16 恒丰银行 CD095 | 500,000 | 49,250,000.00 | 5.95 |
| 2 | 111619219 | 16 恒丰银行 CD219 | 500,000 | 48,950,000.00 | 5.92 |
| 3 | 111616159 | 16 上海银行 CD159 | 500,000 | 48,225,000.00 | 5.83 |
| 4 | 111693972 | 16 广州农村商业银行 CD077 | 500,000 | 48,195,000.00 | 5.82 |
| 5 | 122458 | 15 泛海 02 | 450,000 | 44,923,500.00 | 5.43 |

8.7 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。

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 | 68,753.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息 | 11,802,293.80 |
| 5 | 应收申购款 | 250,000.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,121,047.32 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|---------------|
| 1 | 127003 | 海印转债 | 746,566.80 | 0.09 |

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 |
| 安信新回报混合 A | 212 | 3,620,817.70 | 759,342,959.68 | 98.92% | 8,270,392.72 | 1.08% |
| 安信新回报混合 C | 274 | 110,913.09 | 189,753.32 | 0.62% | 30,200,432.45 | 99.38% |
| 合计 | 486 | 1,641,982.59 | 759,532,713.00 | 95.18% | 38,470,825.17 | 4.82% |

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 | 安信新回报混合 A | 68,178.81 | 0.0089% |
| | 安信新回报混合 C | 3,000.51 | 0.0099% |
| | 合计 | 71,179.32 | 0.0089% |

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 | 安信新回报混合 A | 0 |
| | 安信新回报混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 安信新回报混合 A | 0~10 |
| | 安信新回报混合 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 安信新回报混合 A | 安信新回报混合 C |
|------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2016 年 5 月 9 日）基金份额总额 | 500,954,878.03 | 129,021.25 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 271,602,354.61 | 67,546,633.80 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 4,943,880.24 | 37,285,469.28 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 767,613,352.40 | 30,390,185.77 |

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。

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 1 年，本报告期应支付的报酬为人民币 80,000 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 | |
| 申银万国 | 2 | 221,416,154.87 | 100.00% | 157,491.76 | 100.00% | - |

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 | |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|
| | 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 |
| 申银万国 | 438,873,050.35 | 100.00% | 20,385,000,000.00 | 100.00% |

11.8 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 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告 | 证券时报 | 2016年4月30日 |
| 2 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要 | 证券时报 | 2016年4月30日 |
| 3 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 | 证券时报 | 2016年4月30日 |
| 4 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告 | 证券时报 | 2016年5月6日 |
| 5 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 证券时报 | 2016年5月10日 |
| 6 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年5月11日 |
| 7 | 关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年5月11日 |
| 8 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年5月18日 |
| 9 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持万家文化估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年5月19日 |

| | | | |
|----|---|------------------|------------|
| 10 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持苏交科、天通股份估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年6月1日 |
| 11 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年6月15日 |
| 12 | 关于暂停安信新回报灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年6月15日 |
| 13 | 安信基金管理有限责任公司关于调整开户证件类型的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年6月18日 |
| 14 | 安信基金关于变更基金直销账户信息的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年6月20日 |
| 15 | 安信基金管理有限责任公司关于上海陆金所资产管理有限公司公司名称的更正公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年7月1日 |
| 16 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加泰信财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年7月12日 |
| 17 | 关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告（第一创业） | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年7月15日 |
| 18 | 关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年7月15日 |
| 19 | 关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告（珠海盈米） | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年7月15日 |
| 20 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下西藏城投估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年8月9日 |
| 21 | 关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年8月12日 |
| 22 | 安信基金关于调整旗下基金申购与赎回数额限制以及最低持有份额的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016年8月29日 |
| 23 | 关于恢复安信新回报灵活配 | 上海证券报、中国证 | 2016年9月8日 |

| | | | |
|----|---|------------------|------------------|
| | 置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告 | 券报、证券时报 | |
| 24 | 关于暂停安信新回报灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 9 月 22 日 |
| 25 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 9 月 28 日 |
| 26 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 10 月 24 日 |
| 27 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下常宝股份估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 10 月 25 日 |
| 28 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 10 月 25 日 |
| 29 | 安信基金管理有限责任公司新平台上线的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 10 月 28 日 |
| 30 | 关于新增销售服务机构为我司旗下基金代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 31 | 安信基金管理有限责任公司关于开通电子直销交易平台汇款交易业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 11 月 25 日 |
| 32 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 11 月 30 日 |
| 33 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下安洁科技估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 12 月 13 日 |
| 34 | 关于安信基金管理有限责任公司参加代销机构费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 12 月 14 日 |
| 35 | 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号） | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 12 月 24 日 |
| 36 | 关于新增销售服务机构为我司旗下基金代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016 年 12 月 29 日 |

§ 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新回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新回报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

安信基金管理有限责任公司

地址：中国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

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
2017 年 3 月 27 日