

安信中证一带一路主题指数分级证券投资 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 1 月 1 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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
§4 管理人报告	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	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	49

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	49
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	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末上市基金前十名持有人	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
9.4 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	53
§10 开放式基金份额变动	53
§11 重大事件揭示	54
11.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金		
基金简称	安信一带一路分级		
场内简称	一带分级		
基金主代码	167503		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日		
基金管理人	安信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1, 276, 240, 436. 82 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 5 月 22 日		
下属分级基金的基金简称	一带一 A	一带一 B	一带分级
下属分级基金的交易代码	150275	150276	167503
报告期末下属分级基金份额总额	573, 764, 996. 00 份	573, 764, 996. 00 份	128, 710, 444. 82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0. 35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	股票投资上，本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整；债券投资上，本基金将以宏观形势及利率分析为基础，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价；权证投资上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，谨慎进行权证投资；资产支持证券投资方面，综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。
业绩比较基准	中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

下属分级基金的风险收益特征	安信一带一路A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	安信一带一路B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。	-
---------------	--	--	---

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	郭杰
	联系电话	0755-82509999	0755-23619489
	电子邮箱	service@essencefund.com	zctg@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95565
传真		0755-82799292	0755-82960794
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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
邮政编码		518026	518035
法定代表人		刘入领	宫少林

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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 5 月 14 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-100,017,249.09	-2,827,034,219.39
本期利润	-42,979,639.97	-2,895,467,696.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0412	-1.1905
本期加权平均净值利润率	-5.54%	-128.83%
本期基金份额净值增长率	-12.29%	-41.85%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-958,840,774.73	-520,221,891.37
期末可供分配基金份额利润	-0.7513	-0.6510
期末基金资产净值	989,088,033.41	726,136,994.31
期末基金份额净值	0.775	0.909
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-48.99%	-41.85%

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	10.12%	1.12%	11.03%	1.13%	-0.91%	-0.01%
过去六个月	14.55%	0.99%	15.67%	1.00%	-1.12%	-0.01%
过去一年	-12.29%	1.73%	-12.09%	1.73%	-0.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	-48.99%	2.37%	-38.81%	2.40%	-10.18%	-0.03%

注：1、根据《安信一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。由于本基金投资标的指数为中证一带一路指数，且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，

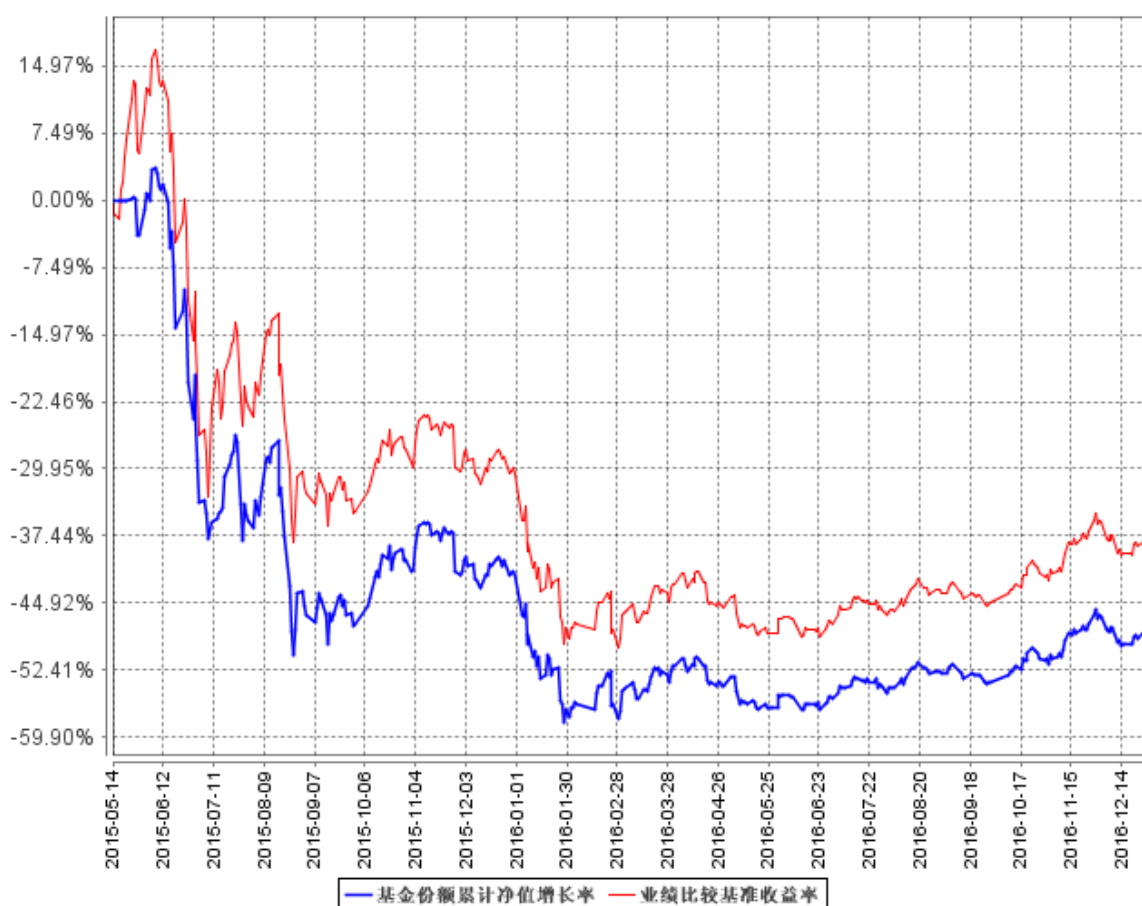
投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证一带一路指数收益率 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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 80%、20% 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 5 月 14 日。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为 2015 年 5 月 14 日至 2015 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

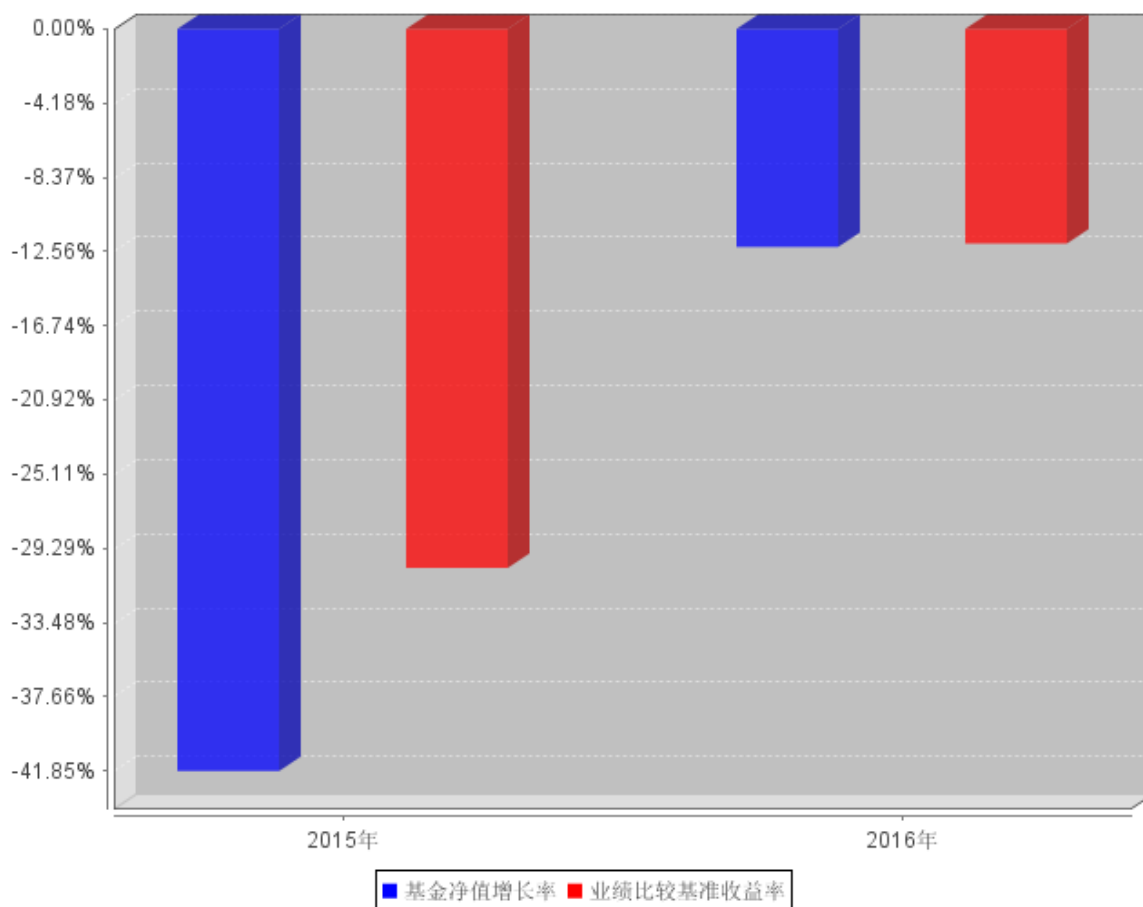


注：1、本基金的建仓期为 2015 年 5 月 14 日至 2015 年 11 月 13 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日。图示日期为 2015 年 5 月 14 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 2015 年 5 月 14 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		
龙川	本基金的基金经理、量化投资部总经理	2015 年 5 月 14 日	-	14	龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投

					资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路指数分级证券投资基金、安信沪深300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理助理	2015 年 11 月 9 日	-	3	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员、安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理助理。现任安信中证一带一路指数分级证券投资基金、安信沪深300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理。

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

纵观 2016 年全年，上证指数在 1 月份遭遇了历史最差开局，并将全年的最低点定格在 2638.30 点。此后指数企稳反弹，在经历了二、三季度的持续震荡后，市场从 10 月开始明显回暖，截至 12 月 30 日收盘，上证指数报收 3103.64 点，全年下跌 12.31%；沪深 300 指数和创业板指数全年分别下跌 11.28%和 27.71%，同期中证一带一路主题指数跌幅为 12.88%。

安信中证一带一路分级基金 2016 年下跌 12.24%，本基金采取完全复制指数的被动式指数管理策略，量化及人工管理相结合的投资方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。在报告期内，本基金未遇到大额申购赎回事件，较好地将跟踪误差以及日均跟踪偏离度控制在合理水平以内。

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 0.775 元，本报告期份额净值增长率为-12.29%，同期业绩比较基准增长率为-12.09%。

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，A 股市场虽然依然存在波折，但整体来看，各行业都在挖掘下一片蓝海，传

统行业也在积极拥抱新经济，“十三五”规划给我们画出了一幅宏伟壮阔的蓝图，“中国制造 2025”更为创新和转型铺垫了路线图，党的“十九大”将于 2017 年召开，全社会都在聚焦。以 2017 年为起点，股市将迎来一轮新的投资机会。

随着经济形势的稳定，一带一路这一投资主题也将会迎来新的契机。安信中证一带一路分级基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将保持完全复制指数的被动式指数管理策略，力争使基金表现与指数收益尽量相似，使投资者充分分享一带一路板块的长期收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证公司估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会采取临时会议的方式召开会议，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，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。

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，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。

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一带一路主题指数分级证券投资基金 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_H12 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	安信中证一带一路主题指数分级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中证一带一路主题指数分级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	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。 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。 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。
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，公允反映了安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 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。
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：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	115,808,712.43	35,203,066.65
结算备付金		1,893,895.96	2,441,951.72
存出保证金		793,565.41	12,821,475.97
交易性金融资产	7.4.7.2	884,728,708.87	676,182,153.56
其中：股票投资		884,728,708.87	676,182,153.56
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,014,691.75
应收利息	7.4.7.5	35,812.49	26,350.36
应收股利		-	-
应收申购款		29,294,729.34	53,034.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	755.66	755.66
资产总计		1,032,556,180.16	729,743,480.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		40,635,933.11	558,996.44
应付赎回款		841,652.48	1,609,768.87
应付管理人报酬		792,476.57	657,675.77
应付托管费		158,495.31	131,535.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	604,964.06	512,443.03
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	434,625.22	136,066.91
负债合计		43,468,146.75	3,606,486.16
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,920,593,092.63	1,237,802,868.13
未分配利润	7.4.7.10	-931,505,059.22	-511,665,873.82
所有者权益合计		989,088,033.41	726,136,994.31
负债和所有者权益总计		1,032,556,180.16	729,743,480.47

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 A 类份额净值人民币 1.002 元，B 类份额净值人民币 0.548 元，基础份额净值人民币 0.775 元。基金份额总额 1,276,240,436.82 份，其中 A 类份额 573,764,996.00 份，B 类份额 573,764,996.00 份，基础份额 128,710,444.82 份。

7.2 利润表

会计主体：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

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 5 月 14 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-30,313,466.32	-2,855,763,197.64
1.利息收入		1,029,128.37	4,376,759.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,029,128.37	4,353,303.21
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,455.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-89,409,095.78	-2,798,625,548.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-96,962,448.05	-2,825,052,421.68
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	7, 553, 352. 27	26, 426, 873. 29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	57, 037, 609. 12	-68, 433, 476. 63
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	1, 028, 891. 97	6, 919, 068. 32
减：二、费用		12, 666, 173. 65	39, 704, 498. 38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7, 742, 480. 76	14, 032, 612. 97
2. 托管费	7.4.10.2.2	1, 548, 496. 13	2, 806, 522. 53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	2, 793, 743. 44	22, 243, 174. 12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	581, 453. 32	622, 188. 76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42, 979, 639. 97	-2, 895, 467, 696. 02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42, 979, 639. 97	-2, 895, 467, 696. 02

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1, 237, 802, 868. 13	-511, 665, 873. 82	726, 136, 994. 31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42, 979, 639. 97	-42, 979, 639. 97
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	682, 790, 224. 50	-376, 859, 545. 43	305, 930, 679. 07

列)			
其中：1. 基金申购款	2,323,135,898.48	-1,192,592,069.67	1,130,543,828.81
2. 基金赎回款	-1,640,345,673.98	815,732,524.24	-824,613,149.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,593,092.63	-931,505,059.22	989,088,033.41
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 14 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）	400,837,760.45	-	400,837,760.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,895,467,696.02	-2,895,467,696.02
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）	836,965,107.68	2,383,801,822.20	3,220,766,929.88
其中：1. 基金申购款	9,114,115,648.38	-358,116,359.89	8,755,999,288.49
2. 基金赎回款	-8,277,150,540.70	2,741,918,182.09	-5,535,232,358.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,237,802,868.13	-511,665,873.82	726,136,994.31

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

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（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 4 月 29 日下发的证监许可[2015]770 号文《关于核准安信中证一带一路主题指数分级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《安信中证一带一路主题指数分级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 5 月 11 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(2014)验字 60962175_H41 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 400,830,234.86 元。经向中国证监会备案，《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 14 日正式生效。截至 2015 年 4 月 21 日止，安信中证一带一路主题指数分级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 400,830,234.86 元，折合 400,830,234.86 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 7,525.59 元，折合 7,525.59 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 400,837,760.45 元，折合 400,837,760.45 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据基金合同，本基金份额包括安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“安信一带一路份额”）、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“安信一带一路 A 份额”）和安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“安信一带一路 B 份额”）。

根据《安信中证一带一路主题分级证券投资基金之一带一 A 与一带一 B 基金份额上市交易公告书》，安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额于 2015 年 5 月 22 日经深圳证券交易所深证上[2015]211 号文核准上市交易。于 2015 年 5 月 22 日，安信一带一路 A 份额上市交易份额为 174,086,578 份，安信一带一路 B 份额上市交易份额为 174,086,578 份。

根据基金合同，本基金将进行定期或不定期份额折算。于 2015 年 7 月 9 日，本基金对安信一带一路份额、安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额进行不定期折算。于 2015 年 12 月 15 日本基金对安信一带一路 A 份额和安信一带一路份额进行定期份额折算。本期本基金份额折算变动详见报表附注 7.4.7.9 实收基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金各类资产投资比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证一带一路指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 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，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：中证一带一路指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%。

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。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 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：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；有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，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) 基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提;

(3) 标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02%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

在存续期内,本基金(包括安信一带一路份额、安信一带一路 A 份额、安信一带一路 B 份额)不进行收益分配。

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会计政策和会计估计事项。

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	115,808,712.43	35,203,066.65
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	115,808,712.43	35,203,066.65

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		896,124,576.38	884,728,708.87	-11,395,867.51
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		896,124,576.38	884,728,708.87	-11,395,867.51
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		744,615,630.19	676,182,153.56	-68,433,476.63
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		744,615,630.19	676,182,153.56	-68,433,476.63

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

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	34,482.26	18,795.01
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	937.42	1,208.68
应收债券利息	-	-
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	392.81	6,346.67
合计	35,812.49	26,350.36

7.4.7.6 其他资产

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
其他应收款	755.66	755.66
待摊费用	-	-
合计	755.66	755.66

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	604,964.06	512,443.03
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	604,964.06	512,443.03
----	------------	------------

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,171.90	6,066.91
信息披露费	300,000.00	-
预提审计费	80,000.00	80,000.00
应付指数使用费	51,453.32	50,000.00
合计	434,625.22	136,066.91

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	799,087,826.85	1,237,802,868.13
本期申购	1,356,067,192.63	2,100,440,486.92
本期赎回（以“-”号填列）	-1,027,950,192.26	-1,592,150,587.62
2016 年 12 月 15 日 基金拆分/ 份额折算前	1,127,204,827.22	1,746,092,767.43
基金拆分/份额折算变动份额	33,088,033.62	-
本期申购	147,962,386.11	222,695,411.56
本期赎回（以“-”号填列）	-32,014,810.13	-48,195,086.36
本期末	1,276,240,436.82	1,920,593,092.63

注：本基金本报告期于 2016 年 12 月 15 日发生定期折算，折算变动份额为 33,088,033.62 份。

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	-520,221,891.37	8,556,017.55	-511,665,873.82
本期利润	-100,017,249.09	57,037,609.12	-42,979,639.97
本期基金份额交易 产生的变动数	-338,601,634.27	-38,257,911.16	-376,859,545.43
其中：基金申购款	-1,145,096,399.99	-47,495,669.68	-1,192,592,069.67
基金赎回款	806,494,765.72	9,237,758.52	815,732,524.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-958,840,774.73	27,335,715.51	-931,505,059.22

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 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	990,089.73	4,090,996.73
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	16,649.69	148,412.89
其他	22,388.95	113,893.59
合计	1,029,128.37	4,353,303.21

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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	993,676,769.12	7,435,019,402.23
减：卖出股票成本总额	1,090,639,217.17	10,260,071,823.91
买卖股票差价收入	-96,962,448.05	-2,825,052,421.68

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 14 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	7,553,352.27	26,426,873.29
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,553,352.27	26,426,873.29

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 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	57,037,609.12	-68,433,476.63
——股票投资	57,037,609.12	-68,433,476.63
——债券投资	-	-
——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	57,037,609.12	-68,433,476.63

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 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,028,891.97	6,919,068.32
合计	1,028,891.97	6,919,068.32

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 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,793,743.44	22,243,174.12

银行间市场交易费用	-	-
合计	2,793,743.44	22,243,174.12

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 5 月 14 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	180,000.00
指数使用费	201,453.32	291,788.76
上市初费	-	30,000.00
其他	-	400.00
上市月费	-	40,000.00
合计	581,453.32	622,188.76

7.4.7.22 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需披露分部报告。

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、基金销售机构
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	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	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 5 月 14 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	339,791,361.75	15.20%	5,545,159,439.18	30.07%
招商证券	-	-	2,877,678,993.03	15.61%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 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	241,695.06	15.09%	162,866.78	26.92%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 5 月 14 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	3,781,164.78	29.69%	-	-
招商证券	1,953,736.30	15.34%	-	-

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 5 月 14 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	7,742,480.76	14,032,612.97
其中：支付销售机构的客户维护费	172,578.98	161,738.28

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 5 月 14 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	1,548,496.13	2,806,522.53

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 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

份额单位：份

一带分级				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
招商证券股份有 限公司	1.00	0.0000%	1.00	0.0000%

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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 14 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
招商证券	115,808,712.43	990,089.73	35,203,066.65	4,090,996.73

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，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

本基金于本期及上年度可比期间未进行利润分配。

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

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。

7.4.12.2 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
601727	上海电气	2016 年 8 月 31 日	重大事项	8.42	-	-	2,910,483	27,605,251.73	24,506,266.86	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大事项	16.63	-	-	1,088,667	16,403,556.62	18,104,532.21	-
600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	重大事项	10.79	-	-	908,798	10,376,293.96	9,805,930.42	-
603111	康尼机电	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.70	-	-	327,650	4,200,946.02	4,816,455.00	-
603308	应流股份	2016 年 11 月 24 日	重大事项	21.92	2017 年 2 月 14 日	21.92	186,730	4,267,017.13	4,093,121.60	-

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。

本基金为被动指数型基金，主要投资于标的指数成分股和备选成分股。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，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。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之内。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

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。本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

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。期末本基金除部分停牌股票无法变现外，其余金融资产均能以合理价格及时变现。

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	115,808,712.43	-	-	-	115,808,712.43
结算备付金	1,893,895.96	-	-	-	1,893,895.96

存出保证金	793,565.41	-	-	-	793,565.41
交易性金融资产	-	-	-	884,728,708.87	884,728,708.87
应收利息	-	-	-	35,812.49	35,812.49
应收申购款	-	-	-	29,294,729.34	29,294,729.34
其他资产	-	-	-	755.66	755.66
资产总计	118,496,173.80	-	-	914,060,006.36	1,032,556,180.16
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	40,635,933.11	40,635,933.11
应付赎回款	-	-	-	841,652.48	841,652.48
应付管理人报酬	-	-	-	792,476.57	792,476.57
应付托管费	-	-	-	158,495.31	158,495.31
应付交易费用	-	-	-	604,964.06	604,964.06
其他负债	-	-	-	434,625.22	434,625.22
负债总计	-	-	-	43,468,146.75	43,468,146.75
利率敏感度缺口	118,496,173.80	-	-	870,591,859.61	989,088,033.41
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	35,203,066.65	-	-	-	35,203,066.65
结算备付金	2,441,951.72	-	-	-	2,441,951.72
存出保证金	12,821,475.97	-	-	-	12,821,475.97
交易性金融资产	-	-	-	676,182,153.56	676,182,153.56
应收证券清算款	-	-	-	3,014,691.75	3,014,691.75
应收利息	-	-	-	26,350.36	26,350.36
应收申购款	-	-	-	53,034.80	53,034.80
其他资产	-	-	-	755.66	755.66
资产总计	50,466,494.34	-	-	679,276,986.13	729,743,480.47
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	558,996.44	558,996.44
应付赎回款	-	-	-	1,609,768.87	1,609,768.87
应付管理人报酬	-	-	-	657,675.77	657,675.77
应付托管费	-	-	-	131,535.14	131,535.14
应付交易费用	-	-	-	512,443.03	512,443.03
其他负债	-	-	-	136,066.91	136,066.91
负债总计	-	-	-	3,606,486.16	3,606,486.16
利率敏感度缺口	50,466,494.34	-	-	675,670,499.97	726,136,994.31

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融资产，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票、债券、资产支持证券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融资产，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。

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。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	884,728,708.87	89.45	676,182,153.56	93.12
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	884,728,708.87	89.45	676,182,153.56	93.12

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	上年度末（2015 年 12 月

		31 日)	31 日)
	1、业绩比较基准上升 5%	42,258,749.01	34,603,535.18
	2、业绩比较基准下降 5%	-42,258,749.01	-34,603,535.18

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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、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 823,402,402.78 元，划分为第二层级的余额为人民币 61,326,306.09 元，无划分为第三层级余额。

(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 629,753,075.54 元，划分为第二层级的余额为人民币 46,429,078.02 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	884,728,708.87	85.68
	其中：股票	884,728,708.87	85.68
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	117,702,608.39	11.40
7	其他各项资产	30,124,862.90	2.92
8	合计	1,032,556,180.16	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	97,638,178.92	9.87
C	制造业	405,108,953.73	40.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,600,139.36	0.26
E	建筑业	219,002,896.18	22.14
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	99,120,419.25	10.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,104,532.21	1.83

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,122,785.00	0.21
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	843,697,904.65	85.30

8.2.2 期末积极投资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	3,897,228.39	0.39
C	制造业	17,948,448.62	1.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	19,185,127.21	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	41,030,804.22	4.15

8.2.3 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

8.3.1 期末指数投资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	600028	中国石化	4,887,239	26,439,962.99	2.67
2	601668	中国建筑	2,923,699	25,903,973.14	2.62
3	601857	中国石油	3,253,970	25,869,061.50	2.62
4	601390	中国中铁	2,868,474	25,414,679.64	2.57
5	600089	特变电工	2,745,233	25,063,977.29	2.53
6	000063	中兴通讯	1,565,031	24,962,244.45	2.52
7	601186	中国铁建	2,075,407	24,821,867.72	2.51
8	601989	中国重工	3,497,951	24,800,472.59	2.51
9	601669	中国电建	3,395,189	24,649,072.14	2.49
10	601727	上海电气	2,910,483	24,506,266.86	2.48
11	601766	中国中车	2,498,951	24,414,751.27	2.47
12	002202	金风科技	1,282,020	21,935,362.20	2.22
13	600068	葛洲坝	2,226,650	20,462,913.50	2.07
14	600031	三一重工	3,343,983	20,398,296.30	2.06
15	601618	中国中冶	4,165,567	19,411,542.22	1.96
16	601800	中国交建	1,194,007	18,136,966.33	1.83
17	600406	国电南瑞	1,088,667	18,104,532.21	1.83
18	601018	宁波港	3,341,749	16,909,249.94	1.71
19	600522	中天科技	1,567,186	16,502,468.58	1.67
20	000157	中联重科	3,612,655	16,401,453.70	1.66
21	600820	隧道股份	1,463,600	16,114,236.00	1.63
22	600118	中国卫星	494,038	15,433,747.12	1.56
23	600150	中国船舶	544,617	15,036,875.37	1.52
24	600487	亨通光电	765,279	14,280,106.14	1.44

25	600018	上港集团	2,758,600	14,124,032.00	1.43
26	600583	海油工程	1,830,100	13,506,138.00	1.37
27	000425	徐工机械	3,777,847	12,769,122.86	1.29
28	002092	中泰化学	1,046,202	12,659,044.20	1.28
29	600256	广汇能源	2,493,106	11,642,805.02	1.18
30	601866	中海集运	2,693,820	10,990,785.60	1.11
31	601117	中国化学	1,550,272	10,495,341.44	1.06
32	600875	东方电气	908,798	9,805,930.42	0.99
33	601179	中国西电	1,693,547	9,449,992.26	0.96
34	601872	招商轮船	1,878,300	9,278,802.00	0.94
35	600759	洲际油气	929,950	9,132,109.00	0.92
36	600312	平高电气	554,158	8,655,947.96	0.88
37	000400	许继电气	468,480	8,502,912.00	0.86
38	002353	杰瑞股份	403,900	8,199,170.00	0.83
39	600528	中铁二局	589,401	8,110,157.76	0.82
40	600026	中海发展	1,172,833	7,986,992.73	0.81
41	600717	天津港	731,307	7,371,574.56	0.75
42	300208	恒顺众昇	422,301	7,263,577.20	0.73
43	601880	大连港	2,531,260	7,087,528.00	0.72
44	002051	中工国际	295,785	6,779,392.20	0.69
45	600320	振华重工	1,322,363	6,744,051.30	0.68
46	002266	浙富控股	1,141,246	6,573,576.96	0.66
47	002606	大连电瓷	135,157	6,511,864.26	0.66
48	601808	中海油服	504,713	6,475,467.79	0.65
49	600970	中材国际	884,653	6,272,189.77	0.63
50	600017	日照港	1,544,300	6,254,415.00	0.63
51	000777	中核科技	268,350	6,005,673.00	0.61
52	300001	特锐德	343,136	5,949,978.24	0.60
53	600545	新疆城建	462,801	5,627,660.16	0.57
54	300011	鼎汉技术	264,591	5,482,325.52	0.55
55	600125	铁龙物流	661,420	5,344,273.60	0.54
56	600495	晋西车轴	705,357	5,120,891.82	0.52
57	600580	卧龙电气	540,160	4,915,456.00	0.50
58	000928	中钢国际	275,051	4,821,644.03	0.49
59	603111	康尼机电	327,650	4,816,455.00	0.49
60	002554	惠博普	559,686	4,572,634.62	0.46
61	600428	中远航运	726,558	4,446,534.96	0.45
62	603308	应流股份	186,730	4,093,121.60	0.41
63	002531	天顺风能	568,520	3,911,417.60	0.40

64	601002	晋亿实业	385,700	3,671,864.00	0.37
65	000065	北方国际	128,969	3,495,059.90	0.35
66	000877	天山股份	493,277	3,477,602.85	0.35
67	300351	永贵电器	130,565	3,351,603.55	0.34
68	600425	青松建化	696,273	3,237,669.45	0.33
69	600798	宁波海运	509,900	2,722,866.00	0.28
70	002524	光正集团	244,374	2,600,139.36	0.26
71	000018	神州长城	228,900	2,449,230.00	0.25
72	600279	重庆港九	333,000	2,404,260.00	0.24
73	002307	北新路桥	274,900	2,309,160.00	0.23
74	000905	厦门港务	217,611	2,232,688.86	0.23
75	002738	中矿资源	80,500	2,122,785.00	0.21
76	603338	浙江鼎力	39,100	2,037,501.00	0.21
77	600368	五洲交通	346,200	1,966,416.00	0.20
78	300103	达刚路机	85,469	1,893,993.04	0.19

8.3.2 期末积极投资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	601106	中国一重	2,095,906	11,338,851.46	1.15
2	600317	营口港	1,664,500	5,775,815.00	0.58
3	000088	盐田港	661,900	4,719,347.00	0.48
4	002207	准油股份	193,603	3,897,228.39	0.39
5	000022	深赤湾A	137,703	2,620,488.09	0.26
6	601008	连云港	449,900	2,465,452.00	0.25
7	002302	西部建设	329,604	2,452,253.76	0.25
8	600190	锦州港	555,232	2,309,765.12	0.23
9	603969	银龙股份	155,200	2,163,488.00	0.22
10	000852	石化机械	183,935	1,993,855.40	0.20
11	000582	北部湾港	81,400	1,294,260.00	0.13

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	601186	中国铁建	38,354,434.41	5.28
2	601668	中国建筑	37,804,893.85	5.21
3	601989	中国重工	37,720,861.60	5.19
4	601390	中国中铁	36,054,581.73	4.97
5	000063	中兴通讯	35,151,236.17	4.84
6	002202	金风科技	33,461,853.51	4.61
7	600028	中国石化	32,138,483.20	4.43
8	601766	中国中车	31,184,902.06	4.29
9	601857	中国石油	31,171,045.86	4.29
10	601669	中国电建	30,630,985.81	4.22
11	600089	特变电工	30,085,368.40	4.14
12	600522	中天科技	28,891,896.56	3.98
13	600031	三一重工	28,577,163.00	3.94
14	601800	中国交建	26,816,310.38	3.69
15	600118	中国卫星	26,381,862.23	3.63
16	600068	葛洲坝	24,549,594.80	3.38
17	601618	中国中冶	24,329,894.07	3.35
18	601018	宁波港	24,278,067.84	3.34
19	600406	国电南瑞	23,528,644.86	3.24
20	600487	亨通光电	23,521,681.73	3.24
21	600150	中国船舶	22,956,893.28	3.16
22	000157	中联重科	22,688,529.42	3.12
23	601727	上海电气	20,773,030.28	2.86
24	600018	上港集团	20,610,335.17	2.84
25	600583	海油工程	19,132,871.20	2.63
26	600820	隧道股份	19,105,534.80	2.63
27	601106	中国一重	17,373,888.15	2.39
28	601866	中海集运	17,185,294.33	2.37
29	002092	中泰化学	16,621,162.31	2.29
30	600256	广汇能源	16,220,149.60	2.23
31	600759	洲际油气	16,218,339.17	2.23
32	000425	徐工机械	15,826,399.00	2.18
33	600528	中铁二局	14,906,860.08	2.05
34	600312	平高电气	14,619,984.28	2.01

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	601668	中国建筑	46,735,282.46	6.44
2	601018	宁波港	37,286,406.23	5.13
3	601186	中国铁建	34,467,119.49	4.75
4	000063	中兴通讯	29,974,103.73	4.13
5	601390	中国中铁	29,846,432.34	4.11
6	601989	中国重工	28,596,256.99	3.94
7	600028	中国石化	28,215,717.00	3.89
8	002202	金风科技	27,588,689.25	3.80
9	601669	中国电建	25,371,995.00	3.49
10	601857	中国石油	25,043,561.00	3.45
11	601800	中国交建	23,830,312.29	3.28
12	600522	中天科技	23,353,457.00	3.22
13	601766	中国中车	23,198,780.10	3.19
14	600031	三一重工	22,218,664.79	3.06
15	600068	葛洲坝	21,152,149.00	2.91
16	600118	中国卫星	20,544,755.24	2.83
17	600150	中国船舶	19,434,497.28	2.68
18	600406	国电南瑞	19,371,467.74	2.67
19	601618	中国中冶	18,810,149.88	2.59
20	600089	特变电工	18,593,914.45	2.56
21	000157	中联重科	17,769,945.57	2.45
22	600018	上港集团	15,668,330.91	2.16
23	600583	海油工程	14,930,815.31	2.06
24	600487	亨通光电	14,734,055.50	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	1,242,148,163.36
卖出股票收入（成交）总额	993,676,769.12

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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	793,565.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,812.49
5	应收申购款	29,294,729.34
6	其他应收款	755.66
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,124,862.90

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

8.12.5.1 期末指数投资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	601727	上海电气	24,506,266.86	2.48	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末基金投资前五名的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
一带一 A	1,638	350,283.88	532,296,305.00	92.77%	41,468,691.00	7.23%
一带一 B	31,446	18,246.04	69,761,666.00	12.16%	504,003,330.00	87.84%
一带分 级	9,297	13,844.30	29,742,840.65	23.11%	98,967,604.17	76.89%
合计	42,381	30,113.50	631,800,811.65	49.50%	644,439,625.17	50.50%

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 期末上市基金前十名持有人

安信一带一路分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中邮创业基金—华夏银行—华夏银	231,771,184.00	40.39%

	行股份有限公司		
2	中国银河证券股份有限公司	58,510,551.00	10.20%
3	中融国际信托有限公司-中融-融金添利单一资金信托	23,756,180.00	4.14%
4	富国基金-民生银行-中国民生银行股份有限公司	19,951,014.00	3.48%
5	全国社保基金二零四组合	13,688,537.00	2.39%
6	中银资产-中国银行-中国银行股份有限公司上海市分行	10,000,000.00	1.74%
7	中荷人寿保险有限公司-分红险	9,999,955.00	1.74%
8	上海明沅投资管理有限公司-明沅全天候一号基金	8,607,132.00	1.50%
9	建信基金-光大银行-中融国际信托-中融-绝对收益策略 2 号	8,000,000.00	1.39%
10	建信基金-民生银行-中融国际信托-中融-融晨绝对收益策略 3	6,802,339.00	1.19%

安信一带一路分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	合众人寿保险股份有限公司-分红一个险分红	26,634,827.00	4.64%
2	张少华	13,133,070.00	2.29%
3	宋伟铭	11,052,767.00	1.93%
4	东方汇智-光大银行-东方汇智-中邮鹏华鸿达量化 1 号资产管理	4,929,372.00	0.86%
5	郭启纯	4,900,000.00	0.85%
6	上海明沅投资管理有限公司-明沅全天候一号基金	4,804,440.00	0.84%
7	汤岳清	4,540,914.00	0.79%
8	郑小明	3,860,000.00	0.67%
9	吉烈钧	3,570,077.00	0.62%
10	富国基金-招商银行-富国基金招商银行-量化对冲 4 号混合型	3,345,008.00	0.58%

安信一带一路分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海明沅投资管理有限公司-明沅稳健增长 2 期私募投资基金	9,020,489.00	7.01%
2	宋伟铭	6,842,654.00	5.32%
3	上海明沅投资管理有限公司-明沅多策略对冲 10 号基金	6,443,170.00	5.01%
4	南京盛泉恒元投资有限公司-盛泉恒元多策略市场中性 3 号基金	2,680,283.00	2.08%

5	富国基金—国泰君安证券—兴业财富资产管理有限公司	2,593,849.00	2.02%
6	魏新旺	2,577,191.00	2.00%
7	黎德望	2,450,720.45	1.90%
8	梁建海	2,409,778.39	1.87%
9	中融国际信托有限公司—中融—融金添利单一资金信托	1,394,680.00	1.08%
10	张富生	1,352,920.82	1.05%

9.3 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	一带一 A	0.00	0.0000%
	一带一 B	0.00	0.0000%
	一带分级	14,226.61	0.0111%
	合计	14,226.61	0.0011%

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）。

9.4 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	一带一 A	0
	一带一 B	0
	一带分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	一带一 A	0
	一带一 B	0
	一带分级	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	一带一 A	一带一 B	一带分级
基金合同生效日（2015 年 5 月 14）	174,086,578.00	174,086,578.00	52,664,604.45

日) 基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	355,771,300.00	355,771,300.00	87,545,226.85
本报告期基金总申购份额	-	-	1,504,029,578.72
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,059,965,002.37
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	217,993,696.00	217,993,696.00	-402,899,358.38
本报告期期末基金份额总额	573,764,996.00	573,764,996.00	128,710,444.82

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 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	
国信证券	2	759,068,657.14	33.95%	539,927.03	33.71%	-
国泰君安	2	569,441,407.45	25.47%	416,431.75	26.00%	-
金元证券	2	382,788,520.97	17.12%	272,276.39	17.00%	-
安信证券	2	339,791,361.75	15.20%	241,695.06	15.09%	-
财通证券	2	184,734,985.17	8.26%	131,398.96	8.20%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

	提示性公告		
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	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2015 年第四季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 20 日
5	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
6	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 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 1 月 28 日
8	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
9	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 29 日
10	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
11	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 5 日
12	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
13	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 26 日
14	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 1 日

	不定期份额折算的风险提示公告		
15	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 11 日
16	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
17	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 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
18	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工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购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 30 日
19	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
20	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
21	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
22	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 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
23	安信基金管理有限公司关于旗下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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 28 日
24	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
25	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 13 日
26	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

27	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
28	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 21 日
29	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 27 日
30	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
31	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 3 日
32	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 14 日
33	安信中证一带一路主题指数分级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 6 月 15 日
34	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
35	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
36	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 21 日
37	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
38	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
39	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 5 日

	公告		
40	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
41	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
42	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
43	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2016 年第二季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 20 日
44	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 8 月 2 日
45	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
46	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
47	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 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
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 9 月 28 日
49	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2016 年第三季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 10 月 24 日
50	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
51	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
52	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
53	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

54	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
55	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
56	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金定期份额折算及折算期间暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 12 日
57	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
58	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
59	关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间一带一 A 份额停复牌的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 16 日
60	关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 19 日
61	关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之一带一 A 份额定期份额折算前收盘价调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 19 日
62	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工商银行股份有限公司 2017 年开展的基金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 12 月 29 日
63	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
64	安信中证一带一路主题指数分级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 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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

13.3 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