

# 安信尊享纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信尊享纯债
基金主代码	003395
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 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	3,294,376,973.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制组合净值波动率的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券和信用类固定收益类证券之间的配置比例。发挥基金管理人的信用研究优势以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。同时，通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。在债券投资方面，灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币

	市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。
--	-----------------------------------

### 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	0755-82943666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95565
传真		0755-82799292	0755-82960794

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	38,125,279.65
本期利润	40,724,445.90
加权平均基金份额本期利润	0.0140
本期基金份额净值增长率	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0115

期末基金资产净值	3,332,264,799.02
期末基金份额净值	1.0115

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；

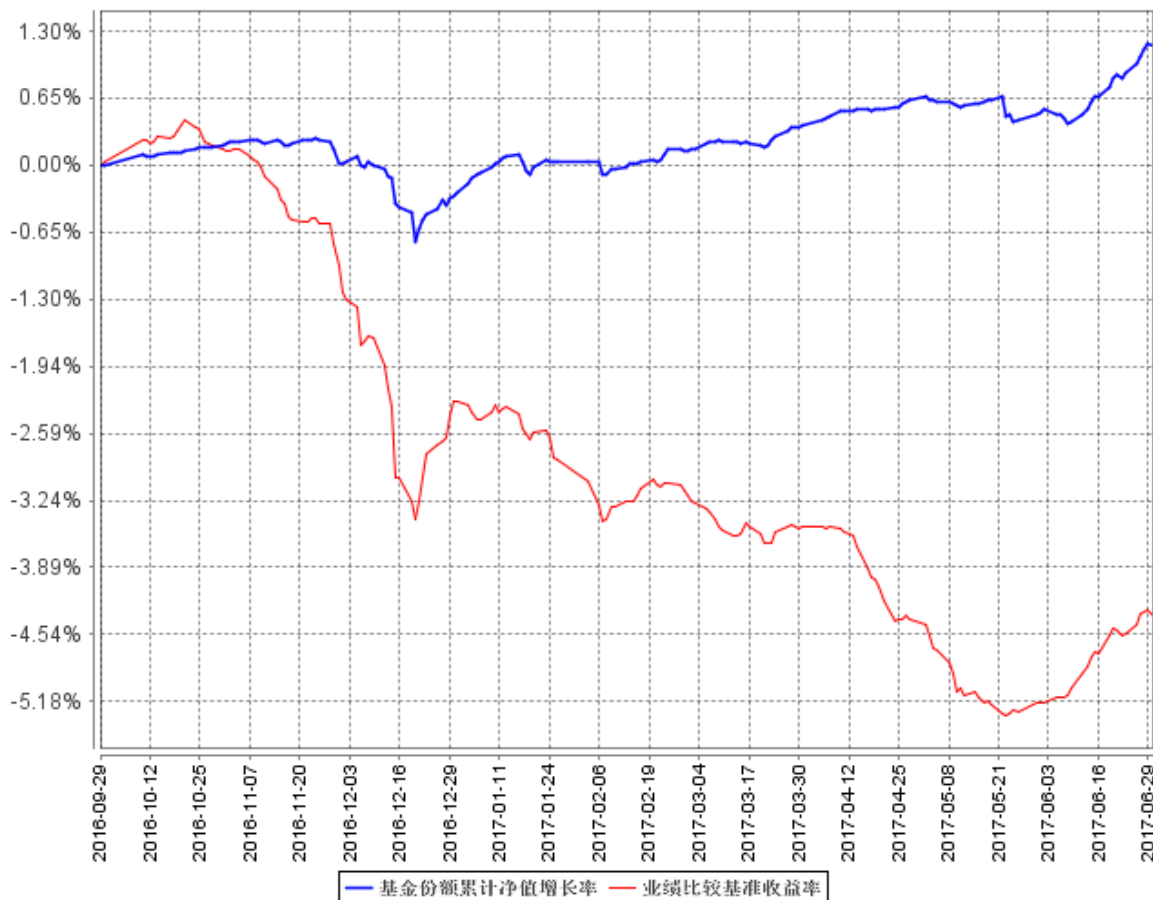
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	0.65%	0.04%	0.90%	0.06%	-0.25%	-0.02%
过去三个月	0.76%	0.04%	-0.88%	0.08%	1.64%	-0.04%
过去六个月	1.42%	0.04%	-2.11%	0.08%	3.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.15%	0.05%	-4.35%	0.11%	5.50%	-0.06%

### 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、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 29 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；  
 2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 34 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；从 2017 年 1 月 13 日起管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深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		
张翼飞	本基金的基金经理	2016 年 9 月 29 日	-	6.5	张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、财务主管，上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理；现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金。



					证券投资基金的基金经理。
王坤	本基金基金经理助理	2016年10月17日	-	2	王坤先生，金融学硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。现任安信基金目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信稳健增值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、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券式证券投资基金、安信尊享纯债债券型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。

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 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

本报告期内，资本市场经历了货币政策先紧后松的过程，期间监管政策也从相对密集到更加中性，固定收益市场也相应的经历了先大跌，后显著反弹的过程。我们在报告期的前半部分坚持了短久期、中高仓位、中高评级的策略，在前期的市场调整中，净值保持了稳定增长，有效的规避了市场波动风险；后期反弹开始，我们经过分析研究认为，这一轮反弹将具有相当的可持续性。我们迅速、适当的增加了仓位和久期，拿出一部分仓位，投资了期限略长的利率债和金融债，在 6 月中下旬的反弹过程中净值创出年内新高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0115 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.42%，业绩比较基准收益率为-2.11%。

### 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 年下半年，我们的基本观点是：1、近期经济数字虽略超预期，但其显著性不足以对利率中枢产生重要影响。2、如果外汇汇率和外储保持相对稳定，预期通胀提升的风险不大。3、外汇汇率和外储当前已经稳住，但是后期需要持续观察，仍存在一定风险。这很可能是影响利率环境最大的风险因素。4、政策仍处于强监管范畴，但市场经过半年的自适应，目前的韧性已经显著增强。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。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。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管

理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经历。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。

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。截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供定价服务。

#### **4.7 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金出现了基金持有人数不满 200 人的情形，时间范围为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 3 月 1 日、2017 年 3 月 30 日至 2017 年 6 月 21 日。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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尊享纯债债券型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信尊享纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	8,750,044.71	5,372,367.00
结算备付金	-	6,244,586.39
存出保证金	44,441.82	25,652.96
交易性金融资产	4,601,923,787.40	2,127,791,282.10
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,123,923,787.40	2,127,791,282.10
资产支持证券投资	478,000,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	49,615,901.17	9,234,773.19
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,660,334,175.10	2,148,668,661.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,326,476,570.28	354,499,083.25
应付证券清算款	-	1,724,285.10
应付赎回款	1,005.73	2,070.28
应付管理人报酬	817,869.38	455,457.40
应付托管费	272,623.11	151,819.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	123,215.02	34,012.57
应交税费	-	-
应付利息	174,574.07	51,206.54
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	203,518.49	135,000.09
负债合计	1,328,069,376.08	357,052,934.35
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,294,376,973.58	1,796,478,504.35
未分配利润	37,887,825.44	-4,862,777.06
所有者权益合计	3,332,264,799.02	1,791,615,727.29
负债和所有者权益总计	4,660,334,175.10	2,148,668,661.64

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 3,294,376,973.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信尊享纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	62,026,904.83
1.利息收入	72,620,269.60
其中：存款利息收入	135,147.28
债券利息收入	67,468,088.93
资产支持证券利息收入	4,933,926.57
买入返售金融资产收入	83,106.82
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-13,198,313.21
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-13,198,313.21
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,599,166.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,782.19
<b>减：二、费用</b>	21,302,458.93
1. 管理人报酬	4,294,751.42
2. 托管费	1,431,583.81
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	57,153.86
5. 利息支出	15,326,551.35
其中：卖出回购金融资产支出	15,326,551.35
6. 其他费用	192,418.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	40,724,445.90

减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>40,724,445.90</b>

注：本基金的基金合同于 2016 年 9 月 29 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信尊享纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,796,478,504.35	-4,862,777.06	1,791,615,727.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,724,445.90	40,724,445.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,497,898,469.23	2,026,156.60	1,499,924,625.83
其中：1.基金申购款	1,498,574,167.83	2,027,513.61	1,500,601,681.44
2.基金赎回款	-675,698.60	-1,357.01	-677,055.61
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）	3,294,376,973.58	37,887,825.44	3,332,264,799.02



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>尚尔航</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信尊享纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2016 年 9 月 5 日下发的证监许可[2016]2036 号文“关于准予安信尊享纯债债券型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信尊享纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2016 年 9 月 23 日至 2016 年 9 月 26 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字 60962175\_H62 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 200,379,866.24 元。经向中国证监会备案，《安信尊享纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效。截至 2016 年 9 月 28 日止，安信尊享纯债债券型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 200,379,866.24 元，折合 200,379,866.24 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 22.78 元，折合 22.78 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 200,379,889.02 元，折合 200,379,889.02 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

#### 6.4.6.2 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。

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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。

#### 6.4.6.3 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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入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。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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	基金管理人的股东、基金销售机构

券")	
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：1)本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2)本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。

3)以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,294,751.42
其中：支付销售机构的客户维护费	138.09

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,431,583.81

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券	8,750,044.71	84,219.27

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按约定利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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余额为 1,326,476,570.28 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111719125	17 恒丰银行 CD125	2017 年 7 月 4 日	97.82	500,000	48,910,000.00
111614218	16 江苏银行 CD218	2017 年 7 月 7 日	96.27	500,000	48,135,000.00
111791652	17 杭州银行 CD042	2017 年 7 月 7 日	96.77	580,000	56,126,600.00
150203	15 国开 03	2017 年 7 月 7 日	99.31	116,000	11,519,960.00
150309	15 进出 09	2017 年 7 月 7 日	100.09	820,000	82,073,800.00
150409	15 农发 09	2017 年 7 月 7 日	100.04	1,560,000	156,062,400.00
160215	16 国开 15	2017 年 7 月 7 日	96.84	400,000	38,736,000.00
111608349	16 中信 CD349	2017 年 7 月 7 日	96.58	500,000	48,290,000.00
111680425	16 杭州银行 CD183	2017 年 7 月 7 日	96.31	500,000	48,155,000.00
111795431	17 徽商银行 CD067	2017 年 7 月 4 日	95.52	180,000	17,193,600.00
111610593	16 兴业 CD593	2017 年 7 月 7 日	96.55	1,000,000	96,550,000.00
160301	16 进出 01	2017 年 7 月 7 日	98.09	500,000	49,045,000.00
111680856	16 广州农村商业银行 CD154	2017 年 7 月 4 日	96.22	500,000	48,110,000.00

160208	16 国开 08	2017 年 7 月 7 日	97.83	1,400,000	136,962,000.00
160402	16 农发 02	2017 年 7 月 7 日	98.14	2,400,000	235,536,000.00
150309	15 进出 09	2017 年 7 月 6 日	100.09	1,500,000	150,135,000.00
150212	15 国开 12	2017 年 7 月 7 日	99.70	500,000	49,850,000.00
150414	15 农发 14	2017 年 7 月 7 日	99.57	400,000	39,828,000.00
170204	17 国开 04	2017 年 7 月 7 日	99.57	330,000	32,858,100.00
合计				14,186,000	1,394,076,460.00

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	4,601,923,787.40	98.75
	其中：债券	4,123,923,787.40	88.49
	资产支持证券	478,000,000.00	10.26
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	8,750,044.71	0.19
7	其他各项资产	49,660,342.99	1.07
8	合计	4,660,334,175.10	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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

本基金本报告期内未进行股票买卖。

### 7.4.2 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

本基金本报告期内未进行股票买卖。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票买卖。

## 7.5 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	248,820,787.40	7.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,428,606,000.00	72.88
	其中：政策性金融债	1,934,446,000.00	58.05
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	1,446,497,000.00	43.41
9	其他	-	-
10	合计	4,123,923,787.40	123.76



### 7.6 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	150409	15 农发 09	4,800,000	480,192,000.00	14.41
2	150309	15 进出 09	4,000,000	400,360,000.00	12.01
3	160208	16 国开 08	3,500,000	342,405,000.00	10.28
4	160402	16 农发 02	2,400,000	235,536,000.00	7.07
5	179917	17 贴现国债 17	2,000,000	198,580,000.00	5.96

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	142588	借呗 09A1	1,980,000	198,000,000.00	5.94
2	142593	花呗 16A1	1,600,000	160,000,000.00	4.80
3	142914	花呗 21A1	1,200,000	120,000,000.00	3.60

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 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。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

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。

#### 7.11.2

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。

#### 7.11.3 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	44,441.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,615,901.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,660,342.99

#### 7.11.4 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。

#### **7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

#### **7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
286	11,518,800.61	3,294,301,907.47	100.00%	75,066.11	0.00%

### 8.2 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	-	0.0000%

### 8.3 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月29日）基金份额总额	200,379,889.02
本报告期期初基金份额总额	1,796,478,504.35
本报告期基金总申购份额	1,498,574,167.83
减：本报告期基金总赎回份额	675,698.60
本报告期期末基金份额总额	3,294,376,973.58

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
国信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《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》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 10.7.2 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	201,874,646.34	100.00%	3,066,600,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	1,796,328,960.47	1,497,972,947.00	-	3,294,301,907.47	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。



## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 24 日