

# 安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 7 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,594,398.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种投资策略，深入挖掘和把握市场投资机会，分享中国经济增长和资本市场发展的成果，力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在经济“新常态”的背景下，动态运用多种策略，实现基金资产长期稳定增值。资产配置上，基于宏观、政策及市场分析，将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间，股票投资方面，客观分析在“新常态”背景下行业景气度和发展前景、行业竞争结构和盈利模式，充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会；债券投资方面，利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合，并注重信用风险的控制；此外，本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% + 中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人 姓名	乔江晖	郭明

	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798

## 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 8 月 7 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,368,283.32	5,948,505.69
本期利润	-3,554,883.58	6,288,310.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0993	0.0655
本期基金份额净值增长率	-15.89%	12.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0583	0.1148
期末基金资产净值	24,103,124.18	36,398,831.34
期末基金份额净值	0.942	1.120

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

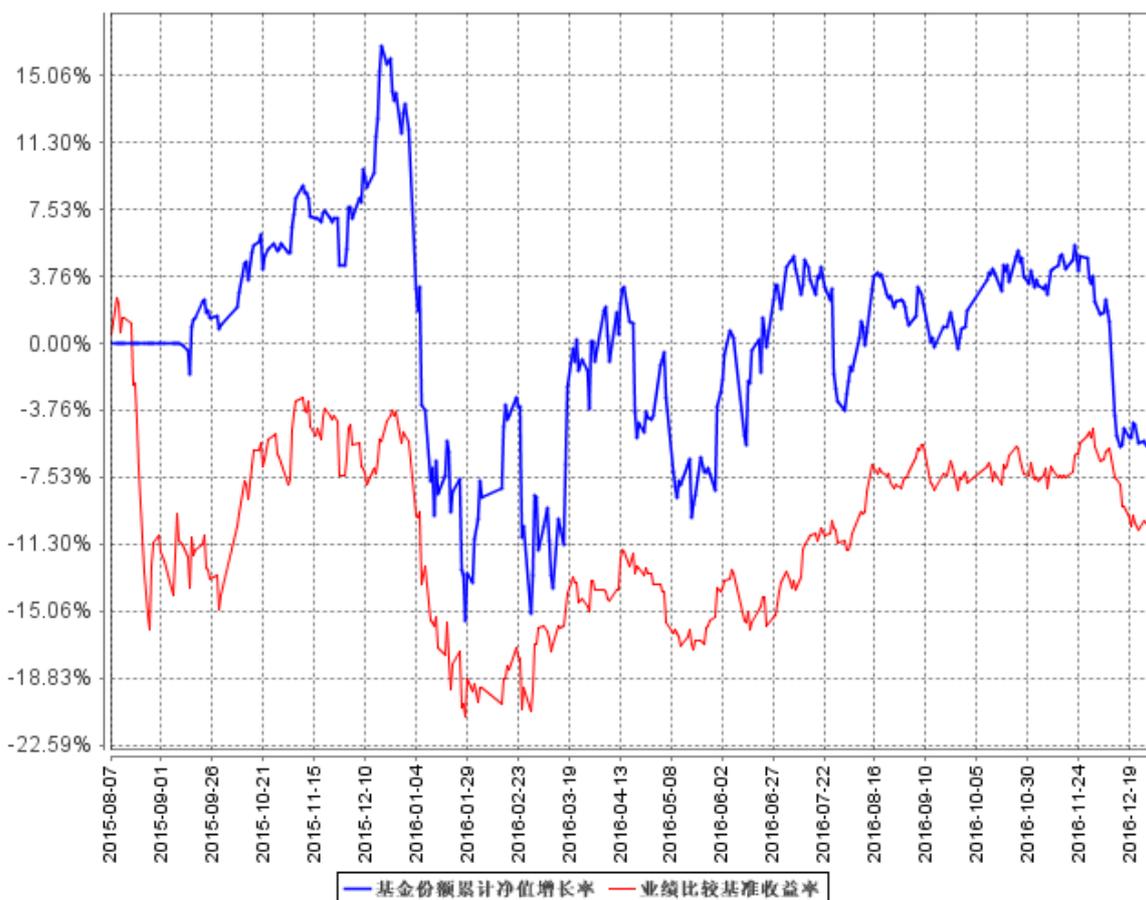
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.47%	0.94%	-1.91%	0.62%	-5.56%	0.32%
过去六个月	-8.19%	0.99%	5.01%	0.64%	-13.20%	0.35%
过去一年	-15.89%	1.86%	-4.34%	1.01%	-11.55%	0.85%
自基金合同生效起至今	-5.80%	1.63%	-9.62%	1.19%	3.82%	0.44%

注：根据《安信新常态沪港深精选股票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：45%×沪深 300 指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率。

#### 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

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

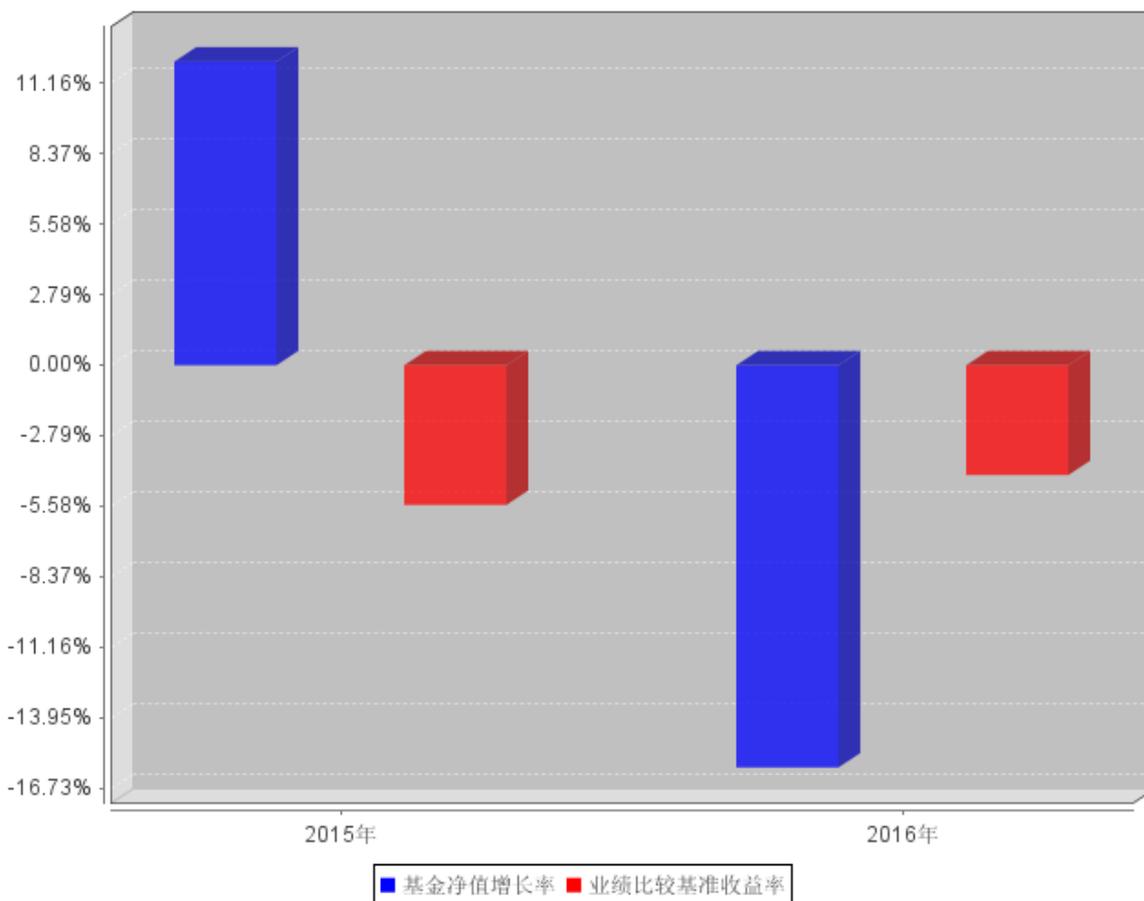


注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 7 日，。图示日期为 2015 年 8 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金的建仓期为 2015 年 8 月 7 日至 2016 年 2 月 6 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。

### 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

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 2015 年 8 月 7 日，图示日期为 2015 年 8 月 7 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 2015 年 8 月 7 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	2015 年 11 月	-	9	蓝雁书先生，理学硕士。

	基金经理	2 日			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	2016 年 4 月 11 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。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015 年 12 月 11 日	2016 年 3 月 9 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。进入 3 月份，随着注册制与战略新兴板的推行节奏突然放缓，与此同时，新股发行规模严格受控且发行方式不再会引发大量的资金冻结，使得市场再度青睐前期调整较大的小市值成长股，因此创业板在 3 月份领涨 A 股市场。1-2 月份期间，本基金调仓较为果断，选择大幅降低了成长股以及创业板的配置，加大了对地产、建筑、核电、军工等板块的配置，一定程度上回避了高估值成长股的整体大幅下跌。2 月底至 3 月初，考虑到地产板块火热的背后有诸多不健康因素（例如：1）向三四线城市价格传导不顺畅；2）高房价对实体产业的正常运营发展构成了威胁；3）短期杠杆资金入市；4）一线城市政府加大限购力度等），也考虑到注册制与战略新三板相关政策调整可能引发的市场风格切换，以及展望到谷歌人机大战可能造成的社会效应，本基金再次出现配置上的重大调整，大幅降低了地产板块的配置，提高了对新能源汽车、大数据、云计算以及人工智能相关领域的配置，从而较快的跟上了市场反弹的主流节奏。

2016 年二季度，A 股市场整体表现平稳，但结构上出现了剧烈分化。由于经济数据不断走弱，市场监管也趋于严格，权威人士讲话扭转了之前市场对经济复苏的乐观预期，加上外围市场的各种风险因素暴露，使得市场充斥着较强的避险情绪。一季度先后表现抢眼的强周期股与网络科技股在二季度均出现了较大的调整，与此同时，具备天然避险属性的黄金股、低估值且成长稳健的蓝筹股以及受强劲基本面拉动的新能源汽车相关个股的表现抢眼。一季度末至二季度初，本基金管理人意识到了周期股与科技股可能面临的上述风险，并及时降低了相应的持仓比例。进一步，我们判断房地产整体向下趋势不变，为了稳定经济表现，由国家主导的基础设施建设强度会维持较高增长，因此在新一轮的布局中，我们运用了较高的仓位集中配置在基建与环保方向。然而，尽管基础设施建设如我们预期的表现相对强劲，在整个固定资产投资中一枝独秀，但市场并没有给这类传统行业足够的重视，甚至在市场大幅调整的过程中，我们的大部分持仓没有表现出我们

预期中的抗跌能力，因此本基金在四月份表现较差。进入五月份之后，我们开始重新梳理市场的成长股逻辑，并开始将一部分质地相对较差的基建股转向计算机与电子行业的一些新兴子版块，并取得了较好的收益，弥补了 4 月份的损失，使得本基金最终在二季度取得了相对良好的收益。

2016 年下半年，A 股市场整体表现平稳，结构上继续出现分化，主板表现较好，中小板与创业板表现较差。整体市场风格偏保守，成交量依旧在低位徘徊，低估值且增长超预期的板块个股表现较好，其中尤其以基建、环保为代表的 PPP 主题得到市场追捧，表现抢眼。整个下半年，我们维持了此前一贯的判断，认为房地产整体向下的大趋势不变。为稳定经济表现，由政府主导的基础设施建设强度会维持较高增长，因此在早期的布局中，我们运用了较高的仓位集中配置在基建与环保方向。然而，如前所述，由于迟迟未见表现，我们过早的在二季度末大幅度的削减了 PPP 的持仓，增加了对计算机与电子行业的配置。然而，进入下半年后，市场开始追捧 PPP 主题，相关个股出现普涨，由于我们之前已经降低了 PPP 主题的仓位以及相关个股获利了结得比较早，因此对本基金净值的贡献的比较有限。另外，由于本基金加大了对高估值成长股的配置，因此整体上，下半年本基金表现不佳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.942 元，本报告期份额净值增长率为-15.89%，同期业绩比较基准增长率为-4.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前无论是国内局势还是整个国际局势，都呈现为一种纠缠的状态，决定性、趋势性的力量依然没有凸显出来。一方面货币宽松背景下经济整体起色并不大，另外一方面，大宗商品由于供给侧的调整时间较长，纷纷大幅反弹，因此总体上出现了轻微的滞胀。

伴随着国内继续实施稳健的货币政策与积极的财政政策，我们认为资金面在边际上不会更加宽松，但是利率整体还会维持在相对较低水平，一方面原因在于目前市场上最活跃的 PPP 融资类主体项目收益率普遍较低、项目期限普遍较长，因此对资金成本的承受力非常有限，另一方面收益率较高的房地产项目又因为受到国家政策的不断打压以及对未来市场的谨慎态度，使得有资金成本承受力的房地产开发商对资金的需求热情不高。

总体上，我们预计后期国内的经济会有所企稳，通胀会略有抬头，资金面会略有收紧，利率会有所上行但幅度不会太大。房地产在市场与政策的双重压力下会有所降温，A 股的吸引力会有所提升，市场有望继续保持整体平稳。在具体投资标的上，我们认为市场风格不会很快转换，但会往相对均衡的方向逐步转变，在经历了估值的持续调整后，我们坚信成长股的时间价值将会显

现出来。我们将在 AH 股市场范围内，遵循最优风险收益比原则，围绕着景气度高、市场预期差较大的产业做重点布局，其中包括以供给创造需求的教育、医疗、区块链、人工智能、中游制造、高端制造、消费电子等板块，同时关注国企改革与供给侧改革出现显著成效的传统领域。

#### 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，本基金出现了基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形，时间范围为 2016 年 2 月 5 日至 2016 年 4 月 26 日、2016 年 5 月 9 日至 2016 年 7 月 25 日、2016 年 8 月 17 日至 2016 年 11 月 4 日、2016 年 11 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日。

## **§ 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，本基金托管人在对安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

### **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**

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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_H16

### 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	安信新常态沪港深精选股票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常态沪港深精选股票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，公允反映了安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金 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：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	3,267,609.77	6,219,124.29
结算备付金	207,238.25	593,866.97
存出保证金	34,418.53	44,595.50
交易性金融资产	21,034,381.52	30,656,233.90
其中：股票投资	21,034,381.52	30,656,233.90
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	269,888.90
应收利息	909.34	2,245.84
应收股利	-	57.59
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	24,544,557.41	37,786,012.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	-	0.01
应付赎回款	9,252.09	1,097,149.65
应付管理人报酬	31,822.98	49,548.93
应付托管费	5,303.80	8,258.18

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	45,044.26	180,506.33
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	350,010.10	51,718.55
负债合计	441,433.23	1,387,181.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	25,594,398.57	32,513,371.87
未分配利润	-1,491,274.39	3,885,459.47
所有者权益合计	24,103,124.18	36,398,831.34
负债和所有者权益总计	24,544,557.41	37,786,012.99

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.942 元，基金份额总额 25,594,398.57 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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 8 月 7 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-1,860,662.30	7,570,962.30
1. 利息收入	50,504.99	474,225.91
其中：存款利息收入	50,504.99	130,194.00
债券利息收入	-	89.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	343,942.05
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-309,520.45	6,035,001.57
其中：股票投资收益	-389,308.03	5,909,601.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	125,342.14
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	79,787.58	57.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,186,600.26	339,804.63

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	584,953.42	721,930.19
<b>减：二、费用</b>	<b>1,694,221.28</b>	<b>1,282,651.98</b>
1. 管理人报酬	526,218.55	606,700.65
2. 托管费	87,703.08	101,116.76
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	710,158.90	431,588.60
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	370,140.75	143,245.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-3,554,883.58</b>	<b>6,288,310.32</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-3,554,883.58</b>	<b>6,288,310.32</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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）	32,513,371.87	3,885,459.47	36,398,831.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,554,883.58	-3,554,883.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,918,973.30	-1,821,850.28	-8,740,823.58
其中：1. 基金申购款	94,834,633.25	-1,983,032.77	92,851,600.48
2. 基金赎回款	-101,753,606.55	161,182.49	-101,592,424.06
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）	25,594,398.57	-1,491,274.39	24,103,124.18
项目	上年度可比期间 2015 年 8 月 7 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）	224,723,362.19	-	224,723,362.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,288,310.32	6,288,310.32
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）	-192,209,990.32	-2,402,850.85	-194,612,841.17
其中：1. 基金申购款	2,331,268.21	177,775.25	2,509,043.46
2. 基金赎回款	-194,541,258.53	-2,580,626.10	-197,121,884.63
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）	32,513,371.87	3,885,459.47	36,398,831.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领
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

安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金（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6月15日下发的证监许可[2015]1248号文《关于核准安信新常态沪港深精选股票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《安信新常态沪港深精选股票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7月2日至2015年8月3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\_H87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224,675,782.53元。经向中国证监会备案，《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》于2015年8月7日正式生效。截至2015年8月7日止，安信新常态沪港深精选股票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 224,675,782.53 元,折合 224,675,782.53 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 47,579.66 元,折合 47,579.66 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 224,723,362.19 元,折合 224,723,362.19 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金各类资产投资比例为:本基金股票投资比例为基金资产的 80%-95%(其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的 0-95%),基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*45%+恒生指数收益率\*45%+中证全债指数收益率\*10%

#### 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

本基金本报告期无需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。

#### 7.4.6.4 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.8.1.5 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 8 月 7 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	526, 218. 55	606, 700. 65
其中：支付销售机构的客户维护费	169, 959. 82	229, 692. 98

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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 8 月 7 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	87, 703. 08	101, 116. 76

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

### 7.4.8.3 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。

### 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

本基金的管理人于本期末未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 7 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
中国工商银行	3,267,609.77	44,748.78	6,219,124.29	115,146.66

注：本基金资金托管账户的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 7.4.9.2 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	股票	停牌日	停牌	期末	复牌日	复牌	数量(股)	期末	期末估值总	备注
----	----	-----	----	----	-----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	期	原因	估值单 价	期	开盘单 价		成本总额	额	
002635	安洁科 技	2016 年 11 月 8 日	重大事 项	33.74	2017 年 2 月 8 日	33.50	39,400	1,363,105.00	1,329,356.00	-
300367	东方网 力	2016 年 12 月 15 日	重大事 项	20.04	-	-	61,681	1,575,084.42	1,236,087.24	-

### 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 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, 本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 18,364,134.28 元, 划分为第二层级的余额为人民币 2,670,247.24 元、第三层级无余额。(于 2015 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 30,656,233.90 元, 无划分为第二层级、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	21,034,381.52	85.70
	其中：股票	21,034,381.52	85.70
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,474,848.02	14.16
7	其他各项资产	35,327.87	0.14
8	合计	24,544,557.41	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	1,197,639.27	4.97
C	制造业	14,297,509.54	59.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	810,446.00	3.36
F	批发和零售业	271,589.76	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	147,659.60	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,704,916.39	11.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	598,015.11	2.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	754,145.60	3.13
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	252,460.25	1.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,034,381.52	87.27

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：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	002230	科大讯飞	67,161	1,819,391.49	7.55
2	601965	中国汽研	134,802	1,435,641.30	5.96
3	000709	河钢股份	419,189	1,400,091.26	5.81
4	002635	安洁科技	39,400	1,329,356.00	5.52

5	002466	天齐锂业	40,779	1,323,278.55	5.49
6	300367	东方网力	61,681	1,236,087.24	5.13
7	300054	鼎龙股份	56,456	1,233,563.60	5.12
8	600570	恒生电子	18,785	885,524.90	3.67
9	002049	紫光国芯	26,000	856,440.00	3.55
10	000498	山东路桥	102,200	810,446.00	3.36

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	300054	鼎龙股份	7,808,325.76	21.45
2	002643	万润股份	7,063,781.40	19.41
3	002466	天齐锂业	6,684,628.02	18.36
4	300367	东方网力	6,335,055.59	17.40
5	002230	科大讯飞	5,523,313.18	15.17
6	600570	恒生电子	5,508,794.00	15.13
7	300463	迈克生物	5,461,876.79	15.01
8	300203	聚光科技	5,272,868.00	14.49
9	000697	炼石有色	5,236,966.72	14.39
10	000709	河钢股份	5,079,356.00	13.95
11	300284	苏交科	4,703,926.93	12.92
12	300070	碧水源	4,598,508.34	12.63
13	601965	中国汽研	4,419,208.18	12.14
14	002444	巨星科技	4,261,362.09	11.71
15	300078	思创医惠	4,179,375.20	11.48
16	300124	汇川技术	4,133,414.88	11.36
17	000762	西藏矿业	4,117,271.99	11.31
18	300190	维尔利	3,862,656.45	10.61
19	300224	正海磁材	3,768,336.00	10.35
20	002310	东方园林	3,683,257.00	10.12
21	300439	美康生物	3,625,382.81	9.96
22	300012	华测检测	3,524,276.00	9.68
23	300033	同花顺	3,375,137.00	9.27

24	000959	首钢股份	3,267,939.05	8.98
25	600048	保利地产	2,994,692.00	8.23
26	600172	黄河旋风	2,988,989.53	8.21
27	000858	五粮液	2,944,897.98	8.09
28	002172	澳洋科技	2,778,162.00	7.63
29	300425	环能科技	2,772,156.00	7.62
30	600978	宜华生活	2,686,818.00	7.38
31	002478	常宝股份	2,681,531.00	7.37
32	601012	隆基股份	2,658,826.75	7.30
33	300197	铁汉生态	2,551,046.20	7.01
34	600820	隧道股份	2,426,454.00	6.67
35	601199	江南水务	2,421,134.00	6.65
36	603308	应流股份	2,397,472.00	6.59
37	300145	中金环境	2,389,476.00	6.56
38	300055	万邦达	2,370,850.58	6.51
39	002467	二六三	2,264,757.00	6.22
40	600313	农发种业	2,250,253.00	6.18
41	600519	贵州茅台	2,192,661.44	6.02
42	300143	星河生物	2,149,124.93	5.90
43	002167	东方锆业	2,129,801.00	5.85
44	600497	驰宏锌锗	1,963,025.00	5.39
45	600161	天坛生物	1,950,627.00	5.36
46	600884	杉杉股份	1,940,396.37	5.33
47	300327	中颖电子	1,917,151.11	5.27
48	002116	中国海诚	1,895,481.00	5.21
49	002078	太阳纸业	1,781,719.00	4.89
50	002458	益生股份	1,732,090.00	4.76
51	002318	久立特材	1,710,200.50	4.70
52	603019	中科曙光	1,691,259.00	4.65
53	600559	老白干酒	1,689,519.00	4.64
54	300337	银邦股份	1,678,542.30	4.61
55	601985	中国核电	1,676,511.00	4.61
56	600773	西藏城投	1,648,351.00	4.53
57	002007	华兰生物	1,633,350.00	4.49
58	300281	金明精机	1,610,288.74	4.42
59	601028	玉龙股份	1,591,336.00	4.37

60	300450	先导智能	1,577,844.00	4.33
61	002286	保龄宝	1,547,769.00	4.25
62	600340	华夏幸福	1,529,671.00	4.20
63	600816	安信信托	1,520,280.00	4.18
64	000338	潍柴动力	1,491,318.00	4.10
65	002311	海大集团	1,471,178.00	4.04
66	002117	东港股份	1,464,158.00	4.02
67	600643	爱建集团	1,463,471.00	4.02
68	300212	易华录	1,463,458.00	4.02
69	300007	汉威电子	1,463,215.00	4.02
70	002714	牧原股份	1,434,923.00	3.94
71	000402	金融街	1,410,704.00	3.88
72	002635	安洁科技	1,363,105.00	3.74
73	300128	锦富新材	1,345,354.00	3.70
74	000060	中金岭南	1,335,560.00	3.67
75	000777	中核科技	1,297,029.50	3.56
76	300358	楚天科技	1,278,489.00	3.51
77	600114	东睦股份	1,272,565.00	3.50
78	000963	华东医药	1,263,796.00	3.47
79	300294	博雅生物	1,256,695.00	3.45
80	300346	南大光电	1,240,837.31	3.41
81	002074	国轩高科	1,162,914.00	3.19
82	300262	巴安水务	1,143,869.00	3.14
83	002465	海格通信	1,107,854.00	3.04
84	000513	丽珠集团	1,095,663.50	3.01
85	300059	东方财富	1,085,752.00	2.98
86	002196	方正电机	1,078,974.00	2.96
87	600026	中海发展	1,025,385.00	2.82
88	002519	银河电子	1,009,810.61	2.77
89	002701	奥瑞金	1,008,319.00	2.77
90	300458	全志科技	999,485.00	2.75
91	600737	中粮屯河	998,955.80	2.74
92	000009	中国宝安	990,398.00	2.72
93	600675	*ST 中企	976,084.74	2.68
94	600491	龙元建设	972,786.36	2.67
95	300386	飞天诚信	960,305.00	2.64

96	002070	众和股份	953,460.00	2.62
97	600885	宏发股份	882,989.00	2.43
98	300010	立思辰	880,949.00	2.42
99	002407	多氟多	865,646.00	2.38
100	002049	紫光国芯	862,362.20	2.37
101	000410	沈阳机床	857,900.00	2.36
102	002567	唐人神	852,682.00	2.34
103	002477	雏鹰农牧	836,246.65	2.30
104	300481	濮阳惠成	815,850.00	2.24
105	002244	滨江集团	777,749.00	2.14
106	600054	黄山旅游	769,265.12	2.11
107	603993	洛阳钼业	765,438.00	2.10
108	300150	世纪瑞尔	761,402.92	2.09
109	000498	山东路桥	759,016.00	2.09
110	300406	九强生物	757,355.00	2.08
111	300236	上海新阳	751,322.00	2.06
112	300244	迪安诊断	736,529.00	2.02

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	002466	天齐锂业	7,244,879.44	19.90
2	002643	万润股份	7,078,749.05	19.45
3	300054	鼎龙股份	6,761,291.54	18.58
4	000697	炼石有色	6,595,117.64	18.12
5	300284	苏交科	6,230,447.46	17.12
6	300070	碧水源	5,615,605.07	15.43
7	002230	科大讯飞	5,480,326.67	15.06
8	300203	聚光科技	5,297,485.50	14.55
9	300463	迈克生物	4,746,305.45	13.04
10	600570	恒生电子	4,629,553.56	12.72
11	300078	思创医惠	4,488,557.01	12.33

12	300367	东方网力	4,478,429.36	12.30
13	300124	汇川技术	4,106,777.77	11.28
14	300145	中金环境	4,085,808.27	11.23
15	000709	河钢股份	4,062,408.20	11.16
16	603308	应流股份	4,051,006.94	11.13
17	002310	东方园林	3,900,481.70	10.72
18	300439	美康生物	3,820,828.50	10.50
19	300224	正海磁材	3,702,354.00	10.17
20	000762	西藏矿业	3,675,948.44	10.10
21	300012	华测检测	3,645,437.36	10.02
22	300190	维尔利	3,616,031.72	9.93
23	002070	众和股份	3,476,462.38	9.55
24	002444	巨星科技	3,363,964.91	9.24
25	300033	同花顺	3,170,281.87	8.71
26	000959	首钢股份	3,110,122.48	8.54
27	600048	保利地产	3,102,765.24	8.52
28	002172	澳洋科技	3,082,330.33	8.47
29	601965	中国汽研	3,067,947.57	8.43
30	000858	五粮液	3,016,293.25	8.29
31	600172	黄河旋风	3,005,515.75	8.26
32	601012	隆基股份	2,797,429.65	7.69
33	300425	环能科技	2,690,123.68	7.39
34	300055	万邦达	2,608,112.24	7.17
35	300197	铁汉生态	2,528,969.55	6.95
36	600978	宜华生活	2,454,019.96	6.74
37	002167	东方锆业	2,363,236.80	6.49
38	002467	二六三	2,305,413.33	6.33
39	601199	江南水务	2,297,024.16	6.31
40	600820	隧道股份	2,256,528.18	6.20
41	600313	农发种业	2,238,399.62	6.15
42	600161	天坛生物	2,220,932.99	6.10
43	300143	星河生物	2,178,001.28	5.98
44	002478	常宝股份	2,164,429.55	5.95
45	600519	贵州茅台	2,155,322.52	5.92
46	002519	银河电子	2,008,871.65	5.52
47	600497	驰宏锌锗	1,990,052.19	5.47
48	300327	中颖电子	1,929,968.29	5.30
49	600884	杉杉股份	1,877,449.86	5.16

50	002078	太阳纸业	1,811,347.30	4.98
51	002116	中国海诚	1,751,593.43	4.81
52	002286	保龄宝	1,750,103.52	4.81
53	300337	银邦股份	1,744,085.10	4.79
54	002007	华兰生物	1,732,931.01	4.76
55	000516	国际医学	1,715,134.00	4.71
56	002318	久立特材	1,711,059.18	4.70
57	600559	老白干酒	1,698,690.65	4.67
58	002458	益生股份	1,698,470.00	4.67
59	603019	中科曙光	1,643,579.44	4.52
60	300281	金明精机	1,592,512.00	4.38
61	601985	中国核电	1,586,973.63	4.36
62	600643	爱建集团	1,582,522.85	4.35
63	600816	安信信托	1,532,280.55	4.21
64	000338	潍柴动力	1,520,952.00	4.18
65	600340	华夏幸福	1,520,512.53	4.18
66	000060	中金岭南	1,515,790.00	4.16
67	300128	锦富新材	1,504,164.00	4.13
68	601028	玉龙股份	1,475,827.00	4.05
69	300007	汉威电子	1,470,175.00	4.04
70	002311	海大集团	1,468,005.08	4.03
71	002117	东港股份	1,459,103.28	4.01
72	002171	楚江新材	1,458,880.00	4.01
73	000061	农产品	1,422,303.00	3.91
74	000402	金融街	1,393,336.82	3.83
75	300294	博雅生物	1,374,272.37	3.78
76	002714	牧原股份	1,371,899.00	3.77
77	300450	先导智能	1,371,198.00	3.77
78	002460	赣锋锂业	1,346,995.40	3.70
79	002196	方正电机	1,332,072.58	3.66
80	300212	易华录	1,325,900.00	3.64
81	600114	东睦股份	1,293,892.00	3.55
82	000777	中核科技	1,293,446.99	3.55
83	000963	华东医药	1,240,770.00	3.41
84	002729	好利来	1,212,671.00	3.33
85	300358	楚天科技	1,183,459.06	3.25
86	002010	传化智联	1,175,886.00	3.23
87	000513	丽珠集团	1,149,089.90	3.16

88	300458	全志科技	1,141,268.00	3.14
89	300059	东方财富	1,125,215.14	3.09
90	002465	海格通信	1,116,303.16	3.07
91	002456	欧菲光	1,073,220.00	2.95
92	600026	中海发展	1,039,600.82	2.86
93	600737	中粮屯河	1,027,307.26	2.82
94	300386	飞天诚信	1,025,285.65	2.82
95	000009	中国宝安	1,021,229.78	2.81
96	300262	巴安水务	1,015,363.00	2.79
97	300346	南大光电	1,014,175.41	2.79
98	002701	奥瑞金	1,002,126.00	2.75
99	300010	立思辰	995,775.19	2.74
100	002407	多氟多	986,400.00	2.71
101	300481	濮阳惠成	963,270.00	2.65
102	600885	宏发股份	961,880.00	2.64
103	600491	龙元建设	927,501.64	2.55
104	600675	*ST 中企	910,868.00	2.50
105	300051	三五互联	883,735.81	2.43
106	002567	唐人神	829,159.00	2.28
107	300150	世纪瑞尔	795,541.00	2.19
108	002244	滨江集团	775,303.97	2.13
109	600054	黄山旅游	775,141.25	2.13
110	600325	华发股份	767,410.36	2.11
111	600773	西藏城投	751,962.28	2.07
112	002477	雏鹰农牧	738,875.00	2.03

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	266,944,949.70
卖出股票收入（成交）总额	273,990,893.79

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除“恒生电子（600570）”在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形外，其它没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2016 年 12 月 14 日公司公告，杭州恒生网络技术服务有限公司（简称恒生网络）明知一些不具有经营证券业务资质的机构或个人的证券经营模式，仍向其销售具有证券业务属性的软件（涉案软件具有开立证券交易账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算等功能），提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第 122 条规定，构成非法经营证券业务。

依据《证券法》第 197 条规定，证监会决定：（1）没收恒生网络违法所得约 10,986 万元，并处以约 32,960 万元罚款；（2）对责任人刘曙峰、官晓岚给予警告，并分别处以 30 万元罚款。

### 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	34,418.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	909.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,327.87

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002635	安洁科技	1,329,356.00	5.52	重大事项
2	300367	东方网力	1,236,087.24	5.13	重大事项

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
404	63,352.47	10,001,250.00	39.08%	15,593,148.57	60.92%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2015 年 8 月 7 日 ) 基金份额总额	224,723,362.19
本报告期期初基金份额总额	32,513,371.87
本报告期基金总申购份额	94,834,633.25

减:本报告期基金总赎回份额	101,753,606.55
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	25,594,398.57

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,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

本报告期内本基金的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 50,000 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	
广发证券		2,324,387,847.79	59.98%	230,736.74	59.44%	-

国泰君安	2	173,964,952.75	32.16%	127,220.82	32.77%	-
华创证券	2	42,502,291.27	7.86%	30,231.47	7.79%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

安信基金管理有限责任公司  
2017 年 3 月 27 日