

# 安信安盈保本混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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 2016 年 3 月 9 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.7 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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
11.1 备查文件目录 .....	50
11.2 存放地点 .....	50
11.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信安盈保本混合型证券投资基金
基金简称	安信安盈保本混合
基金主代码	002308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,788,964,151.99 份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	资产配置方面，本基金运用恒定比例组合保险（CPPI）原理，动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，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。固定收益投资方面，本基金通过对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，综合考虑各种市场因素，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。权益资产投资方面，本基金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。
业绩比较基准	两年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	王永民
	联系电话	0755-82509999	010-66594896

	电子邮箱	service@essencefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95566
传真		0755-82799292	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518026	100818
法定代表人		刘入领	田国立

## 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	安信基金管理有限责任公司 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

## 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
基金保证人	中合中小企业融资担保股份有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 12 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 3 月 9 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,922,043.23
本期利润	41,922,681.70
加权平均基金份额本期利润	0.0229
本期加权平均净值利润率	2.27%
本期基金份额净值增长率	2.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	26,154,196.65
期末可供分配基金份额利润	0.0146
期末基金资产净值	1,829,867,764.26
期末基金份额净值	1.023
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	2.30%

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

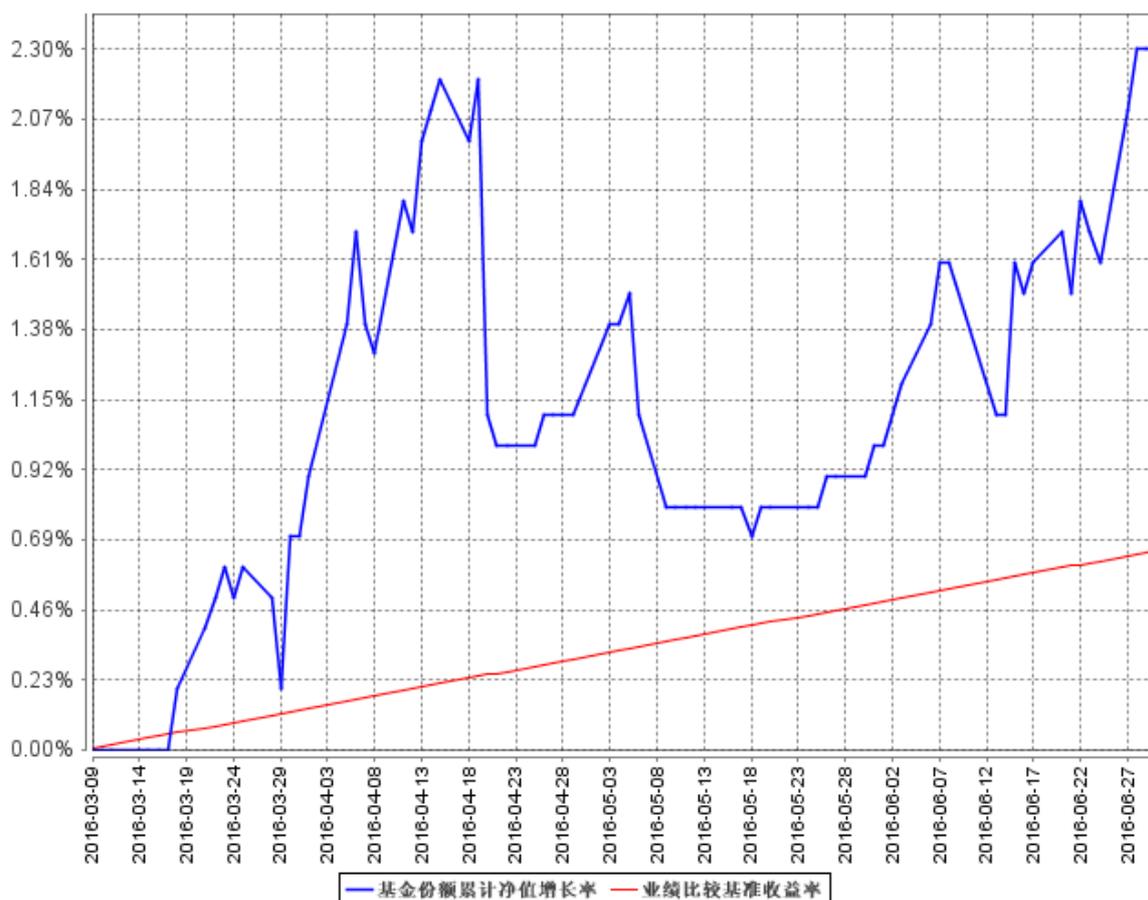
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.29%	0.22%	0.17%	0.01%	1.12%	0.21%
过去三个月	1.59%	0.24%	0.52%	0.01%	1.07%	0.23%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.23%	0.66%	0.01%	1.64%	0.22%

注：1、根据《安信安盈保本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为：两年期银行定期存款利率（税后）。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 3 月 9 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金的建仓期为 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 9 月 9 日，本基金目前仍处于建仓期中。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 19 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。

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

					理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理	2016 年 3 月 9 日	-	12	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、安信安盈保本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的基金经理。
肖芳芳	本基金的基金经理助理	2016 年 5 月 16 日	-	5	肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司研究员、财达证券责任有限公司投资助理。现任安信基金管理有限责任公

					司固定收益部基金经理助理。现任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理助理。
徐越	本基金的基金经理助理	2016 年 5 月 16 日	-	1	徐越女士，文学硕士。曾任安信基金管理有限责任公司交易员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。现任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理助理。
陈浩宇	本基金的基金经理助理	2016 年 3 月 9 日	2016 年 5 月 26 日	5	陈浩宇先生，管理学硕士。历任深圳航空有限责任公司收益管理员、鹏元资信评估有限公司证券评级部分析师、信用评估部生命保险信用分析师。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部信用研究员。

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。

### 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

本基金成立于 2016 年 3 月初，建仓期间既经历了 3 月中下旬配置压力带来的“资产荒”，也经历了 4 月信用风险和流动性风险暴露带来的收益率大幅上行。在这个市场背景下，安盈保本在建仓前期将投资集中在了期限在 1 年之内的短融和超短融，并且放慢了建仓的节奏，保持足够的现金等待市场调整，组合平均剩余期限较低。当 4 月市场大幅调整的期间，抓住机会在市场上买入了估值调整幅度较大的长久期公司债，增加了组合的平均剩余期限。股票方面，通过量化选股模型，利用行业优选、个股优选和策略转换机制来优选个股、调整行业；通过分散行业和个股的投资来控制股票部位的个股风险。在 3 月中旬开始逐步增加股票仓位并将高仓位维持了近 1 个月左右；在 4 月市场讯号转空后，逐步将股票仓位调降，低仓位维持至 5 月末；在 6 月市场转好时，逐步将股票仓位增加至中高仓位。回顾整个上半年，产品维持了稳健增长，获得了较好收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.023 元，本报告期份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准增长率为 0.66%。

## 4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责，运营部在日常估值管理中，必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定，及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施，建立并不断完善基金资产估值系统。另外，公司成立基金估值委员会，主任委员由公司总经理担任，成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成，投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

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。估值委员会采取临时会议的方式召开会议，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况时，运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过，并形成书面文件妥善保管。对于重大事项，应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上，再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下：运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

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。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

#### **4.6 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，本基金本报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照本基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### **4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信安盈保本混合证券投资基金（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

的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：安信安盈保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	8,341,163.27
结算备付金		5,683,989.48
存出保证金		308,858.87
交易性金融资产	6.4.7.2	2,216,657,631.20
其中：股票投资		231,065,758.04
基金投资		-
债券投资		1,975,609,873.16
资产支持证券投资		9,982,000.00
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	100,040,350.06
应收证券清算款		4,398,994.37
应收利息	6.4.7.5	16,275,788.06
应收股利		-
应收申购款		9,988.01
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,351,716,763.32

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
<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		512,899,380.75
应付证券清算款		2,422,082.07
应付赎回款		3,052,064.88
应付管理人报酬		1,799,077.39
应付托管费		299,846.24
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,096,733.90
应交税费		-
应付利息		124,340.74
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	155,473.09
负债合计		521,848,999.06
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,788,964,151.99
未分配利润	6.4.7.10	40,903,612.27
所有者权益合计		1,829,867,764.26
负债和所有者权益总计		2,351,716,763.32

注：报告截止日为 2016 年 6 月 30 日，安信安盈保本混合型证券投资基金份额净值 1.023 元，基金份额总额 1,788,964,151.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信安盈保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
<b>一、收入</b>		54,293,788.75
1.利息收入		17,540,806.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,714,230.42
债券利息收入		13,580,698.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,245,877.51
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,757,156.59

其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,592,913.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-318,047.96
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	482,290.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,000,638.47
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	995,186.86
<b>减：二、费用</b>		12,371,107.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,853,772.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,142,295.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,833,013.22
5. 利息支出		1,400,323.48
其中：卖出回购金融资产支出		1,400,323.48
6. 其他费用	6.4.7.21	141,701.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		41,922,681.70
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		41,922,681.70

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信安盈保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 9 日（基金合同生效日）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）	1,857,619,160.76	-	1,857,619,160.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,922,681.70	41,922,681.70
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	-68,655,008.77	-1,019,069.43	-69,674,078.20



相关规定。本基金各类资产投资比例范围为：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。

本基金的业绩比较基准为：两年期银行定期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》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。

本财务报表采用了若干修订后/新会计准则：2014 年 1 至 3 月，财政部制定或修订了《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》和《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》等 7 项会计准则；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2016 年 3 月 9 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融

负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生

了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

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

- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

#### 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，减按 25% 计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	8,341,163.27
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,341,163.27

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 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	219,180,895.42	231,065,758.04	11,884,862.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	546,507,873.16	-524,022.68
	银行间市场	1,429,102,000.00	3,647,238.53
	合计	1,975,609,873.16	3,123,215.85
资产支持证券	9,989,440.00	9,982,000.00	-7,440.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,201,656,992.73	2,216,657,631.20	15,000,638.47

### 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 2016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	100,040,350.06	-
合计	100,040,350.06	-

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	12,341.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,560.44
应收债券利息	16,171,469.67
应收买入返售证券利息	68,893.65
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20,522.56
合计	16,275,788.06

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,068,285.20

银行间市场应付交易费用	28,448.70
合计	1,096,733.90

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31,143.55
预提费用	124,329.54
合计	155,473.09

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,857,619,160.76	1,857,619,160.76
本期申购	3,919,737.41	3,919,737.41
本期赎回(以“-”号填列)	-72,574,746.18	-72,574,746.18
本期末	1,788,964,151.99	1,788,964,151.99

注：总申购份额含红利再投、转入份额；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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	26,922,043.23	15,000,638.47	41,922,681.70
本期基金份额交易产生的变动数	-767,846.58	-251,222.85	-1,019,069.43
其中：基金申购款	49,238.42	6,608.61	55,847.03
基金赎回款	-817,085.00	-257,831.46	-1,074,916.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,154,196.65	14,749,415.62	40,903,612.27

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	396,636.39
定期存款利息收入	
其他存款利息收入	2,281,944.44
结算备付金利息收入	34,564.75
其他	1,084.84
合计	2,714,230.42

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

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,023,555,630.28
减：卖出股票成本总额	1,002,962,716.36
买卖股票差价收入	20,592,913.92

#### 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 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016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	-318,047.96
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	-318,047.96

##### 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 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	391,851,004.07

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	389,412,893.13
减：应收利息总额	2,756,158.90
买卖债券差价收入	-318,047.96

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	482,290.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	482,290.63

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	15,000,638.47
——股票投资	11,884,862.62
——债券投资	3,123,215.85
——资产支持证券投资	-7,440.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	15,000,638.47

### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
基金赎回费收入	995,186.86
合计	995,186.86

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
交易所市场交易费用	2,820,838.22
银行间市场交易费用	12,175.00
合计	2,833,013.22

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	38,254.98
信息披露费	86,074.56
银行划款费用	16,972.35
其他	400.00
合计	141,701.89

## 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

截至资产负债表日，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

截至本财务报表批准日，本基金无需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
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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
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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
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

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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
	2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,853,772.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,941,209.43

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

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
	2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,142,295.50

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

### 6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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 2016年3月9日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	8,341,163.27	396,636.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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（2016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
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002291	星期	2016	重大	13.89	2016	12.50	669,851	9,209,530.16	9,304,230.39	-

	六	年 4 月	事项		年 8 月					
		5 日			2 日					
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

### 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 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 199,499,380.75 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
120227	12 国开 27	2016 年 7 月 1 日	100.23	1,000,000	100,230,000.00
011699612	16 鲁晨鸣 SCP005	2016 年 7 月 1 日	100.08	500,000	50,040,000.00
041657002	16 华邦健康 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.29	500,000	50,145,000.00
合计				2,000,000	200,415,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金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 313,400,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 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。

### 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约责任，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。

截止 2016 年 6 月 30 日，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 92.31%。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
A-1	263,120,238.95
A-1 以下	-
未评级	919,880,442.70
合计	1,183,000,681.65

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。

### 6.4.13.2.2 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 2016年6月30日
AAA	116,694,119.85
AAA 以下	692,086,541.33
未评级	-
合计	808,780,661.18

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。本基金投资于一家上市公司发行的股票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发行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，所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在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 2016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	8,341,163.27	-	-	-	8,341,163.27
结算备付金	5,683,989.48	-	-	-	5,683,989.48
存出保证金	308,858.87	-	-	-	308,858.87
交易性金融资产	1,204,213,477.15	781,378,396.01	-	231,065,758.04	2,216,657,631.20
买入返售金融资产	100,040,350.06	-	-	-	100,040,350.06
应收证券清算款	-	-	-	4,398,994.37	4,398,994.37
应收利息	-	-	-	16,275,788.06	16,275,788.06
应收申购款	-	-	-	9,988.01	9,988.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,318,587,838.83	781,378,396.01	0.00	251,750,528.48	2,351,716,763.32
负债					
卖出回购金融资产款	512,899,380.75	-	-	-	512,899,380.75
应付证券清算款	-	-	-	2,422,082.07	2,422,082.07
应付赎回款	-	-	-	3,052,064.88	3,052,064.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,799,077.39	1,799,077.39
应付托管费	-	-	-	299,846.24	299,846.24
应付交易费用	-	-	-	1,096,733.90	1,096,733.90
应付利息	-	-	-	124,340.74	124,340.74
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	155,473.09	155,473.09
负债总计	512,899,380.75	0.00	0.00	8,949,618.31	521,848,999.06
利率敏感度缺口	805,688,458.08	781,378,396.01	0.00	242,800,910.17	1,829,867,764.26

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规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	除市场利率意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（2016年6月30日）
	1、市场利率下降 25 个基点	7,813,690.14 -
	2、市场利率上升 25 个基点	-7,750,747.22

#### 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。本基金投资于股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%。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 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	231,065,758.04	12.63
交易性金融资产-基金投资	-	-

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	231,065,758.04	12.63

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 12.63%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

## § 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	231,065,758.04	9.83
	其中：股票	231,065,758.04	9.83
2	固定收益投资	1,985,591,873.16	84.43
	其中：债券	1,975,609,873.16	84.01
	资产支持证券	9,982,000.00	0.42
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,040,350.06	4.25
	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	14,025,152.75	0.60
7	其他各项资产	20,993,629.31	0.89
8	合计	2,351,716,763.32	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	6,274,765.93	0.34
C	制造业	206,645,426.33	11.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	7,483,178.28	0.41
F	批发和零售业	4,941,729.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.00
J	金融业	-	-
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	5,650,166.10	0.31
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	231,065,758.04	12.63

### 7.2.2 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。

### 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	300389	艾比森	380,406	9,346,575.42	0.51
2	002291	星期六	669,851	9,304,230.39	0.51
3	300220	金运激光	247,600	8,864,080.00	0.48
4	000921	海信科龙	1,080,129	8,565,422.97	0.47
5	002420	毅昌股份	805,958	7,011,834.60	0.38
6	603688	石英股份	335,700	6,989,274.00	0.38
7	600219	南山铝业	919,701	6,805,787.40	0.37
8	600973	宝胜股份	861,880	6,791,614.40	0.37
9	300375	鹏翎股份	249,990	6,757,229.70	0.37
10	002323	雅百特	515,200	6,707,904.00	0.37

11	300337	银邦股份	844,497	6,646,191.39	0.36
12	300301	长方集团	772,755	6,545,234.85	0.36
13	300241	瑞丰光电	393,643	6,499,045.93	0.36
14	002350	北京科锐	321,300	6,490,260.00	0.35
15	601137	博威合金	483,036	6,477,512.76	0.35
16	002528	英飞拓	728,724	6,471,069.12	0.35
17	002677	浙江美大	593,411	6,444,443.46	0.35
18	002543	万和电气	347,913	6,432,911.37	0.35
19	300393	中来股份	174,335	6,394,607.80	0.35
20	000521	美菱电器	1,051,228	6,338,904.84	0.35
21	000813	天山纺织	514,747	6,274,765.93	0.34
22	002706	良信电器	225,898	6,153,461.52	0.34
23	002705	新宝股份	386,000	6,029,320.00	0.33
24	600178	东安动力	659,800	5,753,456.00	0.31
25	002578	闽发铝业	608,227	5,735,580.61	0.31
26	002738	中矿资源	280,800	5,630,040.00	0.31
27	300304	云意电气	172,700	5,540,216.00	0.30
28	002433	太安堂	536,668	5,377,413.36	0.29
29	600267	海正药业	437,600	5,316,840.00	0.29
30	600081	东风科技	323,300	5,227,761.00	0.29
31	600841	上柴股份	373,502	5,217,822.94	0.29
32	600579	天华院	380,300	5,179,686.00	0.28
33	000597	东北制药	579,033	5,141,813.04	0.28
34	000623	吉林敖东	198,876	4,961,956.20	0.27
35	600216	浙江医药	375,250	4,949,547.50	0.27
36	601607	上海医药	273,780	4,941,729.00	0.27
37	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
38	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
39	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
40	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
41	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
42	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
43	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
44	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
45	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
46	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
47	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
48	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
49	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00

50	002805	丰元股份	971	5,631.80	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002098	浔兴股份	26,867,099.57	1.47
2	300304	云意电气	26,082,373.11	1.43
3	300375	鹏翎股份	21,658,377.81	1.18
4	600983	惠而浦	21,609,488.29	1.18
5	603518	维格娜丝	20,508,736.28	1.12
6	300374	恒通科技	19,922,047.49	1.09
7	000521	美菱电器	19,679,112.76	1.08
8	600178	东安动力	19,675,691.90	1.08
9	300337	银邦股份	19,635,562.77	1.07
10	002420	毅昌股份	19,571,010.15	1.07
11	002205	国统股份	19,132,669.51	1.05
12	300249	依米康	18,955,396.67	1.04
13	000708	大冶特钢	18,893,828.72	1.03
14	002034	美欣达	18,781,174.81	1.03
15	600126	杭钢股份	18,482,509.21	1.01
16	601003	柳钢股份	18,399,022.57	1.01
17	000761	本钢板材	18,003,516.92	0.98
18	002677	浙江美大	17,496,421.07	0.96
19	600081	东风科技	16,941,070.08	0.93
20	002088	鲁阳节能	16,531,821.86	0.90

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；  
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	002098	浔兴股份	27,713,349.11	1.51
2	603518	维格娜丝	21,638,183.15	1.18
3	600983	惠而浦	20,806,785.28	1.14
4	300304	云意电气	20,723,023.18	1.13
5	002205	国统股份	19,531,602.46	1.07
6	000761	本钢板材	19,329,641.66	1.06
7	300374	恒通科技	19,311,922.71	1.06
8	000708	大冶特钢	18,383,986.57	1.00
9	600126	杭钢股份	18,244,284.38	1.00
10	002034	美欣达	18,047,202.81	0.99
11	300249	依米康	17,846,108.86	0.98
12	601003	柳钢股份	17,381,381.80	0.95
13	002088	鲁阳节能	16,200,930.72	0.89
14	300375	鹏翎股份	15,345,095.00	0.84
15	002397	梦洁股份	15,285,374.79	0.84
16	002656	摩登大道	14,688,315.50	0.80
17	002674	兴业科技	14,647,957.80	0.80
18	002718	友邦吊顶	14,283,825.86	0.78
19	600178	东安动力	13,945,603.16	0.76
20	000521	美菱电器	13,417,680.00	0.73

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，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	1,222,143,611.78
卖出股票收入（成交）总额	1,023,555,630.28

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、“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	46,221,670.50	2.53

2	央行票据	-	-
3	金融债券	290,456,000.00	15.87
	其中：政策性金融债	240,286,000.00	13.13
4	企业债券	500,286,202.66	27.34
5	企业短期融资券	800,427,000.00	43.74
6	中期票据	251,162,000.00	13.73
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	87,057,000.00	4.76
9	其他	-	-
10	合计	1,975,609,873.16	107.96

### 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	120227	12 国开 27	1,000,000	100,230,000.00	5.48
2	111690289	16 九台农村商业银行 CD006	900,000	87,057,000.00	4.76
3	160305	16 进出 05	800,000	80,104,000.00	4.38
4	101662012	16 经纬纺织 MTN001	800,000	80,000,000.00	4.37
5	011699800	16 南玻 SCP002	700,000	69,881,000.00	3.82

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1689114	16 和萃 1 优先	100,000	9,982,000.00	0.55

### 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国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	308,858.87
2	应收证券清算款	4,398,994.37
3	应收股利	-
4	应收利息	16,275,788.06
5	应收申购款	9,988.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,993,629.31

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002291	星期六	9,304,230.39	0.51	重大事项

## § 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

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
14,472	123,615.54	159,836,658.46	8.93%	1,629,127,493.53	91.07%

### 8.2 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	3,501,223.61	0.1957%

### 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	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月9日）基金份额总额	1,857,619,160.76
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,919,737.41
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	72,574,746.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,788,964,151.99

注：总申购份额含红利再投和转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本基金管理人于 2016 年 4 月 12 日发布公告，聘任陈振宇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理。

### 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，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	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	
招商证券	2	1,459,805,137.48	65.03%	1,038,357.92	65.03%	-
中投证券	2	784,992,456.80	34.97%	558,364.34	34.97%	-

### 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
招商证券	229,893,023.75	66.30%	2,608,300,000.00	49.29%	-	-
中投证券	116,878,674.43	33.70%	2,683,333,000.00	50.71%	-	-

## 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	安信安盈保本混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报	2016年1月30日
2	安信安盈保本混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报	2016年1月30日
3	安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报	2016年1月30日
4	关于安信安盈保本混合型证券投资基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为基金销售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	2016年1月30日
5	安信基金管理有限责任公司关于	上海证券报、中国证	2016年2月4日

	旗下基金所持众和股份(002070)估值调整的公告	券报、证券时报	
6	安信安盈保本混合型基金关于新增微众银行为基金销售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	2016年2月5日
7	安信基金管理有限责任公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年2月25日
8	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加北京钱景财富投资管理有限公司基金网上申购及定投费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月3日
9	安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报	2016年3月10日
10	安信安盈保本混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月11日
11	安信基金管理有限责任公司更正公告	中国证券报	2016年3月11日
12	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持科大讯飞(002230)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月18日
13	关于安信基金管理有限责任公司新增东海期货为公司旗下开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年3月21日
14	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	2016年4月1日
15	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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月7日

	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		
16	安信安盈保本混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 8 日
17	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
18	关于新增上海陆家嘴资产管理有 限公司为我司旗下基金代销机构 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	2016 年 4 月 20 日
19	安信基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加上海好买基金销售 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	2016 年 4 月 28 日
20	安信基金管理有限责任公司关于 旗下部分公募基金参加深圳市金 斧子投资咨询有限公司费率优惠 活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
21	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、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
22	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金投资资产支持证券的公 告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 18 日
23	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金所持万家文化估值调整 的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 19 日
24	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金所持苏交科、天通股份	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 1 日

	估值调整的公告		
25	安信基金管理有限责任公司关于调整开户证件类型类型的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 18 日
26	安信基金关于变更基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 20 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信安盈保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信安盈保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信安盈保本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。

### 11.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

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

### 11.3 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  
2016 年 8 月 25 日