

安信新视野灵活配置混合型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 | 安信新视野混合 | |
| 基金主代码 | 003895 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 379,868,617.30 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 安信新视野混合 A | 安信新视野混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 003895 | 003896 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 299,864,102.90 份 | 80,004,514.40 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 在“十三五”开局之际，供给侧结构性改革持续深入，投资者应当以新视野观察经济的运行态势、看待资产配置结构。在增强经济增长动力、淘汰落后产能的过程中，部分优质领域和企业将带来超额的投资回报。本基金旨在追求稳健的投资回报，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，通过多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。本基金的资产配置策略以基于宏观、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。本基金将自上 |

| | |
|--------|--|
| | 而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用品种配置、久期配置、信用配置、利率和回购等投资策略，选择流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种，实现组合稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-------------------------|----------------------|
| 名称 | | 安信基金管理有限责任公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 乔江晖 | 王永民 |
| | 联系电话 | 0755-82509999 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | service@essencefund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008-088-088 | 95566 |
| 传真 | | 0755-82799292 | 010-66594942 |

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

| 基金级别 | 安信新视野混合 A | 安信新视野混合 C |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 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) | 报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 6,778,935.80 | 1,464,264.82 |
| 本期利润 | 11,010,919.29 | 2,341,630.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0325 | 0.0262 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.99% | 2.88% |
| 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 | 0.0188 | 0.0176 |
| 期末基金资产净值 | 308,975,995.24 | 82,342,202.87 |
| 期末基金份额净值 | 1.0304 | 1.0292 |

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

安信新视野混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.05% | 0.10% | 2.92% | 0.34% | -1.87% | -0.24% |

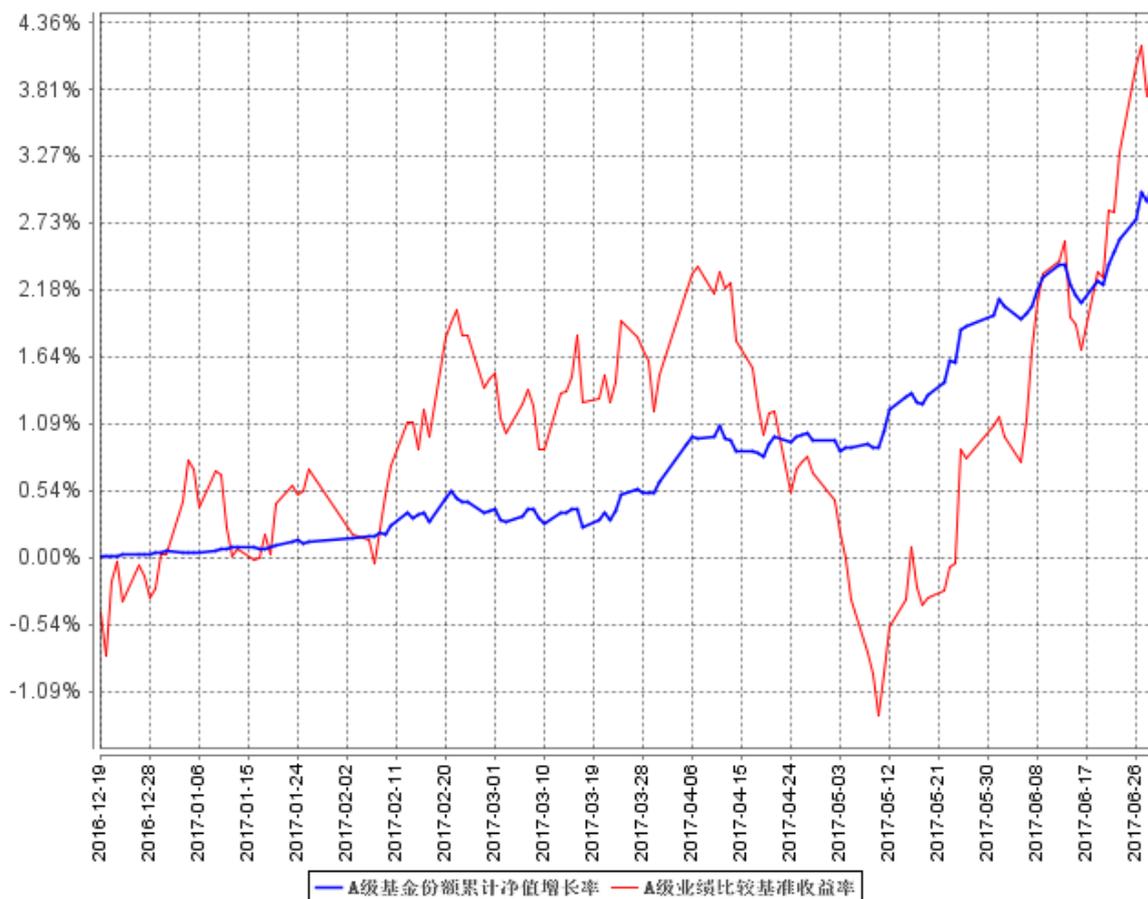
| | | | | | | |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.42% | 0.10% | 2.49% | 0.33% | -0.07% | -0.23% |
| 过去六个月 | 2.99% | 0.08% | 3.99% | 0.30% | -1.00% | -0.22% |
| 自基金合同 生效起至今 | 3.04% | 0.08% | 4.02% | 0.30% | -0.98% | -0.22% |

安信新视野混合 C

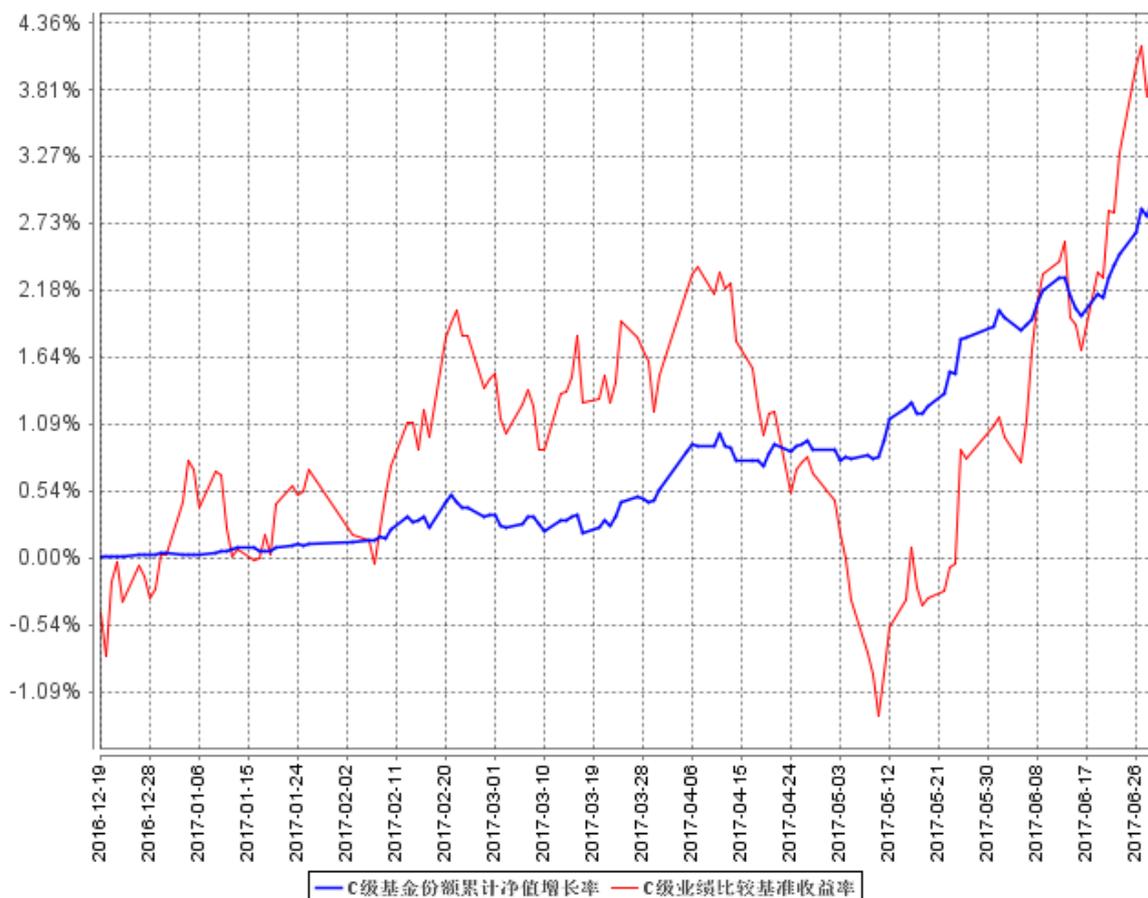
| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.02% | 0.10% | 2.92% | 0.34% | -1.90% | -0.24% |
| 过去三个月 | 2.36% | 0.09% | 2.49% | 0.33% | -0.13% | -0.24% |
| 过去六个月 | 2.88% | 0.08% | 3.99% | 0.30% | -1.11% | -0.22% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.92% | 0.08% | 4.02% | 0.30% | -1.10% | -0.22% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2016 年 12 月 19 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 | 说明 |
|----|----|-----------------|-----|----|
|----|----|-----------------|-----|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 业年限 | |
|-----|----------|------------------|------|-----|--|
| 杨凯玮 | 本基金的基金经理 | 2016 年 12 月 19 日 | - | 11 | <p>杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理</p> |

| | | | | | |
|-----|------------|------------------|---|----|--|
| | | | | | 货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。 |
| 任凭 | 本基金的基金经理助理 | 2016 年 12 月 19 日 | - | 10 | 任凭女士，法学硕士。先后在招商基金管理有限公司、安信基金管理有限责任公司工作，现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信保证金交易型货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、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助理。 |
| 肖芳芳 | 本基金的基金经理助理 | 2016 年 12 月 19 日 | - | 6 | 肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016 年 4 月 5 日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市 |

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

一季度初，市场处于去年 12 月债灾之后的反弹过程中。我们当时认为债市虽然已经明显好转，但仍存在一些隐忧，例如美联储加息、MPA 考核、债灾之后银行委外的撤回等。所以适当减持了长债，增配了短债。总的来说，在本报告期内，维持了中等久期、中高评级、中高杠杆获取利差的配置策略。二季度宏观基本面基本稳定、略有转弱，在因监管走严导致的利率全面上行的大背景下，工业生产增速、投融资增速等方面相对一季度出现了回落。监管面上演过山车：4 月银监局连续发文加要求银行进行自查，引发了委外赎回和债券市场的一波收益率快速上行；5 月下旬至 6 月初，在“不因处置风险引发新风险”的声音发出后，央行在公开市场的操作明显出现了缓和，资金面大部分时间比较宽松，债市也有所缓和；6 月 12 号银行自查报告得到银监局许可延期后，债券市场情绪全面好转。

固定收益方面，产品今年以来一直保持短久期策略，4 月底前新增配置仅有存单。4 月底、5 月初债市大幅调整时，在一、二级市场均进行了一定配置，6 月监管转缓，产品开始拉长债券久期，以博取更多收益。整体来看，操作稳健，对产品收益做出稳定贡献。

权益方面，一季度末起建立稳定打新底仓，以上证 50 成分股为主，因此上半年股票方面表现优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新视野混合 A 基金份额净值为 1.0304 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.99%;截至本报告期末安信新视野混合 C 基金份额净值为 1.0292 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.88%;同期业绩比较基准收益率为 3.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年底至 2017 年上半年,金融市场最大的风险是监管政策风险,监管去杠杆愈演愈烈,导致债券市场收益率全面上行、股市也一度出现调整。经过半年左右时间的调整,我们认为去杠杆已经取得了一定的成效。但考虑到:1) 监管政策尚未落地,本轮去杠杆尚未有最终定论;2) 浮亏或收益率不达预期的委外户尚未出清;商业银行风险释放的过程会较长,急速冲击引起的快速大幅调整可能难以再次出现。机会仍然可能出现在两个时间。1) 新的监管办法出台后的情绪冲击,鉴于机构久期均不长,更可能是利空出尽的信号;2) 银行为符合监管要求调整资产带来收益率的波动,由于银行资产不确定性,以及优质资产处置速度快于相对较差资产,这种时机可以获得的有价格优势资产往往资质较差;经济的潜在增长下降是一致预期,短期扰动可能是机会。固收方面,我们认为当前债券市场最黑暗的时候已经过去,相应策略策略是谨慎中逐步拉长久期。权益方面,考虑到中报风险,结合当前白马的成长性以及估值水平,未来 1-2 个季度,本产品将适当增加低估值行业配置比例,看好周期行业的短期业绩修复性机会。

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，本基金出现了连续 20 个工作日基金持有人数不满 200 人的情形，时间范围为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 3 月 23 日、2017 年 3 月 31 日至 2017 年 6 月 20 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信新视野灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：安信新视野灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 6,550,181.26 | 167,862,985.19 |
| 结算备付金 | 50,737.18 | - |
| 存出保证金 | 74,834.29 | - |
| 交易性金融资产 | 489,999,576.67 | 14,245,000.00 |
| 其中：股票投资 | 62,591,873.17 | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 415,339,703.50 | 14,245,000.00 |
| 资产支持证券投资 | 12,068,000.00 | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 112,600,000.00 |
| 应收证券清算款 | 38,901.00 | - |
| 应收利息 | 3,602,389.94 | 274,832.73 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 500,316,620.34 | 294,982,817.92 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 负 债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 108,399,637.40 | - |
| 应付证券清算款 | - | 14,341,422.56 |
| 应付赎回款 | 10.11 | 376.22 |
| 应付管理人报酬 | 303,216.25 | 73,567.53 |
| 应付托管费 | 56,853.06 | 13,793.91 |
| 应付销售服务费 | 13,442.48 | 11,806.32 |
| 应付交易费用 | 31,843.30 | - |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 14,901.12 | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 178,518.51 | - |
| 负债合计 | 108,998,422.23 | 14,440,966.54 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 379,868,617.30 | 280,416,767.64 |
| 未分配利润 | 11,449,580.81 | 125,083.74 |
| 所有者权益合计 | 391,318,198.11 | 280,541,851.38 |
| 负债和所有者权益总计 | 500,316,620.34 | 294,982,817.92 |

注：报告截止日为 2017 年 6 月 30 日，安信新视野灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0304 元，安信新视野灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0292 元；基金份额总额 379,868,617.30 份，其中安信新视野灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 299,864,102.90 份，安信新视野灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 80,004,514.40 份。

6.2 利润表

会计主体：安信新视野灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|-----------------------|---------------------------------------|
| 一、收入 | 16,634,669.26 |
| 1.利息收入 | 8,263,375.20 |
| 其中：存款利息收入 | 202,777.91 |
| 债券利息收入 | 6,716,951.82 |
| 资产支持证券利息收入 | 210,261.50 |
| 买入返售金融资产收入 | 1,133,383.97 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 3,236,295.36 |
| 其中：股票投资收益 | 2,259,499.26 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | -17,154.96 |
| 资产支持证券投资收益 | -1,063.56 |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 995,014.62 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 5,109,349.16 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 25,649.54 |
| 减：二、费用 | 3,282,119.48 |
| 1. 管理人报酬 | 1,681,722.89 |
| 2. 托管费 | 315,322.98 |
| 3. 销售服务费 | 89,319.41 |
| 4. 交易费用 | 142,914.75 |
| 5. 利息支出 | 855,544.49 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 855,544.49 |

| | |
|---------------------|---------------|
| 6. 其他费用 | 197,294.96 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 13,352,549.78 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 13,352,549.78 |

注：本基金的基金合同于 2016 年 12 月 19 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：安信新视野灵活配置混合型证券投资基金

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） | 280,416,767.64 | 125,083.74 | 280,541,851.38 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13,352,549.78 | 13,352,549.78 |
| 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） | 99,451,849.66 | -2,028,052.71 | 97,423,796.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 299,465,820.15 | 539,094.05 | 300,004,914.20 |
| 2.基金赎回款 | -200,013,970.49 | -2,567,146.76 | -202,581,117.25 |
| 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) | 379,868,617.30 | 11,449,580.81 | 391,318,198.11 |

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：

| | | |
|--------------|-------------|--------------|
| _____ 刘入领 | _____ 范瑛 | _____ 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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信新视野灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2016 年 11 月 15 日下发的证监许可[2016]2704 号文“关于核准安信新视野灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新视野灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2016 年 12 月 6 日至 2016 年 12 月 13 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_H71 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 280,403,679.84 元。经向中国证监会备案，《安信新视野灵活配置混合型证券投资基金》于 2016 年 12 月 19 日正式生效。截至 2016 年 12 月 15 日止，安信新视野灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 280,403,679.84 元，折合 280,403,679.84 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 15,583.29 元，折合 15,583.29 份基金份额。其中 A 类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 100,402,169.84 元，折合 100,402,169.84 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 5,583.07 元，折合 5,583.07 份基金份额。C 类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 180,001,510.00 元，折合 180,001,510.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 10,000.22 元，折合 10,000.22 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 280,419,263.13 元，折合 280,419,263.13 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有

限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、其他货币市场工具等，股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等，国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提；

(3) 基金销售服务费，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20%年费率计提；

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则如下：

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

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

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

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

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

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 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

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“ | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

| | |
|-------------------------|-----------------|
| 安信基金”) | |
| 中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 安信证券股份有限公司(以下简称“安信证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 五矿资本控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 佛山市顺德区新碧贸易有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中广核财务有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 安信乾盛财富管理(深圳)有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司 | 基金管理人子公司的子公司 |

注：1、本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司。
 2、本基金管理人子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司。
 3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 安信证券 | 59,407,357.36 | 48.26% |

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | |
|-------|----------------------------|------------|----------|--------------|
| | 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 | 42,255.98 | 48.26% | - | - |

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。

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 | 1,681,722.89 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.95 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

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 | 315,322.98 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信新视野混合 A | 安信新视野混合 C | 合计 |
| 安信基金 | - | 89,314.59 | 89,314.59 |
| 合计 | - | 89,314.59 | 89,314.59 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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 |
| | | |

| | | |
|------|--------------|-----------|
| 中国银行 | 6,550,181.26 | 70,803.92 |
|------|--------------|-----------|

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603933 | 睿能科技 | 2017年6月28日 | 2017年7月6日 | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857 | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017年6月30日 | 2017年7月10日 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017年6月27日 | 2017年7月5日 | 新股流通受限 | 9.63 | 9.63 | 999 | 9,620.37 | 9,620.37 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017年6月23日 | 2017年7月3日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------|---------|---------|----|
| 600172 | 黄河旋风 | 2017年6月30日 | 重大事项 | 8.23 | 2017年7月14日 | 8.00 | 12,900 | 108,489 | 106,167 | - |

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 108,399,637.4 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 |
|-----------|-------------------|-----------|--------|-----------|----------------|
| 111719130 | 17 恒丰银行 CD130 | 2017年7月7日 | 98.89 | 500,000 | 49,445,000.00 |
| 011751041 | 17 桂投资 SCP002 | 2017年7月7日 | 100.13 | 120,000 | 12,015,600.00 |
| 111798066 | 17 广州农村商业银行 CD093 | 2017年7月7日 | 97.75 | 500,000 | 48,875,000.00 |
| 合计 | | | | 1,120,000 | 110,335,600.00 |

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 | 62,591,873.17 | 12.51 |
| | 其中：股票 | 62,591,873.17 | 12.51 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,407,703.50 | 85.43 |
| | 其中：债券 | 415,339,703.50 | 83.02 |
| | 资产支持证券 | 12,068,000.00 | 2.41 |
| 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 | 6,600,918.44 | 1.32 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,716,125.23 | 0.74 |
| 8 | 合计 | 500,316,620.34 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 19,108,572.45 | 4.88 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,989,454.00 | 1.53 |
| E | 建筑业 | 5,257,063.00 | 1.34 |
| F | 批发和零售业 | 437,010.00 | 0.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,828,210.00 | 1.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | 107,456.00 | 0.03 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 210,900.00 | 0.05 |
| J | 金融业 | 25,101,961.72 | 6.41 |
| K | 房地产业 | 332,058.00 | 0.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | 110,126.00 | 0.03 |
| 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 | 109,062.00 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 62,591,873.17 | 16.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 71,700 | 3,557,037.00 | 0.91 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 600036 | 招商银行 | 147,564 | 3,528,255.24 | 0.90 |
| 3 | 603288 | 海天味业 | 85,400 | 3,482,612.00 | 0.89 |
| 4 | 600104 | 上汽集团 | 111,800 | 3,471,390.00 | 0.89 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 149,600 | 3,229,864.00 | 0.83 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 174,700 | 2,945,442.00 | 0.75 |
| 7 | 601633 | 长城汽车 | 214,180 | 2,846,452.20 | 0.73 |
| 8 | 601390 | 中国中铁 | 323,700 | 2,806,479.00 | 0.72 |
| 9 | 601818 | 光大银行 | 685,400 | 2,775,870.00 | 0.71 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 775,200 | 2,728,704.00 | 0.70 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的半年度报告正文。

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

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 | 601628 | 中国人寿 | 3,297,592.00 | 1.18 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 3,286,445.88 | 1.17 |
| 3 | 601766 | 中国中车 | 3,284,409.00 | 1.17 |
| 4 | 601288 | 农业银行 | 3,284,337.00 | 1.17 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 3,280,657.09 | 1.17 |
| 6 | 601238 | 广汽集团 | 3,280,482.00 | 1.17 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 3,280,018.00 | 1.17 |
| 8 | 601818 | 光大银行 | 3,279,904.00 | 1.17 |
| 9 | 601998 | 中信银行 | 3,276,838.00 | 1.17 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 3,276,447.25 | 1.17 |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 3,275,895.00 | 1.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 600016 | 民生银行 | 3,273,290.00 | 1.17 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 3,268,431.00 | 1.17 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 3,262,599.00 | 1.16 |
| 15 | 601601 | 中国太保 | 3,256,137.08 | 1.16 |
| 16 | 601633 | 长城汽车 | 3,140,307.20 | 1.12 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 3,111,750.00 | 1.11 |
| 18 | 601006 | 大秦铁路 | 3,069,441.00 | 1.09 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 3,066,837.00 | 1.09 |
| 20 | 600011 | 华能国际 | 3,052,533.00 | 1.09 |

注：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。

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

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 | 600519 | 贵州茅台 | 3,688,020.00 | 1.31 |
| 2 | 601238 | 广汽集团 | 3,583,897.00 | 1.28 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 3,216,992.00 | 1.15 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 3,191,084.71 | 1.14 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 3,157,669.00 | 1.13 |
| 6 | 601628 | 中国人寿 | 3,100,092.00 | 1.11 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 1,844,591.00 | 0.66 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 940,048.00 | 0.34 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 880,726.00 | 0.31 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 874,424.00 | 0.31 |
| 11 | 601766 | 中国中车 | 762,358.00 | 0.27 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 619,155.00 | 0.22 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 13 | 600690 | 青岛海尔 | 608,000.00 | 0.22 |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 581,457.00 | 0.21 |
| 15 | 601818 | 光大银行 | 496,925.00 | 0.18 |
| 16 | 600016 | 民生银行 | 467,000.00 | 0.17 |
| 17 | 603288 | 海天味业 | 431,700.00 | 0.15 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 370,108.00 | 0.13 |
| 19 | 601390 | 中国中铁 | 353,096.00 | 0.13 |
| 20 | 601633 | 长城汽车 | 348,753.00 | 0.12 |

注：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。

7.4.3 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 | 90,056,625.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 34,169,819.06 |

注：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。

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 | 29,967,000.00 | 7.66 |
| 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 | 110,292,000.00 | 28.18 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 294,703.50 | 0.08 |

| | | | |
|----|------|----------------|--------|
| 8 | 同业存单 | 274,786,000.00 | 70.22 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 415,339,703.50 | 106.14 |

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 | 111719130 | 17 恒丰银行 CD130 | 500,000 | 49,445,000.00 | 12.64 |
| 2 | 111798066 | 17 广州农村商业银行 CD093 | 500,000 | 48,875,000.00 | 12.49 |
| 3 | 011754075 | 17 杉杉 SCP001 | 300,000 | 30,072,000.00 | 7.68 |
| 4 | 019546 | 16 国债 18 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.66 |
| 5 | 111792491 | 17 广州农村商业银行 CD022 | 300,000 | 29,343,000.00 | 7.50 |

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 | 1789045 | 17 上和 1A1 | 200,000 | 12,068,000.00 | 3.08 |

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股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 74,834.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 38,901.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,602,389.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,716,125.23 |

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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

| 份额 级别 | 持有人 户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------------------|------------------|---------------|----------------|------------|------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比 例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 安 信 新 视 野 混 合 A | 261 | 1,148,904.61 | 299,461,355.67 | 99.87% | 402,747.23 | 0.13% |
| 安 信 新 视 野 混 合 C | 4 | 20,001,128.60 | 80,004,444.44 | 100.00% | 69.96 | 0.00% |
| 合计 | 265 | 1,433,466.48 | 379,465,800.11 | 99.89% | 402,817.19 | 0.11% |

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额 比例 |
|----------------------|---------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 安信新视 野混合 A | 100,010.84 | 0.0334% |
| | 安信新视 野混合 C | - | - |
| | 合计 | 100,010.84 | 0.0263% |

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）。

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金 | 安信新视野混合 A | 0 |
| | 安信新视野混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开 放式基金 | 安信新视野混合 A | 0 |
| | 安信新视野混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 安信新视野混合 A | 安信新视野混合 C |
|-------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 19 日）基金 份额总额 | 100,407,752.91 | 180,011,510.22 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 100,406,467.55 | 180,010,300.09 |
| 本报告期基金总申购份额 | 299,465,789.10 | 31.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 100,008,153.75 | 100,005,816.74 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 299,864,102.90 | 80,004,514.40 |

§ 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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），其自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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 | | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | |
|------|--|------|-----------|--|
| | | | | |

| | 交易单元 数量 | 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 | 备注 |
|------|------------|---------------|----------------------|-----------|----------------|----|
| 安信证券 | 2 | 59,407,357.36 | 48.26% | 42,255.98 | 48.26% | - |
| 长江证券 | 2 | 63,683,482.94 | 51.74% | 45,297.49 | 51.74% | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 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 |
| 安信证券 | 36,300,144.00 | 78.44% | 30,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 长江证券 | 9,980,340.20 | 21.56% | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 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 | 20170101-20170613 | 200,009,111.12 | - | 200,009,111.12 | - | 0.00% |
| | 2 | 20170208-20170630 | - | 299,459,972.05 | - | 299,459,972.05 | 78.83% |
| | 3 | 20170101-20170207 /20170627-20170630 | 80,004,444.44 | - | - | 80,004,444.44 | 21.06% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> | | | | | | | |

(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