

安信消费医药主题股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 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。

基金托管人中国农业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	安信消费医药股票
基金主代码	000974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,681,014,607.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	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。本基金的股票资产主要投资于价值型股票，坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上，分析基础利率的走势，研究利率期限结构和中长期收益率走势，在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金，属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	贺倩
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4008-088-088	95599
传真	0755-82799292	010-68121816

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	基金管理人及基金托管人住所

§ 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	2015 年 3 月 19 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	93,808,425.60	-21,725,105.19	180,588,762.81
本期利润	328,485,191.87	13,638,736.84	164,107,887.19
加权平均基金份额本期利润	0.3917	0.0485	0.2954
本期基金份额净值增长率	39.29%	7.18%	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2881	0.1196	0.0451
期末基金资产净值	2,622,781,688.13	344,242,588.91	323,492,681.64
期末基金份额净值	1.560	1.120	1.045

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	7.36%	0.97%	1.93%	0.69%	5.43%	0.28%
过去六个月	12.31%	0.83%	6.95%	0.62%	5.36%	0.21%
过去一年	39.29%	0.80%	13.68%	0.58%	25.61%	0.22%
自基金合同生效起至今	56.00%	1.65%	3.09%	1.55%	52.91%	0.10%

注：根据《安信消费医药主题股票型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：90%×中证 800 指数收益率+10%×上证国债指数收益率。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 90%、10%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

安信消费医药股票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

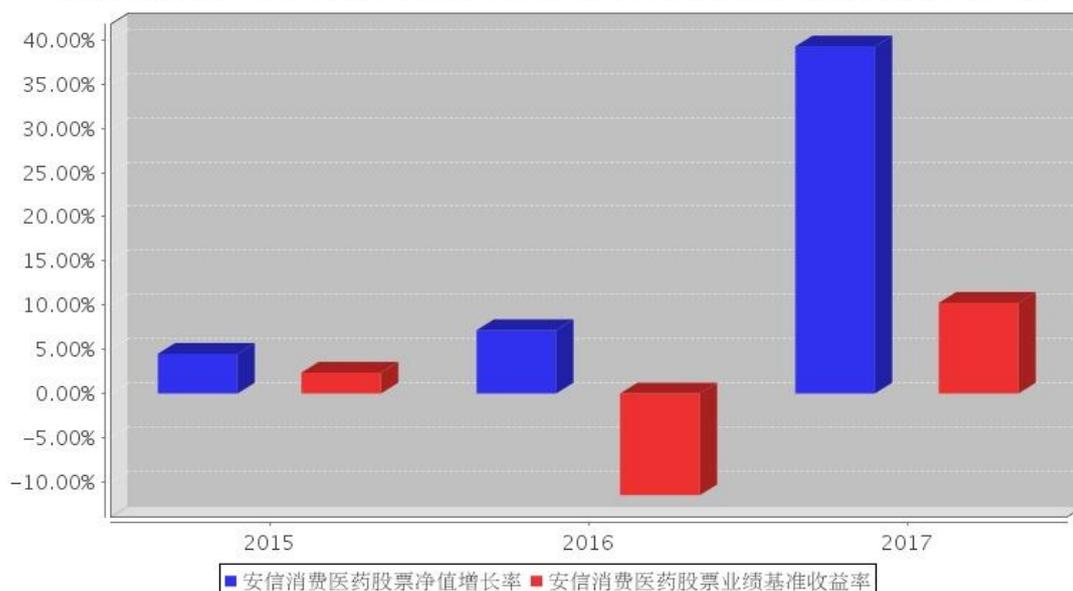


注：1、本基金合同生效日为 2015 年 3 月 19 日；

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

安信消费医药股票基金每年净值增长率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

本基金于 2015 年 3 月 19 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 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		
陈一峰	本基金的基金经理，总经理助理兼研究总监	2016 年 3 月 14 日	-	9.0 年	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。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；现任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、安信新成长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。
庄园	本基金的基金经理助理	2015 年 3 月 24 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。
李巍	本基金的基金经理助理	2016 年 11 月 21 日	-	5.0 年	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。
张明	本基金的基金经理助理	2017 年 4 月 12 日	-	6.0 年	张明先生，管理学硕士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组任研究部研究员，2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、特定资产管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任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、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信中国制造 2025 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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
许杰	本基金的基金经理	2016 年 8 月 15 日	2017 年 12 月 25 日	7.0 年	许杰先生，理学博士。历任深圳市裕晋投资有限公司投资研究部研究员、投资经理，安

	经理助理	日	日		信基金管理有限责任公司研究部研究员、权益投资部基金经理助理、研究部研究员兼基金经理。现任安信基金有限责任公司特定资产管理部投资经理。曾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遵规守信情况的说明

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

我们一直坚持自下而上的投资选股思路，在充分研究公司商业模式，竞争优势，公司成长空间，行业竞争格局的背景下，结合估值水平，注重安全边际，选择低估值的价值股和合理估值的成长股，总结成一句话就是：“好公司，好价格，买入并持有，赚钱是大概率事件”。要做到前述几点，我们认为还要认清以下几点：

首先，好公司是稀缺的，虽然上市满 5 年的公司有 2000 多只，但过去 5 年每年 ROE 超过 20% 的公司仅有 19 只，占比不到 1%，即使放宽到 ROE>10%，也仅有 257 只，占比约 10%，我们选择买入的公司大多出自其中。

其次，我们选择做时间的朋友，一个月或者一个季度的涨跌，我们其实并不十分关注，学术上已经有过很多研究，短期的市场涨跌其实更多的是一个随机游走事件，长期的股价增长一定是优秀公司业绩持续增长带来的，不断找寻优秀的公司，并与他一起成长是我们的持续盈利之道。

再次，具体到消费医药这只产品，我们认为长期来说，大消费领域都是持续出现大牛股的地方，例如医药，食品饮料，家电等板块，过去十年或者二十年，都有像恒瑞医药，贵州茅台，格力电器等大牛股，我们觉得展望未来，随着人口老龄化，居民人均收入提升，消费升级的背景下，在符合消费医药主题范围的投资标的中，还会不断涌现出具有竞争优势的好公司，我们也会继续相对重仓消费医药类公司以期待长期能够为投资者获取不错的收益。

从市场角度来看，2017 年市场分化明显，上证指数震荡上涨约 5%，沪深 300 指数涨幅超过 20%，创业板指下跌超过 10%，个股分化明显，大盘股涨幅明显好于中小创等个股，具有持续内生增长能力的优质公司收益率持续跑赢市场，分行业来看，2017 年全年食品饮料，家电，银行，钢铁涨幅靠前，跌幅较大的则是纺织服装，传媒，计算机等。截止 2017 年底，产品单位净值 1.56，2017 年全年上涨 39.3%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.560 元；本报告期基金份额净值增长率为 39.29%，业绩比较基准收益率为 13.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年四季度整个宏观经济继续保持较好的态势，财新 PMI 指数四季度均在 50 以上，我们觉得 2018 年宏观经济仍将保持平稳增长态势，GDP 增速预计在 6.5% 左右，在整体金融市场去杠杆背景下，预计资金面仍将保持紧平衡的态势，从当前的证券市场估值环境来看，大盘股估值还

处于历史平均位置，市盈率在 14 倍左右，市净率大约 1.6 倍，整体上看，优秀公司的估值合理，创业板指估值已经跌到历史后 1/4 的水平，但绝对估值水平仍然偏高，达到 40 倍市盈率，4 倍多市净率，我们认为创业板整体性的机会还未出现。展望未来 1 年，市场或将维持一个震荡格局，个股间的差异依然会持续分化，精选个股依然是获取超额收益的关键。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—安信基金管理有限责任公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：安信消费医药主题股票型证券投资基金

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	262,339,708.01	17,611,459.19
结算备付金	3,997,808.91	182,261.04
存出保证金	627,700.18	56,369.56
交易性金融资产	2,390,223,732.57	328,105,301.04
其中：股票投资	2,389,064,140.19	312,649,419.84
基金投资	-	-
债券投资	1,159,592.38	15,455,881.20
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	100,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	57,062.45	239,124.20
应收股利	-	-
应收申购款	11,671,434.42	30,455.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,768,917,446.54	346,224,970.71
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
应付证券清算款	100,000,000.00	-
应付赎回款	41,103,068.93	1,013,759.37
应付管理人报酬	3,058,537.40	422,102.45
应付托管费	509,756.24	70,350.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,091,914.36	114,311.88
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	372,481.48	361,857.68
负债合计	146,135,758.41	1,982,381.80
所有者权益：		
实收基金	1,681,014,607.13	307,473,825.12
未分配利润	941,767,081.00	36,768,763.79
所有者权益合计	2,622,781,688.13	344,242,588.91
负债和所有者权益总计	2,768,917,446.54	346,224,970.71

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.560 元，基金份额总额 1,681,014,607.13 份。

7.2 利润表

会计主体：安信消费医药主题股票型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	353,287,122.15	20,005,197.71
1. 利息收入	890,195.48	263,305.44
其中：存款利息收入	759,747.18	150,439.77
债券利息收入	121,585.28	104,165.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,863.02	8,699.99
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	111,310,978.02	-16,014,605.66
其中：股票投资收益	95,601,270.27	-21,324,149.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	665,613.03	-1,400.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	15,044,094.72	5,310,943.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	234,676,766.27	35,363,842.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,409,182.38	392,655.90
减：二、费用	24,801,930.28	6,366,460.87
1. 管理人报酬	17,470,495.99	4,274,519.75
2. 托管费	2,911,749.35	712,420.04
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	4,001,586.37	991,158.51
5. 利息支出	-	3,213.01
其中：卖出回购金融资产支出	-	3,213.01
6. 其他费用	418,098.57	385,149.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	328,485,191.87	13,638,736.84
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	328,485,191.87	13,638,736.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信消费医药主题股票型证券投资基金

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）	307,473,825.12	36,768,763.79	344,242,588.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	328,485,191.87	328,485,191.87
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）	1,373,540,782.01	576,513,125.34	1,950,053,907.35
其中：1. 基金申购款	2,490,137,120.45	1,091,399,636.84	3,581,536,757.29
2. 基金赎回款	-1,116,596,338.44	-514,886,511.50	-1,631,482,849.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,681,014,607.13	941,767,081.00	2,622,781,688.13
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	309,526,828.14	13,965,853.50	323,492,681.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,638,736.84	13,638,736.84
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）	-2,053,003.02	9,164,173.45	7,111,170.43
其中：1. 基金申购款	165,879,877.30	16,778,075.14	182,657,952.44
2. 基金赎回款	-167,932,880.32	-7,613,901.69	-175,546,782.01
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）	307,473,825.12	36,768,763.79	344,242,588.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
刘入领	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信消费医药主题股票型证券投资基金（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”）2014 年 12 月 11 日下发的证监许可[2014]1345 号文“关于核准安信消费医药主题股票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《安信消费医药主题股票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 2015 年 2 月 11 日至 2015 年 3 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(2015)验字 60962175_H16 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,492,697,930.84 元。经向中国证监会备案，《安信消费医药主题股票型证券投资基金合同》于 2015 年 3 月 19 日正式生效。截至 2015 年 3 月 19 日止，安信消费医药主题股票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 1,492,697,930.84 元，折合 1,492,697,930.84 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 728,936.98 元，折合 728,936.98 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 1,493,426,867.82 元，折合 1,493,426,867.82 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基

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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信消费医药主题股票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（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。本基金各类资产投资比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%—95%，本基金以消费、医药行业股票为主要投资对象，投资于消费、医药行业股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当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：中证 800 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间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（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
中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
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) 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

金额单位：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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
安信证券	1,470,531,509.19	39.25%	-	-

7.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的比 例
安信证券	141,899.17	2.18%	-	-

7.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
安信证券	20,000,000.00	16.67%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	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	1,045,987.60	39.25%	421,632.13	38.61%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
安信证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.7.2 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1月1日至2016年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	17,470,495.99
其中：支付销售机构的客户维护费	3,553,434.90	1,898,160.72

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.7.2.2 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 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,911,749.35	712,420.04

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费均按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.7.4 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固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固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度均未持有本基金。

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 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
中国农业银行	262,339,708.01	722,860.18	17,611,459.19	142,916.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 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无需说明的其他关联交易事项。

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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	20180105	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	20180105	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	20180105	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	20180103	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
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
128029	太阳转债	2017/12/25	2018/1/16	新债未上市	100	100	11,596	1,159,52.38	1,159,592.38	

7.4.8.2 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
600332	白云山	2017年10月31日	重大事项	32.14	2018年1月8日	30.15	84,300	2,597,609.00	2,709,402.00
002507	涪陵榨菜	2017年12月4日	重大事项	16.77	2018年3月29日	16.97	1,652,828	21,098,744.61	27,717,925.56
002919	名臣健康	2017年12月28日	价格异常波动	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46
300730	科创信息	2017年12月25日	价格异常波动	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55

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，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，本基金无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，无抵押债券。

§ 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	2,389,064,140.19	86.28
	其中：股票	2,389,064,140.19	86.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,159,592.38	0.04
	其中：债券	1,159,592.38	0.04

	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	100,000,000.00	3.61
	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	266,337,516.92	9.62
8	其他各项资产	12,356,197.05	0.45
9	合计	2,768,917,446.54	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,063,415.94	0.23
C	制造业	1,620,091,086.01	61.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,181,176.00	2.14
E	建筑业	154,771,154.45	5.90
F	批发和零售业	182,687,839.90	6.97
G	交通运输、仓储和邮政业	61,033,390.19	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	190,833,230.17	7.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	68,768,381.44	2.62
M	科学研究和技术服务业	2,642,076.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
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	45,925,954.34	1.75
S	综合	-	-
	合计	2,389,064,140.19	91.09

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	占基金资产净值比例（%）
1	600566	济川药业	3,947,708	150,605,060.20	5.74
2	600201	生物股份	4,244,703	134,726,873.22	5.14
3	600612	老凤祥	3,075,409	126,583,834.44	4.83
4	002202	金风科技	5,456,772	102,860,152.20	3.92
5	600887	伊利股份	3,128,916	100,719,806.04	3.84
6	000963	华东医药	1,746,084	94,079,005.92	3.59
7	603589	口子窖	1,917,221	88,288,027.05	3.37
8	600068	葛洲坝	10,222,214	83,822,154.80	3.20
9	601328	交通银行	13,290,217	82,532,247.57	3.15
10	002027	分众传媒	4,884,118	68,768,381.44	2.62

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	600612	老凤祥	129,740,442.85	37.69
2	600566	济川药业	128,729,096.99	37.39
3	600201	生物股份	109,207,865.80	31.72
4	600068	葛洲坝	98,513,661.82	28.62
5	603589	口子窖	91,317,382.00	26.53
6	600887	伊利股份	89,346,652.78	25.95
7	601328	交通银行	88,191,283.30	25.62
8	000963	华东医药	74,339,505.71	21.60
9	002202	金风科技	66,329,051.06	19.27
10	600104	上汽集团	61,971,165.78	18.00
11	002468	申通快递	59,186,331.68	17.19

12	600056	中国医药	52,892,647.67	15.36
13	002027	分众传媒	47,818,644.14	13.89
14	300258	精锻科技	46,618,714.54	13.54
15	601988	中国银行	46,395,979.00	13.48
16	600036	招商银行	45,399,837.37	13.19
17	002304	洋河股份	45,131,734.43	13.11
18	000501	鄂武商A	43,409,451.11	12.61
19	600297	广汇汽车	41,382,611.93	12.02
20	600373	中文传媒	40,739,829.37	11.83
21	002083	孚日股份	40,554,877.93	11.78
22	000498	山东路桥	38,481,920.69	11.18
23	600323	瀚蓝环境	37,025,136.45	10.76
24	603808	歌力思	35,767,478.70	10.39
25	300296	利亚德	35,725,415.07	10.38
26	000858	五粮液	33,480,313.84	9.73
27	600757	长江传媒	29,020,674.00	8.43
28	600298	安琪酵母	27,387,407.08	7.96
29	000581	威孚高科	26,900,125.06	7.81
30	000513	丽珠集团	25,249,261.80	7.33
31	002589	瑞康医药	24,836,028.70	7.21
32	600703	三安光电	24,203,350.09	7.03
33	000910	大亚圣象	23,971,395.00	6.96
34	002507	涪陵榨菜	23,499,712.17	6.83
35	300145	中金环境	21,962,962.17	6.38
36	002003	伟星股份	21,691,641.80	6.30
37	600183	生益科技	21,311,316.20	6.19
38	000661	长春高新	20,913,733.60	6.08
39	600487	亨通光电	20,580,002.26	5.98
40	002597	金禾实业	20,566,096.00	5.97
41	000786	北新建材	20,476,368.00	5.95
42	600741	华域汽车	19,647,788.40	5.71
43	601398	工商银行	19,489,896.00	5.66
44	002241	歌尔股份	18,849,970.38	5.48
45	601939	建设银行	18,491,797.00	5.37
46	000895	双汇发展	18,239,913.01	5.30
47	002343	慈文传媒	17,971,353.00	5.22

48	002120	韵达股份	16,675,321.43	4.84
49	603599	广信股份	16,387,022.67	4.76
50	002078	太阳纸业	16,350,968.69	4.75
51	600674	川投能源	16,181,075.20	4.70
52	601012	隆基股份	14,712,979.00	4.27
53	002705	新宝股份	14,711,992.22	4.27
54	600285	羚锐制药	14,488,200.52	4.21
55	601318	中国平安	14,049,402.00	4.08
56	002433	太安堂	14,035,363.57	4.08
57	000065	北方国际	13,682,581.50	3.97
58	600867	通化东宝	13,486,148.88	3.92
59	300415	伊之密	12,779,803.28	3.71
60	600028	中国石化	12,444,113.00	3.61
61	000651	格力电器	12,421,715.00	3.61
62	002624	完美世界	11,707,793.78	3.40
63	002008	大族激光	11,674,869.00	3.39
64	601225	陕西煤业	11,618,304.00	3.38
65	600176	中国巨石	10,361,464.36	3.01
66	600872	中炬高新	10,082,834.36	2.93
67	002573	清新环境	10,062,906.50	2.92
68	000726	鲁泰A	9,998,566.42	2.90
69	002680	长生生物	9,986,520.50	2.90
70	002223	鱼跃医疗	9,893,710.16	2.87
71	002479	富春环保	9,823,330.31	2.85
72	002867	周大生	9,759,235.50	2.83
73	002563	森马服饰	9,698,445.80	2.82
74	002706	良信电器	9,692,863.39	2.82
75	603868	飞科电器	8,424,591.80	2.45
76	002435	长江润发	7,992,177.64	2.32
77	002536	西泵股份	7,893,824.08	2.29
78	002310	东方园林	7,823,845.00	2.27
79	002051	中工国际	7,693,106.00	2.23
80	002354	天神娱乐	7,452,623.87	2.16
81	000338	潍柴动力	7,431,596.47	2.16
82	002450	康得新	7,319,164.00	2.13
83	300158	振东制药	7,139,545.06	2.07

84	300267	尔康制药	6,989,522.05	2.03
----	--------	------	--------------	------

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	600887	伊利股份	55,396,864.13	16.09
2	002083	孚日股份	39,652,430.86	11.52
3	600373	中文传媒	38,065,878.26	11.06
4	600196	复星医药	27,344,583.66	7.94
5	002597	金禾实业	23,859,186.58	6.93
6	002589	瑞康医药	23,120,690.09	6.72
7	300296	利亚德	23,005,811.44	6.68
8	002468	申通快递	20,186,234.49	5.86
9	600487	亨通光电	19,502,597.61	5.67
10	600276	恒瑞医药	19,074,360.16	5.54
11	002705	新宝股份	18,621,614.73	5.41
12	600036	招商银行	17,814,928.26	5.18
13	601318	中国平安	17,738,482.56	5.15
14	000895	双汇发展	16,486,394.42	4.79
15	600183	生益科技	15,101,372.44	4.39
16	000488	晨鸣纸业	14,670,157.74	4.26
17	002008	大族激光	14,619,623.61	4.25
18	601988	中国银行	14,444,484.00	4.20
19	002563	森马服饰	13,870,258.32	4.03
20	600703	三安光电	13,800,815.14	4.01
21	002573	清新环境	13,727,503.14	3.99
22	002433	太安堂	12,991,260.00	3.77
23	600585	海螺水泥	12,938,704.72	3.76
24	002624	完美世界	12,649,194.68	3.67
25	601225	陕西煤业	12,089,262.17	3.51
26	002466	天齐锂业	9,834,701.92	2.86
27	002680	长生生物	9,819,214.62	2.85
28	000726	鲁泰A	9,745,279.00	2.83
29	000858	五粮液	9,396,023.00	2.73
30	002479	富春环保	9,305,315.84	2.70

31	600660	福耀玻璃	9,273,358.43	2.69
32	600104	上汽集团	9,247,410.22	2.69
33	300070	碧水源	8,982,652.40	2.61
34	002241	歌尔股份	8,890,170.18	2.58
35	300072	三聚环保	8,742,806.92	2.54
36	000429	粤高速 A	8,703,607.29	2.53
37	002450	康得新	8,461,858.70	2.46
38	002508	老板电器	8,185,545.35	2.38
39	000625	长安汽车	7,830,737.83	2.27
40	002435	长江润发	7,820,662.29	2.27
41	600816	安信信托	7,788,546.80	2.26
42	002142	宁波银行	7,140,125.71	2.07
43	000338	潍柴动力	6,933,359.59	2.01
44	300158	振东制药	6,932,427.17	2.01
45	002372	伟星新材	6,905,097.36	2.01

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	2,750,277,089.22
卖出股票收入（成交）总额	1,004,098,516.31

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

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	-	-
	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）	1,159,592.38	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,159,592.38	0.04

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（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128029	太阳转债	11,596	1,159,592.38	0.04

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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合相关法律法规和监管要求的变化。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除分众传媒（002027），本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

分众传媒信息技术股份有限公司（下称分众传媒，股票代码：002027）于 2017 年 6 月 8 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局下发的《关于对分众传媒信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2017】14 号），分众传媒存在以下违法违规事项：

- 1) 部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整，2015 年年报信息披露存在遗漏；
- 2) 未在股东大会授权范围内购买银行理财产品。

根据《证券法》第一百七十九条、《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，证监会广东监管局对分众传媒予以警示：请分众传媒认真吸取教训，切实加强对证券法律法规的学习，不断完善内部控制，依法履行信息披露义务，杜绝此类问题再次发生。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	627,700.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,062.45
5	应收申购款	11,671,434.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,356,197.05

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

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 (%)
40839	41,161.99	877,129,155.16	52.18	803,885,451.97	47.82

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,411,809.90	0.2030

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月19日）基金份额总额	1,493,426,867.82
本报告期期初基金份额总额	307,473,825.12
本报告期基金总申购份额	2,490,137,120.45
减:本报告期基金总赎回份额	1,116,596,338.44
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	1,681,014,607.13

§ 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

1、本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。
2、本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

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 80,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的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。

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	

海通证券	2	1,682,523,507.47	44.91%	1,196,779.61	44.91%	-
安信证券	2	1,470,531,509.19	39.25%	1,045,987.60	39.25%	-
招商证券	2	478,940,255.30	12.78%	340,669.03	12.78%	-
东吴证券	2	73,346,750.44	1.96%	52,171.49	1.96%	新租
兴业证券	2	41,431,695.27	1.11%	29,470.27	1.11%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	6,364,876.01	97.82%	-	-	-	-
安信证券	141,899.17	2.18%	20,000,000.00	16.67%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	100,000,000.00	83.33%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§ 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	20170101-20170406; 20170518-20170705	78,969,155.27	82,823,876.65	-	161,793,031.92	9.62
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 3 月 31 日