

安信安盈保本混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2018 年第 1 号)

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2018 年 3 月 9 日

重要提示

安信安盈保本混合型证券投资基金的募集申请于 2015 年 12 月 21 日经中国证监会证监许可[2015]3001 号文注册。本基金基金合同于 2016 年 3 月 9 日正式生效。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2018 年 3 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日（财务数据已经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：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

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

法定代表人：刘入领

成立时间：2011 年 12 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可〔2011〕1895 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：50,625 万元人民币

存续期间：永续经营

联系人：陈静满

联系电话：0755-82509999

公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
五矿资本控股有限公司	39.84%
安信证券股份有限公司	33.95%
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	20.28%
中广核财务有限责任公司	5.93%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

王连志先生，董事长，经济学硕士。历任长城证券有限公司投行部经理、中信证券股份有限公司投行部经理、第一证券有限责任公司副总经理、安信证券股份有限公司副总经理、安信基金管理有限责任公司总经理。现任安信证券股份有限公司总经理、党委副书记。

刘入领先生，董事，经济学博士。历任国通证券股份有限公司（现招商证券股份有限公司）研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理；招商证券股份有限公司战略部副总经理（主持工作）、总裁办公室主任、理财客户部总经理；安信证券股份有限公司人力资源

部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事长。

任珠峰先生，董事，经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理，英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理，五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理、总经理等职务。现任中国五矿集团有限公司总经理助理兼五矿资本股份有限公司董事长、总经理、党委书记，五矿资本控股有限公司董事长、总经理，五矿经易期货有限公司董事长，五矿证券有限公司董事长，五矿国际信托有限公司董事长，工银安盛人寿保险有限公司副董事长，中国外贸金融租赁有限公司副董事长，绵阳市商业银行股份有限公司董事、党委书记。

王晓东先生，董事，经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员，日本五金矿产株式会社财务部科员，中国外贸金融租赁有限公司副总经理，中国五矿集团公司财务总部副总经理，五矿投资发展有限责任公司副总经理等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员兼资本运营部总经理，五矿资本控股有限公司副总经理兼资本运营部总经理，五矿经易期货有限公司董事，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，五矿鑫扬（浙江）投资管理有限公司董事长，绵阳市商业银行股份有限公司董事。

代永波先生，董事，管理学硕士。历任深圳市深国投房地产开发有限公司财务部会计、第一创业证券有限责任公司投资银行部业务经理、中信建投证券股份有限公司投资银行部副总裁、申银万国证券股份有限公司投资银行部执行总经理、深圳市帕拉丁资本管理有限公司资本市场部董事总经理、深圳市帕拉丁股权投资有限公司总经理。 现任广州市顺路工程顾问股份有限公司总经理。

郭伟喜先生，董事，经济学学士。历任福云会计师事务所项目经理，上海中科合臣股份有限公司财务主管，厦门天地安保险代理有限公司财务总监，高能资本有限公司投资银行业务董事等职。现任中广核财务有限公司投资银行部副总经理（主持工作）。

庞继英先生，独立董事，金融学博士，高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部，国家外汇管理局副处长、处长、副司长，中国外汇交易中心副总裁、总裁，中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员，中国再保险（集团）股份有限公司党委副书记、副董事长、国家开发银行股份有限公司董事。

魏华林先生，独立董事，1977年毕业于武汉大学政治经济学专业、1979年毕业于厦门大学政治经济学研究班。历任武汉大学经济系讲师，保险系副教授、副系主任、主任，保险

经济研究所所长，兼任中国保监会咨询委员会委员、中国金融学会常务理事暨学术委员会委员、中国保险学会副会长、湖北省政府文史研究馆馆员等职。现任武汉大学风险研究中心主任、教授、博士生导师。

尹公辉先生，独立董事，法学硕士。历任四川建材工业学院辅导员、学办主任，中农信（香港）集团有限公司法务主管，广东信达律师事务所专职律师，广东华商律师事务所专职律师，广东百利孚律师事务所合伙人。现任广东信达律师事务所合伙人。

2、基金管理人监事会成员

刘国威先生，监事会主席，工商管理硕士。历任五矿集团财务公司资金部科长、香港企荣财务有限公司资金部高级经理、五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、五矿投资发展有限责任公司规划发展部总经理、五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员、纪委委员，五矿资本控股有限公司副总经理，工银安盛人寿保险有限公司监事，中国外贸金融租赁有限公司董事，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，五矿经易期货有限公司董事。

余斌先生，监事，经济学学士。历任深圳鸿华实业股份有限公司财务审计经理、南方证券股份有限公司稽核部副总经理、中科证券托管组副组长。现任安信证券股份有限公司计划财务部总经理。

蒋牧人先生，监事，法律硕士。历任北京金杜律师事务所实习律师、中信建投证券有限公司投资银行部高级经理、华林证券投资银行部高级业务总监。现任深圳市帕拉丁股权投资有限公司投资总监。

廖维坤先生，职工监事，理学学士。历任轻工业部南宁设计院电算站软件工程师，申银万国证券股份有限公司深圳营业部电脑主管，南方证券股份有限公司深圳管理总部电脑工程师、布吉营业部营业部副总经理、稽核总部高级经理、经纪业务总部高级经理，安信证券股份有限公司信息技术部总经理。现任安信基金管理有限责任公司首席信息官，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司监事。

王卫峰先生，职工监事，工商管理硕士，注册会计师。历任吉林省国际信托公司财务人员，汉唐证券有限责任公司营业部财务经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管，浦银安盛基金管理有限公司监察部负责人。现任安信基金管理有限责任公司监察稽核部总经理。

张再新先生，职工监事，管理学学士。历任安信证券股份有限公司计划财务部会计，安

信基金管理有限责任公司财务部会计、工会财务委员。现任安信基金管理有限责任公司运营部总经理助理、交易主管。

3、基金管理人高级管理人员

王连志先生，董事长，经济学硕士。简历同上。

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理、证券投资部副总经理，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理、东方基金管理有限责任公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

孙晓奇先生，副总经理，经济学硕士。历任上海石化股份有限公司董事会秘书室高级经理，上海证券交易所交易运行部襄理、市场发展部高级经理、债券基金部执行经理，南方证券行政接管组成员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司督察长。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

李学明先生，副总经理，哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理，理财发展部高级经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理，安信基金筹备组成员；安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。

乔江晖女士，督察长，文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、副处长，安信证券股份有限公司安信基金筹备组成员，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

4、本基金基金经理

杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。2016年3月8日至今，任安信现金增利货币市场基金的基金经理；2016年3月10日至

今，任安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理；2016年3月14日至今，任安信现金管理货币市场基金的基金经理；2016年8月9日至今，任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016年9月9日至今，任安信保证金交易型货币市场基金的基金经理；2016年10月10日至2017年11月22日，任安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2016年10月17日至今，任安信活期宝货币市场基金的基金经理；2016年12月19日至今，任安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

本基金历任基金经理情况：

历任基金经理姓名	管理本基金时间
庄园	2016年3月9日至2017年7月4日

5、基金投资决策委员会成员

主任委员：

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

委员：

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。

陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员，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。

占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。简历同上。

张竞先生，南开大学金融学硕士。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理、安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金

管理有限责任公司权益投资部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至2017年12月31日，中国银行已托管650只证券投资基金，其中境内基金613只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）直销中心

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：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

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

法定代表人：刘入领

电话：0755—82509820

传真：0755—82509920

联系人：陈思伶

客户服务电话：4008-088-088

公司网站：www.essencefund.com

2、其他销售机构

（1）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

网站：www.boc.cn

（2）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网站：www.ccb.com

（3）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网站：www.abchina.com

（4）广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨民生

客户服务电话：400-830-8003

网站：www.gdb.com.cn

(5) 张家港农村商业银行股份有限公司

住所：张家港市人民中路 66 号

法定代表人：王自忠

客户服务电话：0512-96065

网站：www.zrcbank.com

(6) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

(7) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

(8) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553

网站：www.htsec.com

(9) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

客户服务电话：95558

网站：www.citics.com

(10) 中信证券(山东)有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

客户服务电话：96577

网站：www.zxwt.com.cn

（11）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523 或 4008895523

网站：www.swhysc.com

（12）东海证券股份有限公司

住所：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 5 楼

法定代表人：朱科敏

客户服务电话：4008-888-588

网站：www.longone.com.cn

（13）中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7、8 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：4001-022-011

网站：www.zszq.com.cn

（14）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587/4008-888-108

网站：www.csc108.com

（15）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-9908-826

网站：www.citicsf.com

（16）中国国际金融股份有限公司

住所：中国北京建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com

（17）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务电话：400-8888-666 / 95521

网站：www.gtja.com

（18）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

客户服务电话：95532/4006-008-008

网站：www.china-invs.cn

（19）东海期货有限责任公司

住所：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

客户服务电话：95531/400-8888588

网站：www.qh168.com.cn

（20）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584/4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

（21）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

客户服务电话：4008888993

网站：www.dxzq.net

（22）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

网站：www.firstcapital.com.cn

（23）东北证券股份有限公司

住所：长春市净月开发区生态大街 6666 号东北证券 503 室

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

网站：www.nesc.cn

（24）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网站：www.gjzq.com.cn

（25）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-8888

网站：www.chinastock.com.cn

（26）上海华信证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：郭林

客户服务电话：400-820-5999

网站：www.shhxzq.com

（27）五矿证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层

法定代表人：赵立功

客户服务电话：40018-40028

网站：www.wkzq.com.cn

（28）中大期货有限公司

住所：浙江省杭州市中山北路 310 号 3 层、11 层西、12 层东，18 层

法定代表人：陈忠宝

客户服务电话：400-8810-999 或者 0571-85801071

网站：www.zdqh.com

（29）宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：杨磊

客户服务电话：4008-366-366

网站：www.hx818.com

（30）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

客户服务电话：95511-8

网站：stock.pingan.com

（31）、申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：400-800-0562

网站：www.hysec.com

（32）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

客户服务电话：4008323000

网站：http://www.csc.com.cn

（33）天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客户服务电话：95391/4008005000

网站：http://www.tfzq.com

（34）广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

网站：www.gzs.com.cn

（35）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-181-8188

网站：www.1234567.com.cn

（36）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网站：www.erichfund.com

（37）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：400-076-6123

网站：www.fund123.cn

（38）和讯信息科技有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 E 座 18 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网站：licaike.hexun.com

（39）北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

网站：www.zcvc.com.cn

（40）中经北证（北京）资产管理有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

客户服务电话：400-600-0030

网站： www.bzfunds.com

（41）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网站： www.ehowbuy.com

（42）泰信财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区西四环北路 69 号一层

法定代表人：穆宏轩

客户服务电话：400-168-7575

网站： www.taixincaifu.com

（43）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：4008-773-772

网站： www.5ifund.com

（44）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008 室

法定代表人：赵荣春

客户服务电话：400-893-6885

网站： www.qianjing.com

（45）深圳前海微众银行股份有限公司

住所：深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼，37 楼

法定代表人：顾敏

客户服务电话：400-999-8800

网站： www.webank.com

（46）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：郭坚

客户服务电话：4008219031

网站：www.lufunds.com

（47）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

法定代表人：陈姚坚

客户服务电话：400-9500-888

网站：www.jfzinv.com

（48）珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市珠海市琶洲大道东 1 号宝利国际广场南塔 12 楼 b1201-1203

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

（49）北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：400-818-8866

网站：www.shengshiview.com

（50）北京中天嘉华基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区京顺路 5 号曙光大厦 C 座一层

法定代表人：洪少猛

客户服务电话：4006509972

网站：www.5ilicai.cn

（51）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

客户服务电话：400-068-0058

网站：www.jincheng-fund.com

（52）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

网站：www.fundzone.cn

（53）大泰金石基金销售有限公司

住所：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：400-928-2266

网站：www.dtfunds.com

（54）乾道金融信息服务（北京）有限公司

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

客户服务电话：400-088-8080

网站：www.qiandaojr.com

（55）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：陈超

客户服务电话：400 098 8511

网站：fund.jd.com

（56）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块 新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客户服务电话：010-62675369

网站：www.xincai.com

（57）上海万得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网站：www.520fund.com.cn

（58）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网站：www.noah-fund.com

（59）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

客户服务电话：400-027-9899

网站：www.buyfunds.cn

（60）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

客户服务电话：400-116-1188

网站：8.jrj.com.cn

（61）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客户服务电话：95177

网站：www.snjjjin.com

（62）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区梨园路 6 号物资控股大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：400-678-8887

网站：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

（63）北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客户服务电话：400-066-8586

网站：www.igesafe.com

(64) 一路财富(北京)信息科技股份有限公司

住所: 北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人: 吴雪秀

客户服务电话: 400-001-1566

网站: <http://www.yilucaifu.com>

(65) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区望京阜通东大街望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人: 钟斐斐

客户服务电话: 400-061-8518

网站: <https://danjuanapp.com/>

(66) 中民财富基金销售(上海)有限公司

住所: 上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人: 弭洪军

客户服务电话: 400-876-5716

网站: <https://www.cmiwm.com/>

(67) 天津万家财富资产管理有限公司

住所: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人: 李修辞

客户服务电话: 010-59013895

网站: www.wanjiawealth.com

(68) 上海通华财富资产管理有限公司

住所: 上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼

法定代表人: 马刚

客户服务电话: 95156

网站: <https://www.tonghuafund.com>

(69) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人: 程刚

客户服务电话: 400-810-5919

网站: www.fengfd.com

(70) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

网站：www.amcfortune.com

(71) 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

住所：深圳市福田区福强路 4001 号深圳市世纪工艺品文化市场 313 栋 E-403

法定代表人：李春瑜

客户服务电话：400-680-3928

网站：www.simuwang.com

(72) 嘉实财富管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4400-021-8850

网站：www.harvestwm.cn

(73) 北京创金启富投资管理有限公司

住所：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-1818 /010-66154828

网站：www.5irich.com

(74) 上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客户服务电话：021-50810673

网站：www.wacaijijin.com

(二) 登记机构

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：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

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

法定代表人：刘入领

电话：0755－82509865

传真：0755－82560289

联系人：宋发根

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

法定代表人：葛明

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：李妍明

四、基金名称

安信安盈保本混合型证券投资基金

五、基金类型

混合型。

六、基金的运作方式

契约型、开放式。

七、投资目标

在保证投资者本金的基础上，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

九、投资范围

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、资产支持证券、股指期货、银行存款及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的相关规定。

本基金将投资对象主要分为固定收益类资产和权益类资产，其中固定收益类资产为国内依法公开发行的各类债券（包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等）、银行存款等；权益类资产为股票、权证、股指期货等。

本基金按照 CPPI 和 TIPP 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

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。

十、投资策略

本基金运用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整固定收益类资产与权益类资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。

具体而言，本基金的投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略和权益类资产投资策略。

1、资产配置策略

本基金基于恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理对固定收益类资产和权益类资产进行配置，动态调整固定收益类资产与权益类资产投资的比例，通过对固定收益类资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对权益类资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。本基金对固定收益类资产和权益类资产的资产配置具体

可分为以下四步：

第一步，确定本基金的价值底线（Floor）。根据本基金保本周期到期时投资组合的最低目标价值（本基金的最低保本值为投资本金的 100%）和合理的贴现率，确定本基金当前应持有的固定收益类资产数额，亦即本基金的价值底线（Floor）。

第二步，计算本基金的安全垫（Cushion）。通过计算基金投资组合现时净值超越价值底线的数额，得到本基金的安全垫（Cushion）。

第三步，确定风险乘数（Multiplier）。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断，并结合基金的风险收益情况，确定安全垫的放大倍数——风险乘数，并在安全垫和风险乘数确定的基础上，得到当期权益类资产的最高配置规模与比例。

第四步，动态调整固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并结合市场实际运行态势制定权益类资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的保值增值。

2、固定收益类资产投资策略

本基金通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。

（1）免疫策略

本基金采用剩余期限与保本周期到期期限匹配的积极投资策略，根据保本周期的剩余期限动态调整固定收益类资产债券组合久期，有效控制债券利率、收益率曲线等各种风险，保证债券组合收益的稳定性。

（2）收益率曲线策略

本基金将结合对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。

（3）相对价值策略

本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级的债券间利差的分析判断，获取不合理的市场定价所带来的投资机会。

（4）骑乘策略

本基金通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，基金可获得较高的资本利得收入。

（5）回购策略

本基金将适时运用回购交易套利策略，在确保基金资产安全的前提下增强债券组合的收益率。

（6）信用债投资策略

本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法，通过对信用产品基本面的研究，形成对该信用产品信用级别综合评定，并通过调整组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布，获取超额收益。

（7）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

3、权益类资产投资策略

（1）股票投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。

1）行业配置

本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析 and 预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出具有良好景气和发展潜力的行业。

2）个股选择

本基金综合运用安信基金的股票研究分析方法和其它投资分析工具挑选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票构建股票投资组合。具体分以下三个层次进行：

①品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司，构建备选股票池。主要筛选指标包括：盈利能力（如 P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT 等），经营效率（如 ROE、ROA、Return on operating assets 等）和财务状况（如 D/A、流动比率等）等。

②公司质量评价

通过对上市公司直接接触和实地调研，了解并评估公司治理结构、公司战略、所处行业的竞争动力、公司的财务特点，以决定股票的合理估值中应该考虑的折价或溢价水平。在调研基础上，分析员依据公司成长性、盈利能力可预见性、盈利质量、管理层素质、流通股股东受关注程度五大质量排名标准给每个目标公司进行评分。

③多元化价值评估

在质量评估的基础上，根据上市公司所处的不同行业特点，综合运用多元化的股票估值指标，对股票进行合理估值，并评定投资级别。在明确的价值评估基础上选择价值被低估的投资标的。

（2）权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

（3）股指期货投资策略

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金以套期保值为目的，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，有效管理投资组合的系统性风险，积极改善组合的风险收益特征。

本基金通过对宏观经济和股票市场走势的分析与判断，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的股指期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用股指期货控制风险的基础上，将审慎地获取相应的超额收益，通过股指期货对股票的多头替代和固定收益类资产仓位的增加，实现可转移阿尔法，并通过股指期货与股票的多空比例调整，获取权益类资产的选股阿尔法。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

十一、业绩比较基准

两年期银行定期存款利率（税后）

本基金是保本混合型基金，保本周期是两年，以两年期银行定期存款税后收益率作为本

基金的业绩比较基准，基金管理人认为选择该业绩比较基准体现了本基金的风险收益特征，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

十二、风险收益特征

本基金是一只保本混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。

十三、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日，来源于《安信安盈保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》。本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,708,233.72	2.90
	其中：股票	44,708,233.72	2.90
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,301,469,044.96	84.55
	其中：债券	1,301,469,044.96	84.55
	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	147,000,000.00	9.55
	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	16,508,938.86	1.07

8	其他资产	29,558,575.59	1.92
9	合计	1,539,244,793.13	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	2,692,953.00	0.22
C	制造业	24,056,956.65	1.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	386,632.00	0.03
E	建筑业	2,292,674.00	0.19
F	批发和零售业	1,881,307.20	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,237,750.80	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,600,760.00	0.13
J	金融业	5,563,430.27	0.45
K	房地产业	3,350,385.00	0.27
L	租赁和商务服务业	945,612.80	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	325,167.00	0.03
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	374,605.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	44,708,233.72	3.65

(2) 报告期末按行业分类的沪港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。

3、报告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

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	600519	贵州茅台	1,800	1,255,482.00	0.10
2	000858	五粮液	12,000	958,560.00	0.08
3	601600	中国铝业	142,600	951,142.00	0.08
4	002027	分众传媒	67,160	945,612.80	0.08
5	600104	上汽集团	25,400	813,816.00	0.07
6	600276	恒瑞医药	10,900	751,882.00	0.06
7	000651	格力电器	16,100	703,570.00	0.06
8	600068	葛洲坝	80,900	663,380.00	0.05
9	600887	伊利股份	20,600	663,114.00	0.05
10	600309	万华化学	16,400	622,216.00	0.05

4、报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	128,853,000.00	10.51
	其中：政策性金融债	79,858,000.00	6.51
4	企业债券	301,729,044.96	24.60
5	企业短期融资券	10,061,000.00	0.82
6	中期票据	38,032,000.00	3.10
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	822,794,000.00	67.09
9	其他	-	-
10	合计	1,301,469,044.96	106.12

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111713061	17 浙商银行 CD061	2,000,000	192,860,000.00	15.73
2	111715316	17 民生银行 CD316	1,000,000	97,620,000.00	7.96

3	170204	17 国开 04	700,000	69,860,000.00	5.70
4	111717292	17 光大银 行 CD292	500,000	49,355,000.00	4.02
5	111789741	17 厦门国 际银行 CD235	500,000	49,345,000.00	4.02

6、报告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。

7、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、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金以套期保值为目的，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，有效管理投资组合的系统性风险，积极改善组合的风险收益特征。

本基金通过对宏观经济和股票市场走势的分析与判断，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的股指期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体除分众传媒(002027)、万华化学(600309)，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。

1、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。

2、根据2017年7月6日万华化学集团股份有限公司(下称万华化学，股票代码：600309)《万华化学集团股份有限公司关于2016年9月20日安全事故调查结果的公告》，根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查报告》的建议，因工艺管理不到位、生产异常情况处置不得当以及不了解脲类物质对MDI缩聚的催化机理等间接原因，万华化学烟台工业园在大修停车处理过程中，MDI(二苯基甲烷二异氰酸酯)装置光化工序一台12.1立方米粗MDI(以下简称粗M)缓冲罐发生爆炸，造成4人死亡、4人受伤，直接经济损失573.62万元。经烟台市人民政府建议，万华化学对9名相关责任人给予相应责任追究，包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分；烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入40%的罚款，对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款。

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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
----	----	----------

1	存出保证金	122,135.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,434,953.38
5	应收申购款	1,486.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,558,575.59

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况 说明
1	601600	中国铝业	951,142.00	0.08	重大事项
2	600309	万华化学	622,216.00	0.05	重大事项

(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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金合同生效日为 2016 年 3 月 9 日，基金合同生效以来（截至 2017 年 12 月 31 日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

安信安盈保本 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
2016.3.9-2016.12.31	3.20%	0.19%	1.71%	0.01%	1.49%	0.18%
2017.1.1-2017.12.31	3.73%	0.11%	2.06%	0.01%	1.67%	0.10%
2016.3.9-2017.12.31	7.05%	0.15%	3.81%	0.01%	3.24%	0.14%

安信安盈保本 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
2017.11.28-2017.12.31	0.11%	0.02%	0.02%	0.00%	0.09%	0.02%

注：本基金自 2017 年 11 月 28 日起增加 C 类份额，C 类份额的报告期间为 2017 年 11 月 28 日至 2017 年 12 月 31 日。

十五、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10 \% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金相关销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用”的种类中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的

损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、C类基金份额销售服务费费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率或C类基金份额销售服务费费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、对招募说明书更新部分的说明

- 1、对“重要提示”部分进行了更新。
- 2、对“第一部分 绪言”部分进行了更新。
- 3、对“第二部分 释义”部分进行了更新。
- 4、“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、高级管理人员、本基金基金经理和投资决策委员会成员的内容，本基金基金经理未发生变更。
- 5、对“第四部分 基金托管人”部分进行了更新。
- 6、“第五部分 相关服务机构”部分，更新了其他销售机构、审计基金财产的会计师事务所。
- 7、“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分，更新了申购与赎回的原则、申购与赎回的数额限制、申购费率、赎回费率、申购份额与赎回金额的计算方式、巨额赎回的情形及处理方式、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告。
- 8、对“第九部分 基金的保本”部分进行了更新，包含保本条款、基金保本周期部分内容。
- 9、对“第十部分 基金保本的保证”部分进行了更新。
- 10、“第十一部分 基金的投资”部分，更新了风险收益特征和基金投资组合报告的内容。
- 11、对“第十二部分 基金的业绩”部分进行了更新。
- 12、对“第十四部分 基金资产的估值”部分，更新了估值程序、估值错误的处理、基金净值的确认。

13、对“第十五部分 基金的收益与分配”部分，更新了基金收益分配原则、基金收益分配中发生的费用。

14、对“第十六部分 保本周期的到期”部分，更新了保本周期到期的处理规则。

15、对“第十七部分 基金费用与税收”部分进行了更新。

16、对“第十九部分 基金的信息披露”部分，更新了公开披露的基金信息、信息披露事务管理。

17、对“第二十五部分 其他应披露事项”进行了更新。

18、对“附件一：基金合同的内容摘要”进行了更新。

19、对“附件二：托管协议的内容摘要”进行了更新。

安信基金管理有限责任公司

2018年4月19日