

# 安信消费医药主题股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	53
8.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
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
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
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 .....	56
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信消费医药主题股票型证券投资基金
基金简称	安信消费医药股票
基金主代码	000974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 19 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	307,473,825.12 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，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。本基金的股票资产主要投资于价值型股票，坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上，分析基础利率的走势，研究利率期限结构和中长期收益率走势，在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金，属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	林葛
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599

传真	0755-82799292	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518026	100031
法定代表人	刘入领	周慕冰

## 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 3 月 19 日 (基金合同生效日)–2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-21,725,105.19	180,588,762.81	-
本期利润	13,638,736.84	164,107,887.19	-
加权平均基金份额本期利润	0.0485	0.2954	-
本期加权平均净值利润率	4.77%	27.51%	-
本期基金份额净值增长率	7.18%	4.50%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配利润	36,768,763.79	13,965,853.50	-
期末可供分配基金份额利润	0.1196	0.0451	-
期末基金资产净值	344,242,588.91	323,492,681.64	-
期末基金份额净值	1.120	1.045	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	12.00%	4.50%	-

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

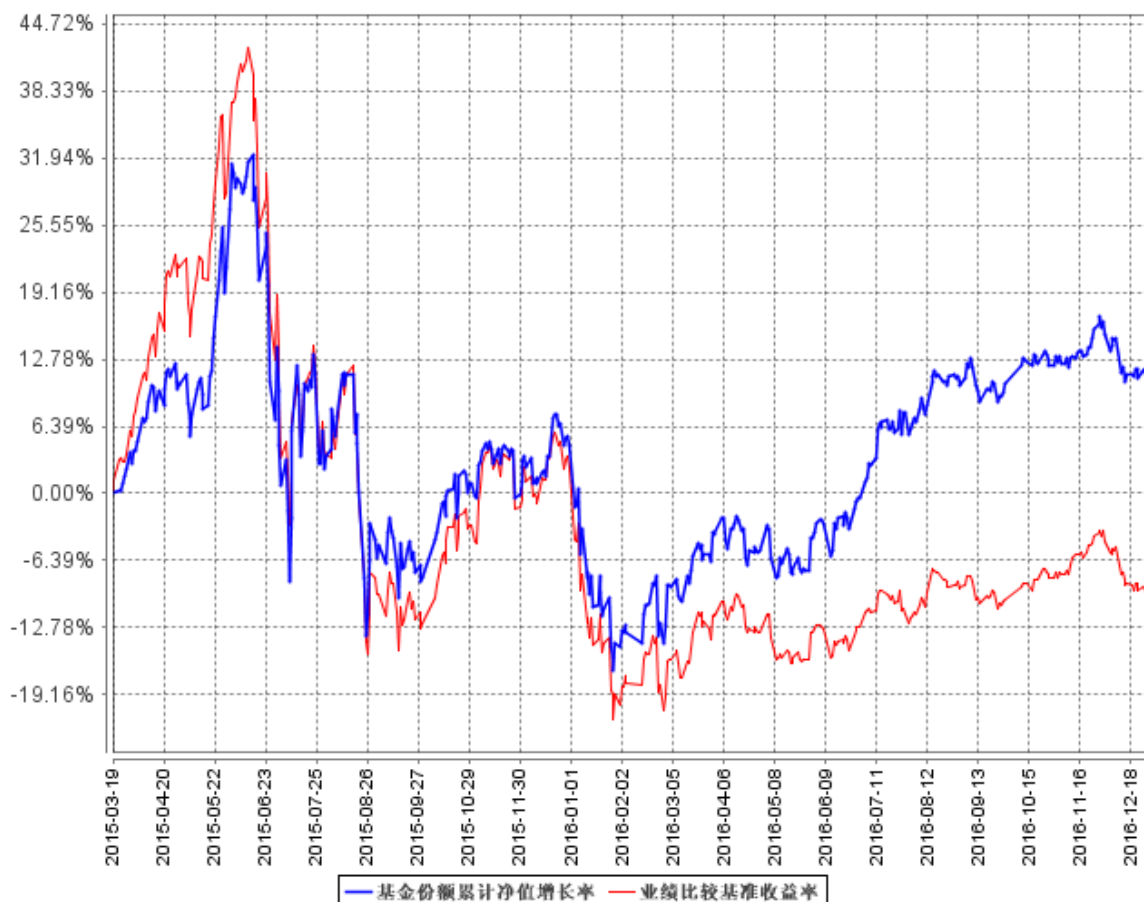
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.45%	0.67%	0.83%	0.64%	0.62%	0.03%
过去六个月	12.45%	0.78%	3.89%	0.70%	8.56%	0.08%
过去一年	7.18%	1.39%	-11.50%	1.37%	18.68%	0.02%
自基金合同生效起至今	12.00%	1.97%	-9.31%	1.89%	21.31%	0.08%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 10\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 03 月 19 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为 2015 年 03 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日间各自的实际数值。

### 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



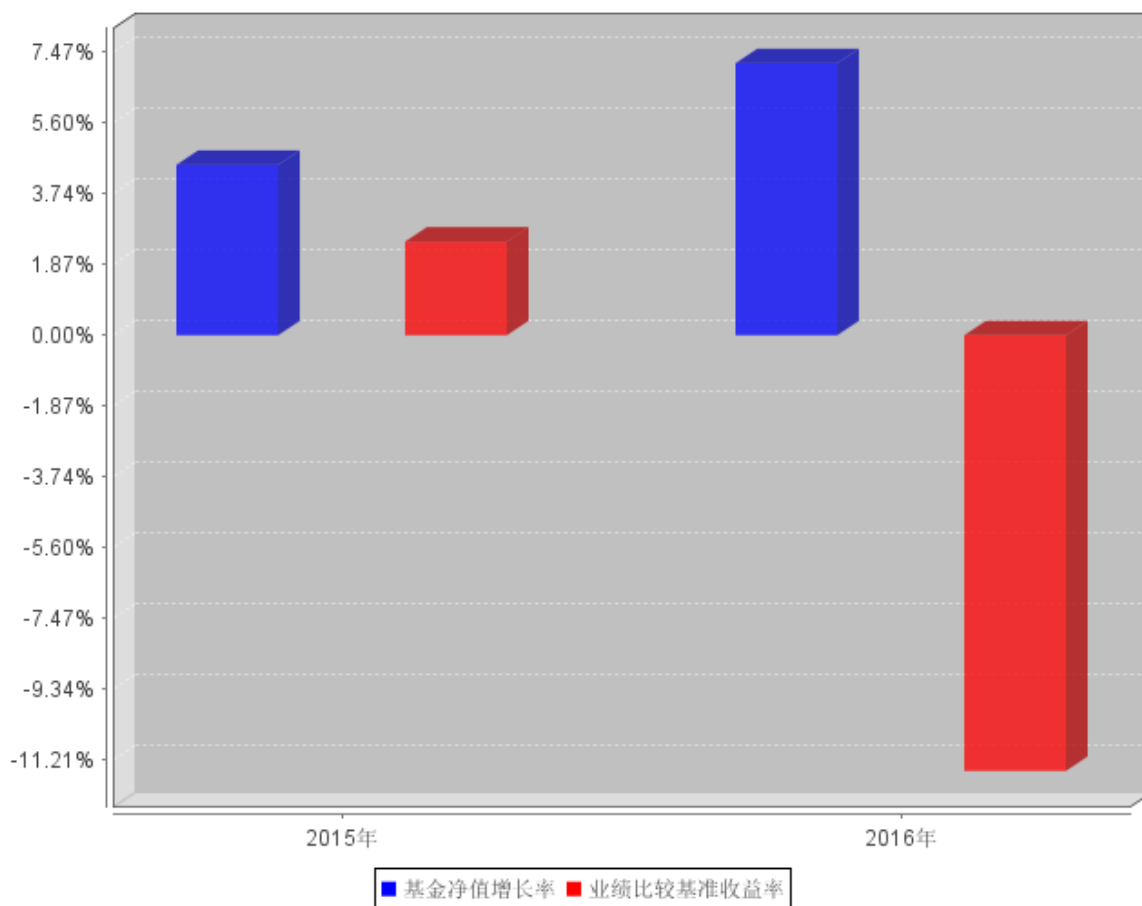
注：1、本基金的建仓期为 2015 年 3 月 19 日至 2015 年 9 月 18 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 19 日。图示日期为 2015 年 3 月 19 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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2016 年 12 月 31 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		
陈一峰	本基金的基金经理	2016 年 3 月 14 日	-	8	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司基

					金投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
姜诚	本基金的基金经理	2015 年 3 月 19 日	2016 年 4 月 7 日	10	姜诚先生，经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理，安信基金管理有限责任公司研究部总经理兼基金投资部总经理。
庄园	本基金的基金经理助理	2015 年 3 月 24 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。
李巍	本基金基金经理助理	2016 年 11 月 21 日	-	4	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。
许杰	本基金基金经理助理	2016 年 8 月 15 日	-	6	许杰先生，理学博士。历任深圳市裕晋投资有

	理				限公司投资研究部研究员、投资经理，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的基金经理助理。
徐立华	本基金的基金经理助理	2015 年 4 月 20 日	2016 年 10 月 13 日	5	徐立华先生，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部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。

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遵规守信情况的说明

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 年年初市场经历了惨烈的熔断之后，一直波动盘升，年末又受到债市去杠杆引起的流动性紧张，市场出现大幅回落。虽然全年市场表现低迷，但我们一直秉承注重基本面和估值的思路精选股票，获得了较为理想的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.12 元，本报告期份额净值增长率为 7.18%，同期业绩比较基准增长率为-11.50%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济在积极财政政策带动下有望继续保持平稳，流动性则难进一步宽松，因此我们对后市维持震荡上升的格局判断。

虽然市场难有大幅度行情，但仍存在结构性机会。由于模式的独特性，消费、医药、高端制造领域容易出现有壁垒的股票，我们会继续挖掘其中有成长性、估值合理的好公司。

## 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—安信基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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_H10 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	安信消费医药主题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消费医药主题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 1 月 1 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，公允反映了安信消费医药主题股票型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 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 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信消费医药主题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	附注号	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	7.4.7.1	17,611,459.19	27,284,904.22
结算备付金		182,261.04	86,968.36
存出保证金		56,369.56	256,420.80
交易性金融资产	7.4.7.2	328,105,301.04	257,534,448.92
其中: 股票投资		312,649,419.84	257,534,448.92
基金投资		-	-
债券投资		15,455,881.20	-
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	-	-
应收证券清算款		-	30,005,608.33
应收利息	7.4.7.5	239,124.20	9,241.10
应收股利		-	-
应收申购款		30,455.68	9,291,344.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		346,224,970.71	324,468,936.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,013,759.37	426,400.44
应付管理人报酬		422,102.45	376,706.86
应付托管费		70,350.42	62,784.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	114,311.88	48,874.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	361,857.68	61,489.28
负债合计		1,982,381.80	976,255.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	307,473,825.12	309,526,828.14
未分配利润	7.4.7.10	36,768,763.79	13,965,853.50
所有者权益合计		344,242,588.91	323,492,681.64

负债和所有者权益总计		346,224,970.71	324,468,936.72
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.120 元，基金份额总额 307,473,825.12 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信消费医药主题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	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 3 月 19 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		20,005,197.71	175,152,880.01
1. 利息收入		263,305.44	2,972,460.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	150,439.77	2,457,520.43
债券利息收入		104,165.68	509,331.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,699.99	5,608.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,014,605.66	182,773,669.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-21,324,149.54	175,225,141.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,400.00	-186,000.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	5,310,943.88	7,734,527.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	35,363,842.03	-16,480,875.62
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	392,655.90	5,887,626.33
<b>减：二、费用</b>		6,366,460.87	11,044,992.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2	4,274,519.75	6,952,285.14
2. 托管费	7.4.10.2	712,420.04	1,158,714.21
3. 销售服务费	7.4.10.2	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	991,158.51	2,627,742.83
5. 利息支出		3,213.01	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,213.01	-
6. 其他费用	7.4.7.21	385,149.56	306,250.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,638,736.84	164,107,887.19

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,638,736.84	164,107,887.19

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信消费医药主题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）	309,526,828.14	13,965,853.50	323,492,681.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,638,736.84	13,638,736.84
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）	-2,053,003.02	9,164,173.45	7,111,170.43
其中：1. 基金申购款	165,879,877.30	16,778,075.14	182,657,952.44
2. 基金赎回款	-167,932,880.32	-7,613,901.69	-175,546,782.01
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）	307,473,825.12	36,768,763.79	344,242,588.91
项目	上年度可比期间 2015 年 3 月 19 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）	1,493,426,867.82	-	1,493,426,867.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	164,107,887.19	164,107,887.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,183,900,039.68	-150,142,033.69	-1,334,042,073.37



括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金各类资产投资比例为:本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%—95%,本基金以消费、医药行业股票为主要投资对象,投资于消费、医药行业股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。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,本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×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 1 月 1 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。

#### 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：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、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以公允价值计量且其变动计入当期损益的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) 基金的固定管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提；本基金的浮动管理费根据每份基金份额在持有期间的年化收益率水平收取，浮动管理费在基金份额持有人赎回/转出基金份额时收取。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提；

(3) 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的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、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。

#### 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、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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	17,611,459.19	27,284,904.22
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	17,611,459.19	27,284,904.22

#### 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	293,724,564.33	312,649,419.84	18,924,855.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,497,770.30	15,455,881.20
	银行间市场	-	-
	合计	15,497,770.30	15,455,881.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	309,222,334.63	328,105,301.04	18,882,966.41

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	274,015,324.54	257,534,448.92	-16,480,875.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	274,015,324.54	257,534,448.92	-16,480,875.62

### 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

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,982.86	9,071.15
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	90.20	43.01
应收债券利息	235,023.20	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	27.94	126.94
合计	239,124.20	9,241.10

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	114,311.88	48,874.01
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	114,311.88	48,874.01

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,857.68	1,489.28
预提费用	360,000.00	60,000.00
合计	361,857.68	61,489.28

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,526,828.14	309,526,828.14
本期申购	165,879,877.30	165,879,877.30
本期赎回（以“-”号填列）	-167,932,880.32	-167,932,880.32
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	307,473,825.12	307,473,825.12

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,545,394.11	-65,579,540.61	13,965,853.50

本期利润	-21,725,105.19	35,363,842.03	13,638,736.84
本期基金份额交易产生的变动数	-783,608.33	9,947,781.78	9,164,173.45
其中：基金申购款	29,061,813.61	-12,283,738.47	16,778,075.14
基金赎回款	-29,845,421.94	22,231,520.25	-7,613,901.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,036,680.59	-20,267,916.80	36,768,763.79

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	142,916.48	525,962.89
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	1,913,388.89
结算备付金利息收入	6,294.80	14,581.84
其他	1,228.49	3,586.81
合计	150,439.77	2,457,520.43

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	369,800,307.23	980,311,078.37
减：卖出股票成本总额	391,124,456.77	805,085,937.14
买卖股票差价收入	-21,324,149.54	175,225,141.23

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,000,000.00	40,567,594.53

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,947,000.00	39,876,000.00
减：应收利息总额	54,400.00	877,594.53
买卖债券差价收入	-1,400.00	-186,000.00

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.17 股利收益

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,310,943.88	7,734,527.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,310,943.88	7,734,527.78

#### 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1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	35,363,842.03	-16,480,875.62
——股票投资	35,405,731.13	-16,480,875.62
——债券投资	-41,889.10	-
——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	35,363,842.03	-16,480,875.62



### 7.4.7.19 其他收入

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	391,591.09	5,845,739.71
转换费收入	1,064.81	41,886.62
合计	392,655.90	5,887,626.33

### 7.4.7.20 交易费用

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	991,158.51	2,627,742.83
银行间市场交易费用	-	-
合计	991,158.51	2,627,742.83

### 7.4.7.21 其他费用

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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	225,000.00
银行划款费用	7,149.56	14,650.64
银行间帐户维护费	18,000.00	6,000.00
其他	-	600.00
合计	385,149.56	306,250.64

## 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
中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）	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。

### 7.4.10 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

金额单位：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 3 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
安信证券	-	-	760,158,472.44	36.92%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
安信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
安信证券	525,013.75	36.96%	-	-

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

### 7.4.10.2 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1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,274,519.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,898,160.72	3,454,804.37

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

#### 7.4.10.2.2 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3月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	712,420.04

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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 7.4.10.4 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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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及上年度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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年3月19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
中国农业银行	17,611,459.19	142,916.48	27,284,904.22	525,962.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 7.4.11 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	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
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	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	1,455	33,697.80	33,697.80	-
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	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
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	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
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	-
300588	熙菱	2016年	2017年	新股流	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

	信息	12月27日	1月5日	通受限						
--	----	--------	------	-----	--	--	--	--	--	--

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	137,757	1,921,614.61	1,899,669.03	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	17,600	425,550.00	456,544.00	-

### 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

### 7.4.13 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 0%，因此本基金无重大信用风险（2015 年 12 月 31 日为 0%）。

#### 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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	-	-

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 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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	15,690,904.40	-
合计	15,690,904.40	-

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。



### 7.4.13.4 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	17,611,459.19	-	-	-	17,611,459.19
结算备付金	182,261.04	-	-	-	182,261.04
存出保证金	56,369.56	-	-	-	56,369.56
交易性金融资产	15,455,881.20	-	-	312,649,419.84	328,105,301.04
应收利息	-	-	-	239,124.20	239,124.20
应收申购款	-	-	-	30,455.68	30,455.68
资产总计	33,305,970.99	-	-	312,918,999.72	346,224,970.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,013,759.37	1,013,759.37
应付管理人报酬	-	-	-	422,102.45	422,102.45
应付托管费	-	-	-	70,350.42	70,350.42
应付交易费用	-	-	-	114,311.88	114,311.88
其他负债	-	-	-	361,857.68	361,857.68
负债总计	-	-	-	1,982,381.80	1,982,381.80
利率敏感度缺口	33,305,970.99	-	-	310,936,617.92	344,242,588.91
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					
银行存款	27,284,904.22	-	-	-	27,284,904.22
结算备付金	86,968.36	-	-	-	86,968.36
存出保证金	256,420.80	-	-	-	256,420.80
交易性金融资产	-	-	-	257,534,448.92	257,534,448.92
应收证券清算款	-	-	-	30,005,608.33	30,005,608.33

应收利息	-	-	9,241.10	9,241.10
应收申购款	-	-	9,291,344.99	9,291,344.99
资产总计	27,628,293.38	-	296,840,643.34	324,468,936.72
负债				
应付赎回款	-	-	426,400.44	426,400.44
应付管理人报酬	-	-	376,706.86	376,706.86
应付托管费	-	-	62,784.49	62,784.49
应付交易费用	-	-	48,874.01	48,874.01
其他负债	-	-	61,489.28	61,489.28
负债总计	-	-	976,255.08	976,255.08
利率敏感度缺口	27,628,293.38	-	295,864,388.26	323,492,681.64

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）	上年度末（2015年12月31日）
	1、市场利率下降 25 个基点	13,325.03	0.00
	2、市场利率上升 25 个基点	-13,302.43	0.00

#### 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 60%-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		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	312,649,419.84	90.82	257,534,448.92	79.61
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	328,105,301.04	95.31	257,534,448.92	79.61

### 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%	15,113,217.59	14,482,539.70
2、业绩比较基准下降 5%	-15,113,217.59	-14,482,539.70	

### 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 309,850,663.85 元，划分为第二层级的余额为人民币 18,254,637.19 元，无划分为第三层级的余额。（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 257,534,448.92 元，无划分为第二层级及第三层级的余额。）

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

本基金于本报告期末持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末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	312,649,419.84	90.30
	其中：股票	312,649,419.84	90.30
2	固定收益投资	15,455,881.20	4.46
	其中：债券	15,455,881.20	4.46
	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	17,793,720.23	5.14
7	其他各项资产	325,949.44	0.09
8	合计	346,224,970.71	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	172,272.00	0.05
B	采矿业	883,619.00	0.26
C	制造业	238,192,184.05	69.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,714,123.96	0.79
E	建筑业	20,643,642.54	6.00
F	批发和零售业	10,894,315.00	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	9,027,461.85	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,650,841.65	0.77
J	金融业	9,600,378.00	2.79
K	房地产业	46,080.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,899,669.03	0.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,500,008.76	3.63
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	3,424,824.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	312,649,419.84	90.82

### 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	600196	复星医药	883,894	20,453,307.16	5.94
2	000895	双汇发展	801,567	16,776,797.31	4.87
3	600276	恒瑞医药	330,544	15,039,752.00	4.37
4	600566	济川药业	467,200	14,604,672.00	4.24
5	600519	贵州茅台	32,607	10,895,629.05	3.17
6	000651	格力电器	390,800	9,621,496.00	2.79
7	300070	碧水源	506,563	8,874,983.76	2.58
8	600887	伊利股份	475,200	8,363,520.00	2.43
9	000963	华东医药	106,600	7,682,662.00	2.23
10	000625	长安汽车	499,680	7,465,219.20	2.17
11	600660	福耀玻璃	374,446	6,975,928.98	2.03
12	000488	晨鸣纸业	647,381	6,706,867.16	1.95
13	300072	三聚环保	143,398	6,637,893.42	1.93
14	000910	大亚圣象	343,700	6,564,670.00	1.91
15	000429	粤高速 A	929,308	6,356,466.72	1.85
16	601012	隆基股份	445,700	5,967,923.00	1.73
17	002563	森马服饰	577,236	5,928,213.72	1.72
18	600298	安琪酵母	301,250	5,368,275.00	1.56
19	600585	海螺水泥	310,012	5,257,803.52	1.53
20	600487	亨通光电	259,600	4,844,136.00	1.41
21	600068	葛洲坝	515,476	4,737,224.44	1.38
22	600816	安信信托	196,300	4,636,606.00	1.35
23	002508	老板电器	123,553	4,546,750.40	1.32
24	002372	伟星新材	285,573	4,406,391.39	1.28
25	002142	宁波银行	232,800	3,873,792.00	1.13
26	002573	清新环境	207,500	3,625,025.00	1.05
27	002705	新宝股份	210,670	3,562,429.70	1.03
28	002078	太阳纸业	512,400	3,422,832.00	0.99
29	601668	中国建筑	378,600	3,354,396.00	0.97
30	002074	国轩高科	102,396	3,173,252.04	0.92
31	600757	长江传媒	376,400	3,127,884.00	0.91
32	002411	必康股份	114,942	3,109,181.10	0.90
33	600312	平高电气	178,168	2,782,984.16	0.81

34	000498	山东路桥	340,100	2,696,993.00	0.78
35	600066	宇通客车	136,500	2,674,035.00	0.78
36	002594	比亚迪	48,600	2,414,448.00	0.70
37	300237	美晨科技	140,100	2,336,868.00	0.68
38	000587	金洲慈航	156,026	2,321,666.88	0.67
39	603589	口子窖	72,184	2,319,271.92	0.67
40	000858	五粮液	66,400	2,289,472.00	0.67
41	002202	金风科技	126,696	2,167,768.56	0.63
42	600350	山东高速	324,000	2,099,520.00	0.61
43	002271	东方雨虹	91,563	1,986,001.47	0.58
44	000921	海信科龙	189,900	1,938,879.00	0.56
45	002415	海康威视	79,800	1,900,038.00	0.55
46	002400	省广股份	137,757	1,899,669.03	0.55
47	600323	瀚蓝环境	125,200	1,797,872.00	0.52
48	002051	中工国际	76,560	1,754,755.20	0.51
49	000623	吉林敖东	56,200	1,741,638.00	0.51
50	600104	上汽集团	72,400	1,697,780.00	0.49
51	002310	东方园林	114,150	1,615,222.50	0.47
52	002081	金螳螂	159,473	1,561,240.67	0.45
53	000501	鄂武商A	78,500	1,532,320.00	0.45
54	002083	孚日股份	205,600	1,453,592.00	0.42
55	002615	哈尔斯	82,000	1,439,100.00	0.42
56	002002	鸿达兴业	190,611	1,399,084.74	0.41
57	002426	胜利精密	168,100	1,390,187.00	0.40
58	300267	尔康制药	96,600	1,260,630.00	0.37
59	600197	伊力特	85,878	1,244,372.22	0.36
60	002589	瑞康医药	36,900	1,197,405.00	0.35
61	600172	黄河旋风	62,900	1,124,652.00	0.33
62	002531	天顺风能	162,720	1,119,513.60	0.33
63	600720	祁连山	127,400	1,040,858.00	0.30
64	002042	华孚色纺	85,400	978,684.00	0.28
65	601965	中国汽研	89,200	949,980.00	0.28
66	000065	北方国际	34,165	925,871.50	0.27
67	002275	桂林三金	48,800	896,456.00	0.26
68	603609	禾丰牧业	65,025	840,773.25	0.24
69	601179	中国西电	150,200	838,116.00	0.24
70	002450	康得新	42,879	819,417.69	0.24
71	000957	中通客车	51,459	816,654.33	0.24
72	600170	上海建工	171,100	809,303.00	0.24

73	601139	深圳燃气	86,800	789,012.00	0.23
74	601088	中国神华	48,300	781,494.00	0.23
75	300287	飞利信	65,100	774,690.00	0.23
76	002035	华帝股份	29,300	760,335.00	0.22
77	603306	华懋科技	20,800	756,912.00	0.22
78	600438	通威股份	118,600	755,482.00	0.22
79	002304	洋河股份	10,000	706,000.00	0.21
80	002311	海大集团	46,549	700,562.45	0.20
81	300145	中金环境	26,200	683,820.00	0.20
82	600056	中国医药	34,800	662,244.00	0.19
83	600079	人福医药	30,900	616,455.00	0.18
84	600522	中天科技	58,250	613,372.50	0.18
85	600273	嘉化能源	61,696	592,898.56	0.17
86	300197	铁汉生态	45,700	579,476.00	0.17
87	002020	京新药业	50,030	566,339.60	0.16
88	002466	天齐锂业	17,200	558,140.00	0.16
89	002624	完美世界	17,700	527,283.00	0.15
90	601009	南京银行	48,000	520,320.00	0.15
91	600297	广汇汽车	56,300	481,928.00	0.14
92	002100	天康生物	52,900	474,513.00	0.14
93	300219	鸿利智汇	43,674	473,862.90	0.14
94	600036	招商银行	26,300	462,880.00	0.13
95	000887	中鼎股份	17,600	456,544.00	0.13
96	002555	三七互娱	27,700	454,280.00	0.13
97	002354	天神娱乐	6,400	442,624.00	0.13
98	002356	赫美集团	17,800	430,760.00	0.13
99	600309	万华化学	17,400	374,622.00	0.11
100	002317	众生药业	26,473	326,941.55	0.09
101	000418	小天鹅 A	9,859	318,642.88	0.09
102	002597	金禾实业	19,400	303,222.00	0.09
103	600373	中文传媒	14,700	296,940.00	0.09
104	300199	翰宇药业	15,800	284,084.00	0.08
105	002247	帝龙文化	15,100	273,159.00	0.08
106	600377	宁沪高速	30,899	264,186.45	0.08
107	300158	振东制药	13,300	260,414.00	0.08
108	300262	巴安水务	15,100	256,700.00	0.07
109	000338	潍柴动力	25,600	254,976.00	0.07
110	000967	盈峰环境	17,900	250,242.00	0.07
111	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.07



112	300182	捷成股份	20,395	210,272.45	0.06
113	002203	海亮股份	25,600	206,336.00	0.06
114	300115	长盈精密	6,800	177,208.00	0.05
115	002714	牧原股份	7,400	172,272.00	0.05
116	600418	江淮汽车	14,100	162,996.00	0.05
117	000900	现代投资	19,000	153,330.00	0.04
118	600548	深高速	17,000	144,500.00	0.04
119	002726	龙大肉食	7,700	134,211.00	0.04
120	002138	顺络电子	7,672	132,802.32	0.04
121	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.04
122	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03
123	002367	康力电梯	7,994	105,600.74	0.03
124	002554	惠博普	12,500	102,125.00	0.03
125	600873	梅花生物	15,600	101,712.00	0.03
126	603766	隆鑫通用	4,700	97,666.00	0.03
127	002032	苏泊尔	2,610	91,141.20	0.03
128	600236	桂冠电力	14,643	89,322.30	0.03
129	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03
130	002108	沧州明珠	4,300	87,591.00	0.03
131	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.02
132	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
133	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
134	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
135	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
136	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
137	600325	华发股份	3,600	46,080.00	0.01
138	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
139	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
140	603886	元祖股份	2,060	36,462.00	0.01
141	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
142	603228	景旺电子	1,455	33,697.80	0.01
143	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
144	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
145	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
146	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
147	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
148	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
149	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
150	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00

151	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
152	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
153	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
154	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
155	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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	000786	北新建材	21,779,426.50	6.73
2	000550	江铃汽车	15,094,230.40	4.67
3	600566	济川药业	12,402,272.71	3.83
4	002311	海大集团	9,725,564.10	3.01
5	000625	长安汽车	9,176,464.00	2.84
6	000651	格力电器	8,854,216.00	2.74
7	600519	贵州茅台	8,653,014.75	2.67
8	300070	碧水源	8,567,779.36	2.65
9	600887	伊利股份	7,997,609.50	2.47
10	000963	华东医药	7,716,045.22	2.39
11	002411	必康股份	6,225,038.00	1.92
12	000488	晨鸣纸业	5,943,966.72	1.84
13	600664	哈药股份	5,895,401.85	1.82
14	601012	隆基股份	5,783,276.86	1.79
15	000429	粤高速 A	5,695,338.63	1.76
16	000910	大亚圣象	5,688,426.40	1.76
17	002202	金风科技	5,403,603.00	1.67
18	600298	安琪酵母	5,082,728.42	1.57
19	002508	老板电器	5,055,494.85	1.56
20	002250	联化科技	4,712,384.35	1.46

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	000786	北新建材	20,512,707.68	6.34
2	000423	东阿阿胶	17,266,716.26	5.34
3	002250	联化科技	15,449,824.97	4.78
4	002422	科伦药业	15,354,214.94	4.75
5	600585	海螺水泥	15,087,503.20	4.66
6	000550	江铃汽车	14,396,425.13	4.45
7	600660	福耀玻璃	14,249,610.13	4.40
8	000501	鄂武商 A	14,178,870.72	4.38
9	600987	航民股份	13,733,902.69	4.25
10	002032	苏泊尔	12,813,816.26	3.96
11	000338	潍柴动力	12,625,426.77	3.90
12	600315	上海家化	12,568,679.11	3.89
13	600600	青岛啤酒	12,449,318.18	3.85
14	601933	永辉超市	9,453,544.20	2.92
15	000895	双汇发展	9,073,492.85	2.80
16	002311	海大集团	8,603,475.17	2.66
17	002081	金螳螂	7,100,777.67	2.20
18	002411	必康股份	5,855,106.26	1.81
19	600664	哈药股份	5,740,681.15	1.77
20	000957	中通客车	5,013,635.21	1.55

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	410,833,696.56
卖出股票收入（成交）总额	369,800,307.23

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，  
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	15,455,881.20	4.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,455,881.20	4.49

### 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	019539	16 国债 11	154,760	15,455,881.20	4.49

### 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。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合相关法律法规和监管要求的变化。

## 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	56,369.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	239,124.20
5	应收申购款	30,455.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	325,949.44

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
6,485	47,413.08	111,868,813.31	36.38%	195,605,011.81	63.62%

### 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	4,326.63	0.0014%

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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3月19日）基金份额总额	1,493,426,867.82
本报告期期初基金份额总额	309,526,828.14
本报告期基金总申购份额	165,879,877.30
减:本报告期基金总赎回份额	167,932,880.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	307,473,825.12

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2年，本报告期应支付的报酬为人民币60,000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	
招商证券	2	432,684,989.97	55.71%	307,768.20	55.71%	-
海通证券	2	215,491,918.34	27.75%	153,279.62	27.75%	-
中信证券	2	72,104,126.36	9.28%	51,287.65	9.28%	-
兴业证券	2	56,374,053.20	7.26%	40,098.93	7.26%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	23,061,357.76	90.58%	12,800,000.00	17.04%	-	-
中信证券	-	-	50,000,000.00	66.58%	-	-
兴业证券	2,398,955.40	9.42%	12,300,000.00	16.38%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-



### 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	安信基金管理有限责任公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持清新环境(002573)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
3	安信基金管理有限责任公司关于公司法定代表人变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 16 日
4	安信消费医药主题股票型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 20 日
5	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机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持万科 A (000002)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 29 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持众和股份(002070)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
8	安信基金管理有限责任公司关于参加数米基金网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 2 月 25 日
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加北京钱景财富投资管理有限公司基金网上申购及定投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 3 月 3 日
10	安信消费医药主题股票型证券投资	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 16 日

	资基金基金经理变更公告	券报、证券时报	
11	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持科大讯飞(002230)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月18日
12	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3月21日
13	安信消费医药主题股票型证券投资基金 2015 年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月25日
14	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4月1日
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加张家港农村商业银行股份有限公司申购及定期定额投资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4月7日
16	安信消费医药主题股票型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月8日
17	安信基金管理有限责任公司高级管理人员(副总经理)变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月12日
18	安信消费医药主题股票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4月20日
19	关于新增上海陆家嘴资产管理有限公司为我司旗下基金代销机构并参加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4月20日
20	安信消费医药主题股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月22日
21	安信基金管理有限责任公司关于旗下	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月28日

	部分基金参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	安信基金管理有限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
31	关于安信基金管理有限责任公司	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日

	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)	券报、证券时报	
32	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
33	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
34	安信消费医药主题股票型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年7月20日
35	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
36	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
37	安信消费医药主题股票型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年8月25日
38	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
39	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
40	安信消费医药主题股票型证券投资基金 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
41	安信消费医药主题股票型证券投资基金更新招募说明书摘要(2016年第2号)	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年10月24日
42	安信基金管理有限责任公司关于	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年10月25日

	旗下常宝股份估值调整的公告	券报、证券时报	
43	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
44	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
45	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
46	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
47	安信价值精选、消费医药股票型基金关于新增微众银行为基金销售服务机构并参加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 11 月 30 日
48	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
49	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
50	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
51	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、基金组合购买、定投进行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 29 日
52	关于新增销售服务机构为我司旗	上海证券报、中国证券	2016 年 12 月 29 日

	下基金代销机构的公告	券报、证券时报	
--	------------	---------	--

## § 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消费医药主题股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信消费医药主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信消费医药主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信消费医药主题股票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：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