

# 安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	24
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
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.....	63

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信动态策略混合	
基金主代码	001185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	356,952,829.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C
下属分级基金的交易代码:	001185	002029
报告期末下属分级基金的份额总额	347,128,538.12 份	9,824,290.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	在资产配置上，结合政策因素、市场情绪与估值因素等，分析大类资产风险收益比，合理配置；在固定收益类的投资上，采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略，选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种；在股票投资上，秉承价值投资理念，灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略，把握市场定价偏差带来的投资机会；在衍生品投资上，合理利用权证等做套保或套利投资；在风险管理上，根据市场环境的变化，动态调整仓位和投资品种，并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	朱萍
	联系电话	0755-82509999	021-61618888
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95528
传真		0755-82799292	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		518026	200120
法定代表人		刘入领	高国富

### 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

### § 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	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 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	22,440,600.45	1,332,579.07
本期利润	34,343,127.63	2,089,439.81
加权平均基金份额本期利润	0.0947	0.0794
本期加权平均净值利润率	8.49%	7.23%
本期基金份额净值增长率	8.83%	8.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	48,195,516.16	1,362,274.87
期末可供分配基金份额利润	0.1388	0.1387
期末基金资产净值	408,020,624.58	11,511,655.72
期末基金份额净值	1.1754	1.1718
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	17.54%	13.00%

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

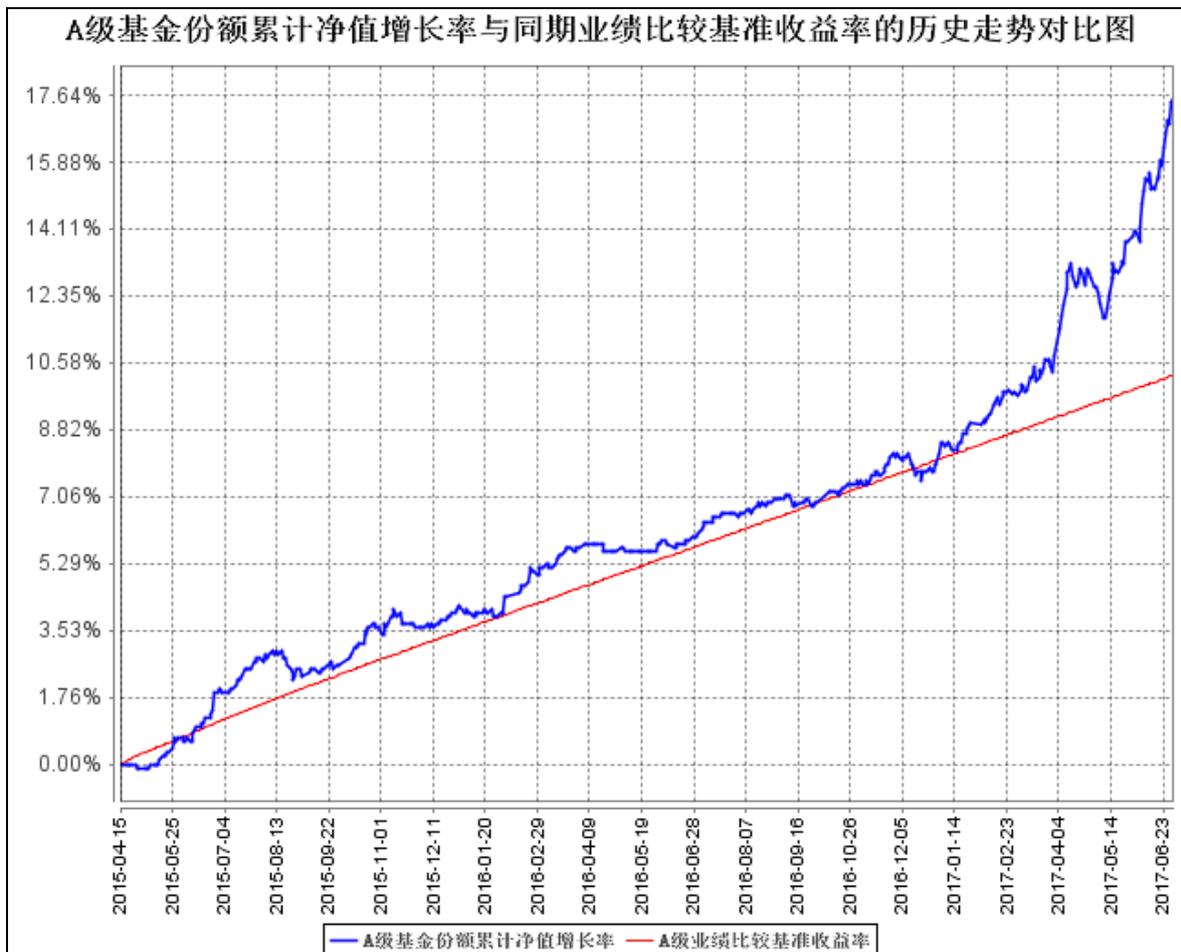
安信动态策略混合 A

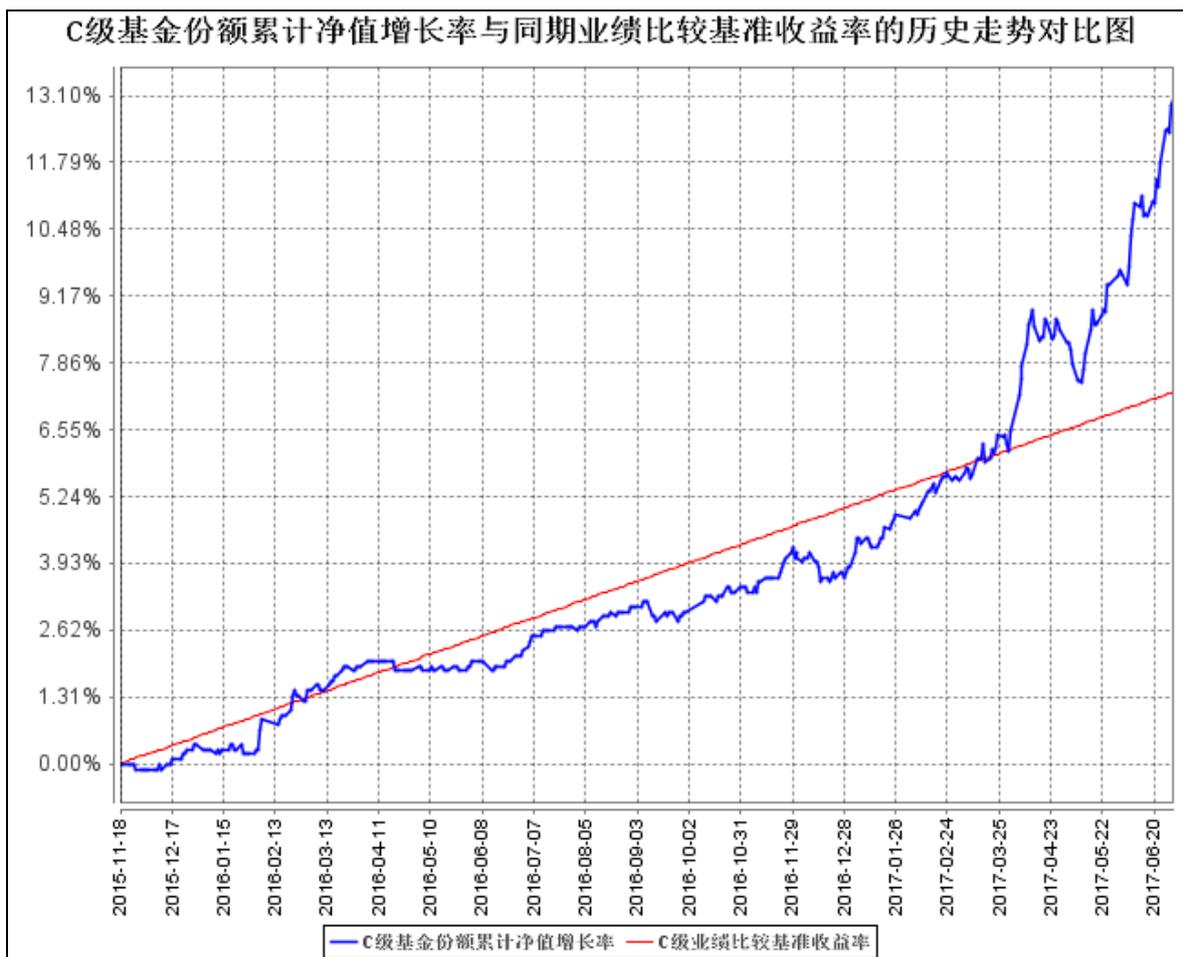
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.15%	0.26%	0.37%	0.01%	2.78%	0.25%
过去三个月	6.13%	0.25%	1.12%	0.01%	5.01%	0.24%
过去六个月	8.83%	0.20%	2.23%	0.01%	6.60%	0.19%
过去一年	10.89%	0.15%	4.50%	0.01%	6.39%	0.14%
自基金合同生效起至今	17.54%	0.12%	10.25%	0.01%	7.29%	0.11%

安信动态策略混合 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	3.13%	0.26%	0.37%	0.01%	2.76%	0.25%
过去三个月	6.08%	0.25%	1.12%	0.01%	4.96%	0.24%
过去六个月	8.80%	0.20%	2.23%	0.01%	6.57%	0.19%
过去一年	10.65%	0.15%	4.50%	0.01%	6.15%	0.14%
自基金合同生效起至今	13.00%	0.13%	7.29%	0.01%	5.71%	0.12%

### 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





注：1、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日，截至报告期末本基金合同生效已满一年；  
 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

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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	11	蓝雁书先生，理学硕士。历任桂林理工大学（原桂林工学院）理学院教师，华西证券有限责任公司证券研究所研究员，安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券

					投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015 年 7 月 10 日	-	7	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。  
 2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2017 年上半年，在地产、基建投资带动下，经济出现较大幅度回暖，工业企业利润增速有所抬升，上游行业特别是煤炭开采、黑色金属、石油开采等利润增幅较大，但由于对周期好转持续性存疑，市场迎来家电、食品饮料等为代表的增长确定性较高行业的领涨行情。进入二季度，由于下游需求平稳，上游涨价对中游利润的侵蚀并未得到扭转，加上监管层金融去杠杆政策的推进，A 股在二季度经历较大幅度调整，行情分化严重，家电、食品饮料等行业涨幅遥遥领先军工、农

林牧渔等行业。行情结构分化原因包括：（1）前期透支的估值逐步回归理性：上涨的大盘股具有低估值，业绩稳定，确定性强的特征，无法兑现业绩的高估值个股则跌幅较大。（2）制度性建设逐步落实：资本市场强监管态势持续发酵，投融资功能回归成为主线。（3）投资风格对接：沪港通深港通开通，海外资金入市，成熟机构投资者的进入逐步改变投资者结构和市场资金格局。

期间，安信动态策略基金坚持遵循绝对收益原则，主要持有业绩稳健、估值较低的金融、地产蓝筹股为主，配合参与低风险新股投资，配置高等级优质债券，缩短组合久期，取得了较好的投资业绩。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信动态策略混合 A 基金份额净值为 1.1754 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.83%；截至本报告期末安信动态策略混合 C 基金份额净值为 1.1718 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.80%；同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对未来一段时间 A 股行情持谨慎乐观态度，原因包括：

（1）出口、房地产投资和制造业投资超预期，经济下行幅度可能不会太大。我们认为海外经济回暖持续性较强，是基于未来一段时间海外利率提升水平有限，其对欧美制造业投资、房地产负面影响不大。此外，国内房地产库存低、三四线城市销售较好，地产投资不会有太大的波动。

（2）监管层去杠杆有所缓和，后续更多在实体经济领域推进改革。在实体回报率不高的情况下，强力推进去杠杆，未必能达到“脱虚向实”的政策目的，我们判断金融监管去杠杆最猛烈阶段已过，后续将可能在实体经济领域推进更多改革深化，以提升实体经济回报。

（3）短端利率下行、长端维持，利率曲线变化对市场中线偏正面。长端利率与历史高位相比还有空间，但是通胀预期不足减弱长端利率上升动力；短端利率，实际利率处于历史高位，通胀如果下行，未来短端利率下降的概率更大。

（4）A 股估值相对合理，但是去杠杆环境下系统性机会还需要等待，需要看到利率曲线持续得到修复或者改革实际推进。目前整体还在去杠杆过程中，利率大放水可能性不大。需要跟踪的是，十九大前后的相关改革进展，包括国企改革、放开民营资本投资领域的限制等，届时 A 股系统性机会或许会出现。

行业配置方面，我们首先会增加银行配置，是因为经济比预期的好，坏账担忧下降，同时金融严监管环境下，银行渠道优势显现，且从中外对比角度看，A 股银行更高的盈利能力，对应更低的估值水平，边际增量的北上资金更为青睐银行。同时，我们会配置建筑行业优质个股，主要

是基于估值合理，海内外订单增速高，业绩逐步兑现等。主题方面，关注国企改革和军工。

#### 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

无。

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由安信基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：安信动态策略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	附注号	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	6.4.7.1	67,991,972.85	19,083,391.35
结算备付金		390,939.45	2,603,506.86
存出保证金		132,530.39	39,219.29
交易性金融资产	6.4.7.2	223,731,936.17	400,484,888.27
其中：股票投资		124,946,232.67	102,674,888.27
基金投资		-	-
债券投资		98,785,703.50	297,810,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	126,250,589.38	90,000,255.00
应收证券清算款		38,644.93	-
应收利息	6.4.7.5	1,897,067.43	3,908,330.87
应收股利		-	-
应收申购款		30,169.83	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		420,463,850.43	516,119,591.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,257.49	3,494,017.81
应付赎回款		2,823.47	10,686.32
应付管理人报酬		339,231.74	434,683.19
应付托管费		67,846.36	86,936.64
应付销售服务费		1,856.55	12,072.48
应付交易费用	6.4.7.7	230,117.23	116,458.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	288,437.29	380,008.02
负债合计		931,570.13	4,534,863.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	356,952,829.05	474,016,159.74
未分配利润	6.4.7.10	62,579,451.25	37,568,568.59
所有者权益合计		419,532,280.30	511,584,728.33
负债和所有者权益总计		420,463,850.43	516,119,591.64

注：报告截止日为 2017 年 6 月 30 日，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.1754 元，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.1718 元；基金份额总额 356,952,829.05 份，其中安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 347,128,538.12 份，安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 9,824,290.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信动态策略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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		40,016,182.32	4,468,721.05
1.利息收入		6,022,535.95	5,677,194.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	394,567.13	2,318,862.09
债券利息收入		4,716,535.48	1,789,041.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		911,433.34	1,569,290.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,317,171.41	4,911,093.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,880,252.24	3,031,131.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-238,770.00	1,770,973.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	675,689.17	108,988.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,659,387.92	-6,159,606.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	17,087.04	40,039.68
<b>减：二、费用</b>		3,583,614.88	3,629,451.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,161,566.46	2,413,204.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	432,313.22	482,640.91

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,104.34	241,610.94
4. 交易费用	6.4.7.20	747,169.03	161,629.08
5. 利息支出		-	94,532.34
其中：卖出回购金融资产支出		-	94,532.34
6. 其他费用	6.4.7.21	212,461.83	235,833.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		36,432,567.44	839,269.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		36,432,567.44	839,269.74

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信动态策略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）	474,016,159.74	37,568,568.59	511,584,728.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,432,567.44	36,432,567.44
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	-117,063,330.69	-11,421,684.78	-128,485,015.47

填列)			
其中：1.基金申购款	1,455,329.54	181,365.77	1,636,695.31
2.基金赎回款	-118,518,660.23	-11,603,050.55	-130,121,710.78
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）	356,952,829.05	62,579,451.25	419,532,280.30
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016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）	1,598,716,618.70	66,490,564.29	1,665,207,182.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	839,269.74	839,269.74
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）	-1,340,315,693.49	-51,929,803.38	-1,392,245,496.87
其中：1.基金申购款	48,052,245.94	2,691,225.76	50,743,471.70
2.基金赎回款	-1,388,367,939.43	-54,621,029.14	-1,442,988,968.57
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)	258,400,925.21	15,400,030.65	273,800,955.86
---------------------	----------------	---------------	----------------

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

安信动态策略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”)2015年3月25日下发的证监许可[2015]442号文“关于核准安信动态策略灵活配置混合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《安信动态策略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,首次募集期间为2015年4月8日至2015年4月10日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集613,229,558.27元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(201)验字第60962175\_H24号验资报告。经向中国证监会备案,《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为613,282,800.57份基金份额,其中认购资金利息折合53,242.30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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金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：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、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 3 号《半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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
活期存款	17,991,972.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	50,000,000.00
合计：	67,991,972.85

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

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,967,165.93	124,946,232.67	11,979,066.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	254,983.23	294,703.50
	银行间市场	98,384,090.00	98,491,000.00
	合计	98,639,073.23	98,785,703.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	211,606,239.16	223,731,936.17	12,125,697.01

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	126,250,589.38	-
合计	126,250,589.38	-

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	13,164.15
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	201,495.85
应收结算备付金利息	176.00
应收债券利息	1,194,971.45
应收买入返售证券利息	487,200.28
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	59.70
合计	1,897,067.43

### 6.4.7.6 其他资产

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	229,002.51
银行间市场应付交易费用	1,114.72
合计	230,117.23

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	288,437.29
合计	288,437.29

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信动态策略混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	407,852,052.47	407,852,052.47
本期申购	1,446,661.03	1,446,661.03
本期赎回(以“-”号填列)	-62,170,175.38	-62,170,175.38
本期末	347,128,538.12	347,128,538.12

金额单位：人民币元

安信动态策略混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,164,107.27	66,164,107.27
本期申购	8,668.51	8,668.51
本期赎回(以“-”号填列)	-56,348,484.85	-56,348,484.85
本期末	9,824,290.93	9,824,290.93

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信动态策略混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,987,955.40	1,458,584.85	32,446,540.25
本期利润	22,440,600.45	11,902,527.18	34,343,127.63
本期基金份额交易产生的变动数	-5,233,039.69	-664,541.73	-5,897,581.42
其中：基金申购款	151,512.57	28,521.71	180,034.28
基金赎回款	-5,384,552.26	-693,063.44	-6,077,615.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,195,516.16	12,696,570.30	60,892,086.46

单位：人民币元

安信动态策略混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,110,068.72	11,959.62	5,122,028.34
本期利润	1,332,579.07	756,860.74	2,089,439.81
本期基金份额交易产生的变动数	-5,080,372.92	-443,730.44	-5,524,103.36

其中：基金申购款	1,092.74	238.75	1,331.49
基金赎回款	-5,081,465.66	-443,969.19	-5,525,434.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,362,274.87	325,089.92	1,687,364.79

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	183,205.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	201,495.85
结算备付金利息收入	9,058.54
其他	807.41
合计	394,567.13

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

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	291,013,211.60
减：卖出股票成本总额	270,132,959.36
买卖股票差价收入	20,880,252.24

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-238,770.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-238,770.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	422,937,506.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	416,732,279.21
减：应收利息总额	6,443,997.59
买卖债券差价收入	-238,770.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	675,689.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	675,689.17

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,659,387.92
——股票投资	12,619,675.88
——债券投资	39,712.04
——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	12,659,387.92

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	17,087.04
合计	17,087.04

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	745,694.03
银行间市场交易费用	1,475.00
合计	747,169.03

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	5,424.54
银行间帐户维护费	18,600.00
合计	212,461.83

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

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

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

3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,161,566.46	2,413,204.63
其中：支付销售机构的客户维护费	182,533.33	291,617.96

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	432,313.22	482,640.91

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

#### 6.4.10.2.3 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		
安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C	合计	

安信基金	-	30,104.34	30,104.34
合计	-	30,104.34	30,104.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合C	合计
安信基金	-	241,615.63	241,615.63
合计	-	241,615.63	241,615.63

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	17,991,972.85	183,205.33	8,404,256.74	790,009.31

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末及上年度末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
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	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

300672	国科 微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流 通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
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	-
300671	富满 电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
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	-

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门

和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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同责任，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。

截至本期末，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 0.00%（上年度末为 36.84%）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	10,369,753.42	-
A-1 以下	-	-
未评级	180,007,165.01	-

合计	190,376,918.43	-
----	----------------	---

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
 2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。  
 3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	294,784.54	-
未评级	99,685,890.41	111,282,531.51
合计	99,980,674.95	111,282,531.51

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
 2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。  
 3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持证券均在证券交易所或银行间同业市

场交易。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	67,991,972.85	-	-	-	67,991,972.85
结算备付金	390,939.45	-	-	-	390,939.45
存出保证金	132,530.39	-	-	-	132,530.39
交易性金融资产	49,934,000.00	48,557,000.00	294,703.50	124,946,232.67	223,731,936.17
买入返售金融资产	126,250,589.38	-	-	-	126,250,589.38
应收证券清算款	-	-	-	38,644.93	38,644.93
应收利息	-	-	-	1,897,067.43	1,897,067.43
应收申购款	-	-	-	30,169.83	30,169.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	244,700,032.07	48,557,000.00	294,703.50	126,912,114.86	420,463,850.43
负债					
应付利息	-	-	-	1,257.49	1,257.49
应付赎回款	-	-	-	2,823.47	2,823.47

应付管理人报酬	-	-	-	339,231.74	339,231.74
应付托管费	-	-	-	67,846.36	67,846.36
应付销售服务费	-	-	-	1,856.55	1,856.55
应付交易费用	-	-	-	230,117.23	230,117.23
其他负债	-	-	-	288,437.29	288,437.29
负债总计	-	-	-	931,570.13	931,570.13
利率敏感度缺口	244,700,032.07	48,557,000.00	294,703.50	125,980,544.73	419,532,280.30
上年度末 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	19,083,391.35	-	-	-	19,083,391.35
结算备付金	2,603,506.86	-	-	-	2,603,506.86
存出保证金	39,219.29	-	-	-	39,219.29
交易性金融资产	268,302,000.00	29,508,000.00	-	102,674,888.27	400,484,888.27
买入返售金融资产	90,000,000.00	90,000,000.00	-	-	180,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,908,330.87	3,908,330.87
其他资产	-	-	-	-89,999,745.00	-89,999,745.00
资产总计	380,028,117.50	119,508,000.00	-	16,583,474.14	516,119,591.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,494,017.81	3,494,017.81
应付赎回款	-	-	-	10,686.32	10,686.32
应付管理人报酬	-	-	-	434,683.19	434,683.19
应付托管费	-	-	-	86,936.64	86,936.64
应付销售服务费	-	-	-	12,072.48	12,072.48
应付交易费用	-	-	-	116,458.85	116,458.85
其他负债	-	-	-	380,008.02	380,008.02
负债总计	-	-	-	4,534,863.31	4,534,863.31
利率敏感度缺口	380,028,117.50	119,508,000.00	-	12,048,610.83	511,584,728.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、市场利率下降 25 个基点	333,261.10	286,216.44
	2、市场利率上升 25 个基点	-330,446.98	-284,676.42

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2017 年 6 月 30 日		2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	124,946,232.67	29.78	102,674,888.27	20.07
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	124,946,232.67	29.78	102,674,888.27	20.07

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除沪深 300 指数以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（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	1、沪深 300 指数上升 5%	6,047,466.49	25,279,959.35
	2、沪深 300 指数下降 5%	-6,047,466.49	-25,279,959.35

## § 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	124,946,232.67	29.72
	其中：股票	124,946,232.67	29.72
2	固定收益投资	98,785,703.50	23.49
	其中：债券	98,785,703.50	23.49
	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	126,250,589.38	30.03
	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	68,382,912.30	16.26
7	其他各项资产	2,098,412.58	0.50
8	合计	420,463,850.43	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	4,665,640.00	1.11
C	制造业	51,190,771.06	12.20

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,733,261.90	2.80
E	建筑业	6,537,732.00	1.56
F	批发和零售业	8,691,673.66	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	7,939,941.54	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,145,749.62	1.70
J	金融业	20,179,850.49	4.81
K	房地产业	4,742,111.24	1.13
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	2,119,501.16	0.51
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	124,946,232.67	29.78

### 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	601398	工商银行	1,567,368	8,228,682.00	1.96

2	000063	中兴通讯	308,702	7,328,585.48	1.75
3	601288	农业银行	2,049,900	7,215,648.00	1.72
4	002230	科大讯飞	178,900	7,138,110.00	1.70
5	000423	东阿阿胶	85,245	6,128,263.05	1.46
6	600019	宝钢股份	849,700	5,701,487.00	1.36
7	601607	上海医药	196,232	5,667,180.16	1.35
8	002450	康得新	236,600	5,328,232.00	1.27
9	601006	大秦铁路	598,811	5,024,024.29	1.20
10	000402	金融街	404,617	4,742,111.24	1.13
11	002475	立讯精密	161,500	4,722,260.00	1.13
12	000983	西山煤电	532,000	4,665,640.00	1.11
13	600900	长江电力	297,255	4,571,781.90	1.09
14	000001	平安银行	484,300	4,547,577.00	1.08
15	601668	中国建筑	463,300	4,484,744.00	1.07
16	600581	八一钢铁	419,000	4,219,330.00	1.01
17	600681	百川能源	255,400	3,603,694.00	0.86
18	002570	贝因美	263,639	3,585,490.40	0.85
19	600674	川投能源	362,300	3,557,786.00	0.85
20	000963	华东医药	60,855	3,024,493.50	0.72
21	600584	长电科技	163,615	2,626,020.75	0.63
22	600079	人福医药	129,905	2,548,736.10	0.61
23	002643	万润股份	170,400	2,515,104.00	0.60
24	000066	中国长城	273,300	2,462,433.00	0.59
25	600585	海螺水泥	94,440	2,146,621.20	0.51
26	000069	华侨城 A	210,686	2,119,501.16	0.51
27	601800	中国交建	129,200	2,052,988.00	0.49
28	000488	晨鸣纸业	117,700	1,518,330.00	0.36
29	000828	东莞控股	125,000	1,500,000.00	0.36

30	000089	深圳机场	151,435	1,415,917.25	0.34
31	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.04
32	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
33	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
34	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
35	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
36	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
37	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
38	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
39	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
40	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
41	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
42	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
43	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
44	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
45	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
46	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
47	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
48	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 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	000963	华东医药	10,177,951.68	1.99
2	000423	东阿阿胶	9,574,169.78	1.87
3	000001	平安银行	9,497,979.00	1.86

4	001979	招商蛇口	9,494,456.00	1.86
5	600048	保利地产	8,596,762.00	1.68
6	601318	中国平安	8,492,403.00	1.66
7	600584	长电科技	7,995,889.00	1.56
8	002230	科大讯飞	7,782,553.64	1.52
9	002236	大华股份	7,490,159.16	1.46
10	000402	金融街	7,398,404.90	1.45
11	600900	长江电力	7,295,971.50	1.43
12	002142	宁波银行	6,996,076.00	1.37
13	002736	国信证券	6,497,182.00	1.27
14	000089	深圳机场	6,073,529.35	1.19
15	600029	南方航空	5,995,110.39	1.17
16	002450	康得新	5,994,318.00	1.17
17	002475	立讯精密	5,987,085.08	1.17
18	000069	华侨城A	5,830,242.86	1.14
19	600019	宝钢股份	5,497,559.00	1.07
20	000063	中兴通讯	5,494,443.80	1.07

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	000001	平安银行	22,846,948.60	4.47
2	000963	华东医药	10,744,865.68	2.10
3	601318	中国平安	10,363,026.21	2.03
4	001979	招商蛇口	10,226,783.01	2.00

5	002236	大华股份	9,132,671.78	1.79
6	600048	保利地产	8,616,231.22	1.68
7	600104	上汽集团	8,201,539.54	1.60
8	600340	华夏幸福	7,991,574.87	1.56
9	600271	航天信息	7,830,705.03	1.53
10	002465	海格通信	7,797,850.22	1.52
11	002142	宁波银行	7,309,156.22	1.43
12	002230	科大讯飞	6,779,245.06	1.33
13	600029	南方航空	6,735,808.71	1.32
14	002736	国信证券	6,361,419.34	1.24
15	002146	荣盛发展	6,341,718.65	1.24
16	601988	中国银行	6,197,136.00	1.21
17	600196	复星医药	5,859,853.00	1.15
18	000333	美的集团	5,821,839.07	1.14
19	600584	长电科技	5,594,726.77	1.09
20	002078	太阳纸业	5,464,444.88	1.07

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	279,784,627.88
卖出股票收入（成交）总额	291,013,211.60

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,491,000.00	23.48
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	98,785,703.50	23.55

### 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	160212	16 国开 12	300,000	29,994,000.00	7.15
2	160208	16 国开 08	300,000	29,349,000.00	7.00
3	150212	15 国开 12	200,000	19,940,000.00	4.75
4	160206	16 国开 06	200,000	19,208,000.00	4.58
5	127004	模塑转债	2,550	294,703.50	0.07

### 7.7 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。

## 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

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

## 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

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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 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	132,530.39
2	应收证券清算款	38,644.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,897,067.43
5	应收申购款	30,169.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,098,412.58

### 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的情况。

### 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
安信动态策略混合 A	955	363,485.38	274,519,937.81	79.08%	72,608,600.31	20.92%
安信动态策略混合 C	4	2,456,072.73	9,814,675.45	99.90%	9,615.48	0.10%
合计	959	372,213.59	284,334,613.26	79.66%	72,618,215.79	20.34%

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	安信动态策略混合 A	-	-
	安信动态	946.97	0.0096%

	策略混合 C		
	合计	946.97	0.0003%

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	安信动态策略混合 A	0
	安信动态策略混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	安信动态策略混合 A	0
	安信动态策略混合 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信动态策略混 合 A	安信动态策略混 合 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份 额总额	613,282,800.57	-
本报告期期初基金份额总额	407,852,052.47	66,164,107.27
本报告期基金总申购份额	1,446,661.03	8,668.51
减：本报告期基金总赎回份额	62,170,175.38	56,348,484.85
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	347,128,538.12	9,824,290.93

## § 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

本报告期内本基金的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		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
华创证券	2	337,959,470.09	59.46%	240,390.75	59.46%	-
广发证券	2	230,385,098.24	40.54%	163,872.62	40.54%	-
中信建投	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
华创证券	-	-	159,000,000.00	63.60%	-	-
广发证券	605,307.10	100.00%	91,000,000.00	36.40%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	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	2017年1月13日

2	安信基金管理有限责任公司 关于旗下鼎龙股份估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 14 日
3	安信基金管理有限责任公司 关于旗下先导智能估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 17 日
4	安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 21 日
5	关于修改安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 23 日
6	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	2017 年 1 月 25 日
7	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	2017 年 2 月 18 日
8	安信基金管理有限责任公司 关于旗下东方网力估值调整的公告	证券时报	2017 年 3 月 7 日
9	安信基金管理有限责任公司 关于电子直销交易平台易购通渠道部分银行卡暂停开户及增卡业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 8 日
10	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公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 15 日
11	关于安信基金管理有限责任	上海证券报、中国证	2017 年 3 月 24 日

	公司从业人员在子公司兼任 职务情况变更的公告	券报、证券时报	
12	安信基金管理有限责任公司 关于旗下部分公募基金参加 张家港农村商业银行股份有 限公司申购及定期定额投资 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
13	安信基金管理有限责任公司 关于临时暂停 T+0 快速赎回 业务中当天申购并当天快速 赎回业务的公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 4 月 13 日
14	安信基金管理有限责任公司 关于恢复 T+0 快速赎回业务 中当天申购并当天快速赎回 业务的公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日
15	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	2017 年 4 月 18 日
16	安信动态策略灵活配置混合 型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 4 月 22 日
17	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	2017 年 4 月 28 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 上海陆金所资产管理有限公 司基金认购、申购、定投进行	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 5 月 3 日

	费率优惠活动的公告		
19	安信基金管理有限责任公司 新增开放式基金销售代理服 务机构公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 5 月 18 日
20	安信基金管理有限公司关于 旗下部分公募基金参加武汉 市伯嘉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	2017 年 5 月 25 日
21	安信动态策略灵活配置混合 型证券投资基金更新招募说 明书摘要（2017 年第 1 号）	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 6 月 1 日
22	安信基金管理有限责任公司 关于旗下基金所持国电南瑞 （600406）估值调整的公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 6 月 2 日
23	安信基金管理有限责任公司 关于电子直销交易平台增加 中国民生银行股份有限公司 厦门分行第三方支付业务的 公告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
24	安信基金管理有限责任公司 关于增加基金直销账户的公 告	上海证券报、中国证 券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
25	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	2017 年 6 月 23 日

## § 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	140,976,503.76	-	-	140,976,503.76	39.49%
	1	20170215-20170630	93,544,434.05	-	-	93,544,434.05	26.21%
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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2017年8月24日