

安信新回报灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 31 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信新回报混合	
基金主代码	002770	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 5 月 9 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	146,533,902.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C
下属分级基金的交易代码	002770	002771
报告期末下属分级基金的份额总额	97,143,131.11 份	49,390,771.28 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	资产配置方面，本基金以定性研究为主，结合定量分析，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；固定收益类投资方面，本基金将灵活采用品种配置、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；股票投资方面，本基金秉承价值投资理念，深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司，把握市场定价偏差带来的投资机会；此外，本基金将合理利用权证等衍生工具做套保或套利投资，通过投资高质量的资产支持证券实现基金资产增值增厚。
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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	王海燕
	联系电话	0755-82509999	0574-89103171
	电子邮箱	service@essencefund.com	wanghaiyan@nbc.cn
客户服务电话		4008-088-088	95574
传真		0755-82799292	0574-89103213

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2017 年		2016 年 5 月 9 日(基金合同生效 日)-2016 年 12 月 31 日	
	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C
本期已实现 收益	28,404,827.26	2,045,238.15	20,664,944.59	605,148.30
本期利润	40,748,103.33	1,770,953.24	17,253,482.27	-420,985.39
加权平均基 金份额本期 利润	0.0772	0.0923	0.0279	-0.0293
本期基金份 额净值增长 率	9.56%	9.33%	3.70%	3.70%
3.1.2 期末 数据和指标	2017 年末		2016 年末	
期末可供分 配基金份额 利润	0.0704	0.0680	0.0325	0.0322
期末基金资 产净值	105,501,380.37	53,520,445.08	795,915,772.19	31,502,065.85
期末基金份 额净值	1.0860	1.0836	1.0370	1.0370

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

安信新回报混合 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
过去三个月	4.12%	0.40%	1.82%	0.40%	2.30%	0.00%
过去六个月	6.23%	0.28%	3.97%	0.34%	2.26%	-0.06%
过去一年	9.56%	0.21%	8.11%	0.32%	1.45%	-0.11%
自基金合同生效起至今	13.61%	0.18%	10.80%	0.37%	2.81%	-0.19%

安信新回报混合 C

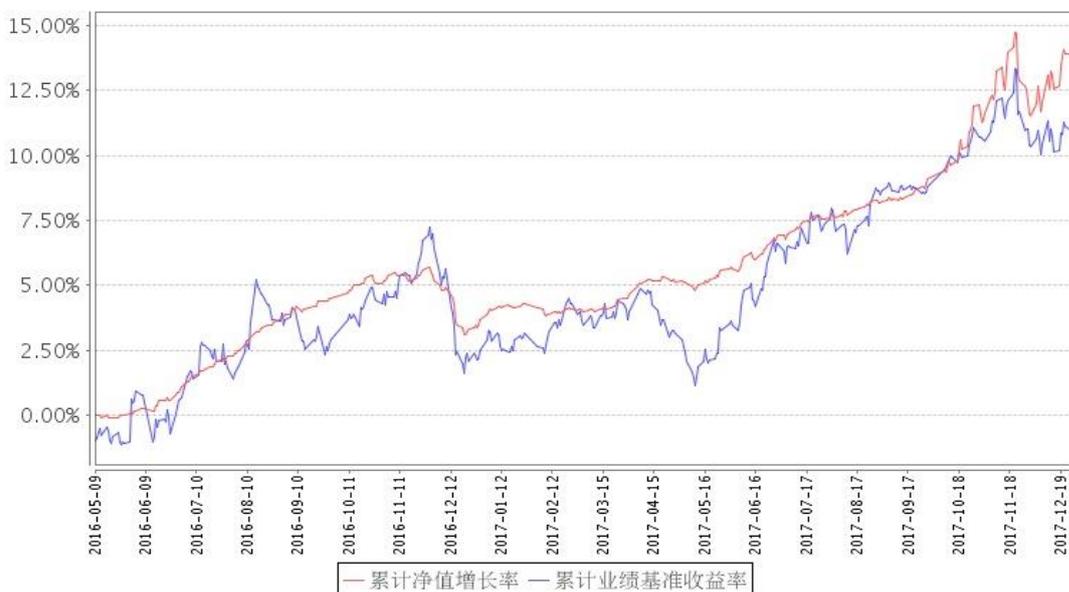
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.07%	0.40%	1.82%	0.40%	2.25%	0.00%
过去六个月	6.13%	0.28%	3.97%	0.34%	2.16%	-0.06%
过去一年	9.33%	0.21%	8.11%	0.32%	1.22%	-0.11%
自基金合同生效起至今	13.37%	0.18%	10.80%	0.37%	2.57%	-0.19%

注：根据《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%。其中沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

安信新回报混合A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



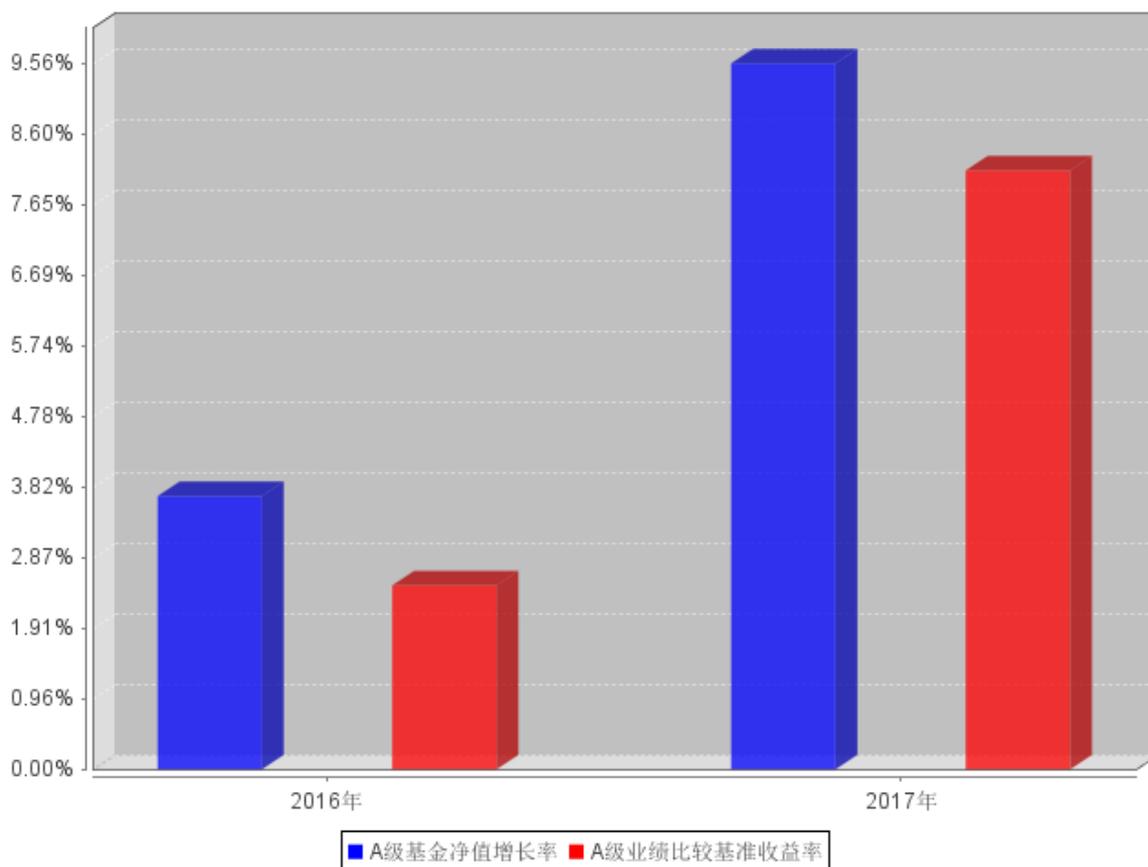
安信新回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



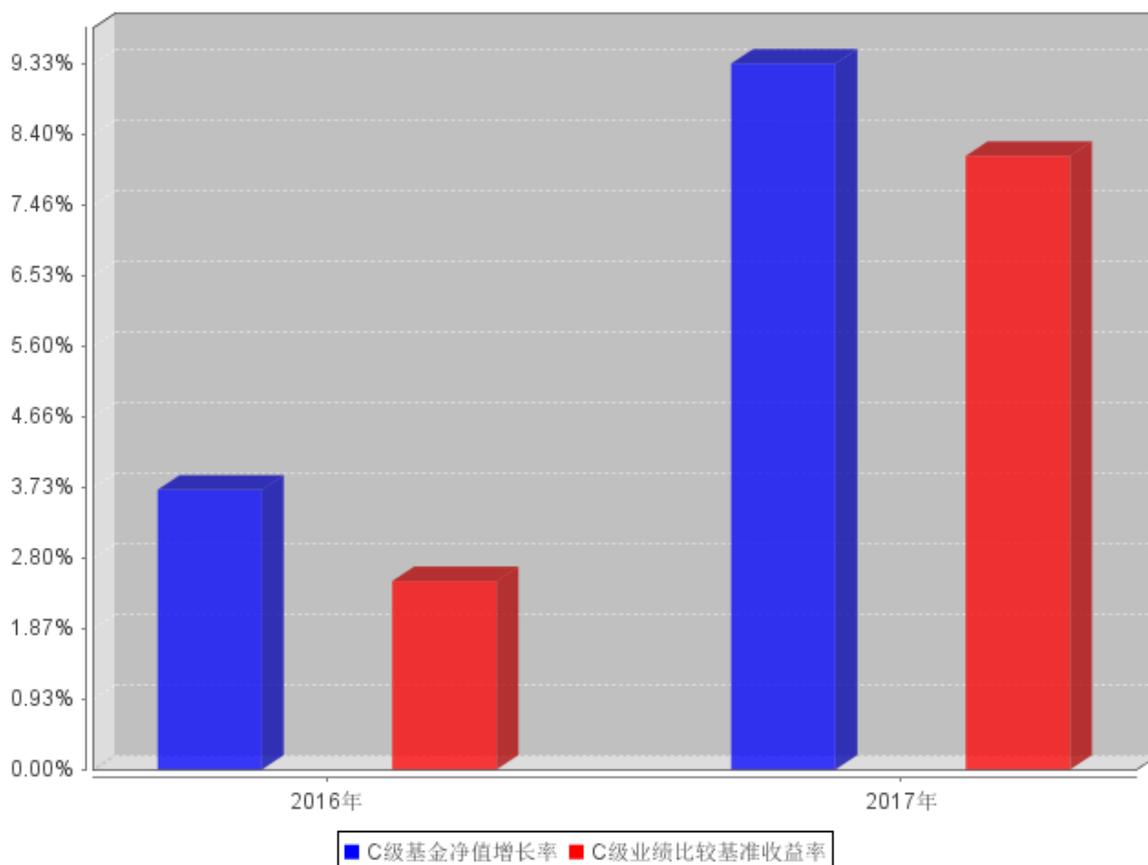
注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 5 月 9 日。
 2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

安信新回报混合 A

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	0.5000	4,852,743.91	4,215.84	4,856,959.75	-
2016 年	-	-	-	-	-
2015 年	-	-	-	-	-
合计	0.5000	4,852,743.91	4,215.84	4,856,959.75	-

安信新回报混合 C

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	0.5000	112,736.20	2,252,349.71	2,365,085.91	-
2016 年	-	-	-	-	-
2015 年	-	-	-	-	-
合计	0.5000	112,736.20	2,252,349.71	2,365,085.91	-

			71	91	
--	--	--	----	----	--

§ 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 5.0625 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 39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 38 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；从 2017 年 7 月 3 日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 20 日起管理安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 12 月 6 日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金；从 2017 年 12 月 28 日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
庄园	本基金的 基金经理	2016 年 5 月 9 日	-	13.0 年	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012 年 5 月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理；现任安

					<p>信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理,安信宝利债券型证券投资基金(LOF) (原安信宝利分级债券型证券投资基金)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
李巍	本基金的基金经理助理	2016年10月25日	-	5.0年	<p>李巍先生,理学硕士。曾任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员,富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利债券型证券投资</p>

					基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同

向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年对于债券市场是金融监管去杠杆的一年。政策方面，资管新规（征求意见稿）已下发，大资管顶层设计路径逐渐清晰，推动其回归“代客理财”本源，也意味着金融去杠杆进入第二阶段。2017 年底召开的中央经济工作会议定调高质量发展，并将防范化解重大风险为三大攻坚战之首（三大攻坚战，一是防范化解重大风险，二是精准脱贫，三是污染防治），反映出中央对金融风险的重视程度。

安信新回报 2017 年整体维持权益类基本仓位比例不变的情况下进行了多只股票的买卖操作，并且降低了信用债的久期，同时参与了利率债操作，底仓部分侧重投资于中短期品种，股票方面侧重于绩优大盘股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新回报混合 A 基金份额净值为 1.0860 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.56%；截至本报告期末安信新回报混合 C 基金份额净值为 1.0836 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.33%；同期业绩比较基准收益率为 8.11%。

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 2018 年，监管政策扰动依旧，稳健防御为主。2017 年收益率可能出现了超调，市场运行终将回归由基本面驱动。2018 年债券投资总体偏谨慎。去杠杆、强监管可能持续，银行同业业务和表外业务仍会受限，非银机构的流动性波动也会较大。

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，保证基金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，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。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。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，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 7,222,045.66 元，其中本基金 A 类份额分配 4,856,959.75 元，本基金 C 类份额分配 2,365,085.91 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

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，本托管人在安信新回报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（注：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 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信新回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7,501,801.47	13,990,715.38
结算备付金	341,420.60	13,126,090.38
存出保证金	46,579.13	68,753.52
交易性金融资产	155,433,303.31	846,159,512.60
其中：股票投资	60,549,945.31	57,980,937.60
基金投资	-	-
债券投资	94,883,358.00	788,178,575.00
资产支持证券投	-	-

资		
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	128,700,313.05
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,166,466.80	11,802,293.80
应收股利	-	-
应收申购款	8,410.23	250,000.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	164,497,981.54	1,014,097,678.73
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31日	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	5,000,000.00	185,000,000.00
应付证券清算款	-	24,857.64
应付赎回款	767.11	700,271.79
应付管理人报酬	110,486.04	569,102.98
应付托管费	13,810.75	71,137.88
应付销售服务费	9,055.91	6,742.92
应付交易费用	77,018.06	72,613.48
应交税费	-	-
应付利息	5,018.22	5,113.23
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,000.00	230,000.77
负债合计	5,476,156.09	186,679,840.69
所有者权益:		
实收基金	146,533,902.39	798,003,538.17
未分配利润	12,487,923.06	29,414,299.87
所有者权益合计	159,021,825.45	827,417,838.04
负债和所有者权益总计	164,497,981.54	1,014,097,678.73

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.0860 元，C 类基金份额净值人民币 1.0836 元，基金份额总额 146,533,902.39 份，其中 A 类基金份额 97,143,131.11 份；C 类基金份额 49,390,771.28 份。

7.2 利润表

会计主体：安信新回报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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 05 月 09 日（基金合同生 效日） 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	49,687,210.36	23,098,726.14
1. 利息收入	21,251,478.89	19,378,732.46
其中：存款利息收入	321,818.85	362,647.54
债券利息收入	19,885,324.44	18,728,945.40
资产支持证券 利息收入	124,784.22	-
买入返售金融 资产收入	919,551.38	287,139.52
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）	16,320,836.59	8,084,814.87
其中：股票投资收益	22,902,893.81	10,053,567.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,572,912.30	-2,196,843.14
资产支持证券 投资收益	95,415.78	-
贵金属投资收 益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,895,439.30	228,090.06
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	12,068,991.16	-4,437,596.01
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	45,903.72	72,774.82
减：二、费用	7,168,153.79	6,266,229.26
1. 管理人报酬	4,683,129.11	3,402,770.50
2. 托管费	585,391.04	425,346.27
3. 销售服务费	41,290.62	19,148.07
4. 交易费用	303,564.35	272,701.13
5. 利息支出	1,142,578.67	1,903,463.29
其中：卖出回购金融 资产支出	1,142,578.67	1,903,463.29
6. 其他费用	412,200.00	242,800.00
三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）	42,519,056.57	16,832,496.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损 以“-”号填列）	42,519,056.57	16,832,496.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新回报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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	798,003,538.17	29,414,299.87	827,417,838.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	42,519,056.57	42,519,056.57
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）	-651,469,635.78	-52,223,387.72	-703,693,023.50
其中：1. 基金申购款	48,830,567.41	5,247,790.69	54,078,358.10
2. 基金赎回款	-700,300,203.19	-57,471,178.41	-757,771,381.60
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）	-	-7,222,045.66	-7,222,045.66
五、期末所有者权益（基金净值）	146,533,902.39	12,487,923.06	159,021,825.45
项目	上年度可比期间 2016 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	501,083,899.28	-	501,083,899.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	16,832,496.88	16,832,496.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	296,919,638.89	12,581,802.99	309,501,441.88

号填列)			
其中：1. 基金申购款	339,148,988.41	14,489,811.16	353,638,799.57
2. 基金赎回款	-42,229,349.52	-1,908,008.17	-44,137,357.69
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)	798,003,538.17	29,414,299.87	827,417,838.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信新回报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 4 月 22 日下发的证监许可[2016]914 号文“关于准予安信新回报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《安信新回报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 5 月 4 日至 2016 年 5 月 5 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_H27 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 501,083,744.43 元。经向中国证监会备案，《安信新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 9 日正式生效。截至 2016 年 5 月 9 日止，安信新回报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 501,083,744.43 元，折合 501,083,744.43 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 154.85 元，折合 154.85 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 500,954,744.43 元，折合 500,954,744.43 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 133.60 元，

折合 133.60 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 129,000.00 元，折合 129,000.00 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 21.25 元，折合 21.25 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 501,083,899.28 元，折合 501,083,899.28 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金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、资产支持证券、银行存款、债券回购、其他货币市场工具等固定收益类品种，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）、权证等权益类品种，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）。本基金各类资产投资比例为：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：沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 税项

7.4.5.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

7.4.5.2 企业所得税

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。

7.4.5.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

7.4.5.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）	基金托管人、基金代销机构
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) 根据本基金管理人子公司安信乾盛股东会的有关决议,安信乾盛将其持有 100%股权子公司安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司进行解散并清算注销,上述注销登记手续已于 2017 年 11 月 30 日在深圳市场监督管理局办理完毕。

3) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.5 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年05月09日(基金合 同生效日)至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,683,129.11	3,402,770.50
其中：支付销售机构的客户维护费	28,364.38	23,997.44

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年05月09日(基金合 同生效日)至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	585,391.04	425,346.27

注：基金托管费每日计提，按月支付。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

7.4.7.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C	合计
宁波银行	-	156.64	156.64
安信基金	-	18,142.93	18,142.93
安信证券	-	21,736.95	21,736.95
合计	-	40,036.52	40,036.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C	合计
宁波银行	-	585.62	585.62
安信基金	-	683.39	683.39
安信证券	-	14,896.68	14,896.68
合计	-	16,165.69	16,165.69

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，安信新回报混合 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

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

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。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期内及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.7.4.2 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

本基金于本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.7.5 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12月31日		上年度可比期间 2016年05月09日（基金合同生效日）至 2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	7,501,801.47	263,373.28	13,990,715.38	225,448.10

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按约定利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 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，无抵押债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 5,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 4 日到期，该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	60,549,945.31	36.81
	其中：股票	60,549,945.31	36.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,883,358.00	57.68
	其中：债券	94,883,358.00	57.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,843,222.07	4.77
8	其他各项资产	1,221,456.16	0.74
9	合计	164,497,981.54	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,452,000.00	1.54
C	制造业	30,170,790.11	18.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	902,925.29	0.57
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	924,942.76	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	26,080,645.10	16.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,498.85	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,549,945.31	38.08

8.2.2 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。

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	2,400,000	9,192,000.00	5.78
2	601318	中国平安	110,000	7,697,800.00	4.84
3	600703	三安光电	230,000	5,839,700.00	3.67
4	600519	贵州茅台	7,014	4,892,194.86	3.08
5	600887	伊利股份	150,000	4,828,500.00	3.04
6	603589	口子窖	100,000	4,605,000.00	2.90

7	600036	招商银行	150,000	4,353,000.00	2.74
8	601601	中国太保	80,000	3,313,600.00	2.08
9	600741	华域汽车	100,000	2,969,000.00	1.87
10	601012	隆基股份	80,000	2,915,200.00	1.83

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	8,900,000.00	1.08
2	600028	中国石化	8,304,000.00	1.00
3	601318	中国平安	7,478,700.00	0.90
4	600068	葛洲坝	6,218,000.00	0.75
5	600887	伊利股份	5,730,961.00	0.69
6	600703	三安光电	5,726,439.00	0.69
7	601601	中国太保	4,775,493.00	0.58
8	603589	口子窖	4,638,992.00	0.56
9	600036	招商银行	4,105,483.62	0.50
10	600048	保利地产	3,208,000.00	0.39
11	600066	宇通客车	3,002,100.00	0.36
12	601668	中国建筑	2,851,000.00	0.34
13	601939	建设银行	2,825,000.00	0.34
14	601012	隆基股份	2,757,870.00	0.33
15	601009	南京银行	2,312,000.00	0.28
16	600276	恒瑞医药	2,171,691.40	0.26
17	600104	上汽集团	1,923,600.00	0.23
18	601398	工商银行	1,842,000.00	0.22
19	600872	中炬高新	1,683,309.11	0.20
20	300203	聚光科技	1,502,500.00	0.18

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	13,724,747.00	1.66
2	600887	伊利股份	12,151,133.01	1.47
3	601398	工商银行	12,078,000.00	1.46
4	600068	葛洲坝	7,764,197.00	0.94
5	600104	上汽集团	6,717,635.00	0.81
6	601006	大秦铁路	6,294,000.00	0.76
7	600028	中国石化	5,860,000.00	0.71
8	600519	贵州茅台	5,227,756.44	0.63
9	002202	金风科技	5,044,169.00	0.61
10	601009	南京银行	3,937,728.00	0.48
11	601668	中国建筑	3,750,827.00	0.45
12	601258	庞大集团	3,740,590.00	0.45
13	600066	宇通客车	3,452,186.00	0.42
14	600048	保利地产	3,069,000.00	0.37
15	601939	建设银行	2,915,000.00	0.35
16	600276	恒瑞医药	2,794,560.00	0.34
17	601288	农业银行	2,294,500.00	0.28
18	601601	中国太保	1,718,000.00	0.21
19	300203	聚光科技	1,517,500.00	0.18
20	002508	老板电器	1,368,254.20	0.17

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	92,969,502.68
卖出股票收入（成交）总额	121,087,368.36

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	305,541.00	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

-	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	24,452,017.00	15.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,610,000.00	12.33
7	可转债（可交换债）	8,754,300.00	5.51
8	同业存单	41,761,500.00	26.26
9	其他	-	-
10	合计	94,883,358.00	59.67

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111710367	17 兴业银行 CD367	200,000	19,308,000.00	12.14
2	111709317	17 浦发银行 CD317	130,000	12,707,500.00	7.99
3	101569028	15 泛海 MTN001	100,000	9,821,000.00	6.18
4	101551080	15 瓮福 MTN001	100,000	9,789,000.00	6.16
5	111789428	17 广州银行 CD093	100,000	9,746,000.00	6.13

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,579.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,166,466.80
5	应收申购款	8,410.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,221,456.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
A	140	693,879.51	96,106,858.37	98.93	1,036,272.74	1.07
C	84	587,985.37	47,302,748.60	95.77	2,088,022.68	4.23
合计	224	654169.21	143,409,606.97	97.87	3,124,295.42	2.13

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末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	安信新回报混合 A	54,260.70	0.0559
	安信新回报混合 C	1,000.17	0.0020
	合计	55,260.87	0.0377

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	安信新回报混合 A	0
	安信新回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信新回报混合 A	0
	安信新回报混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信新回报混合 A	安信新回报混合 C
基金合同生效日 (2016 年 5 月 9 日) 基金份额总额	500,954,878.03	129,021.25
本报告期期初基金份额总额	767,613,352.40	30,390,185.77
本报告期基金总申购份额	369,732.02	48,460,835.39
减：本报告期基金总赎回份额	670,839,953.31	29,460,249.88
本报告期期末基金份额总额	97,143,131.11	49,390,771.28

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 60,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源		2210,652,140.49	100.00%	149,836.07	100.00%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
申万宏源	479,133,553.19	100.00%	6,613,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170101-20171231;	624,877,001.92	-	528,816,483.19	96,060,518.73	65.56%
	2	20171027-20171231;	0	47,122,748.60	0	47,122,748.60	32.16%
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。

12.2 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

2018 年 03 月 31 日

