

安信鑫安得利灵活配置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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 20 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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.....	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信鑫安得利混合	
基金主代码	001399	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	740,863,482.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信鑫安得利 A	安信鑫安得利 C
下属分级基金的交易代码:	001399	001400
报告期末下属分级基金的份额总额	66,397,706.50 份	674,465,775.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，通过多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。资产配置上，考虑经济环境、政策取向、资金供求状况和流动性因素，分析类别资产预期收益和预期风险，根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整；固定收益投资方面，灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略；股票投资上，坚持价值投资理念，重点发掘出价值被市场低估的股票；此外，本基金还辅助性采用衍生品投资策略、风险管理策略和资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	95574

传真	0755-82799292	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 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	中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号
邮政编码	518026	315100
法定代表人	刘入领	陆华裕

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	安信鑫安得利 A	安信鑫安得利 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,124,823.00	51,349,653.21
本期利润	3,749,016.57	32,352,957.76
加权平均基金份额本期利润	0.0182	0.0197
本期加权平均净值利润率	1.73%	1.89%
本期基金份额净值增长率	3.27%	3.19%
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	4,166,877.89	36,706,457.68
期末可供分配基金份额利润	0.0628	0.0544

期末基金资产净值	71,332,155.14	718,915,448.04
期末基金份额净值	1.074	1.066
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.40%	6.60%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信鑫安得利 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.42%	0.07%	0.35%	0.01%	1.07%	0.06%
过去三个月	1.61%	0.11%	1.08%	0.01%	0.53%	0.10%
过去六个月	3.27%	0.11%	2.18%	0.01%	1.09%	0.10%
过去一年	6.76%	0.09%	4.61%	0.01%	2.15%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.40%	0.09%	5.00%	0.01%	2.40%	0.08%

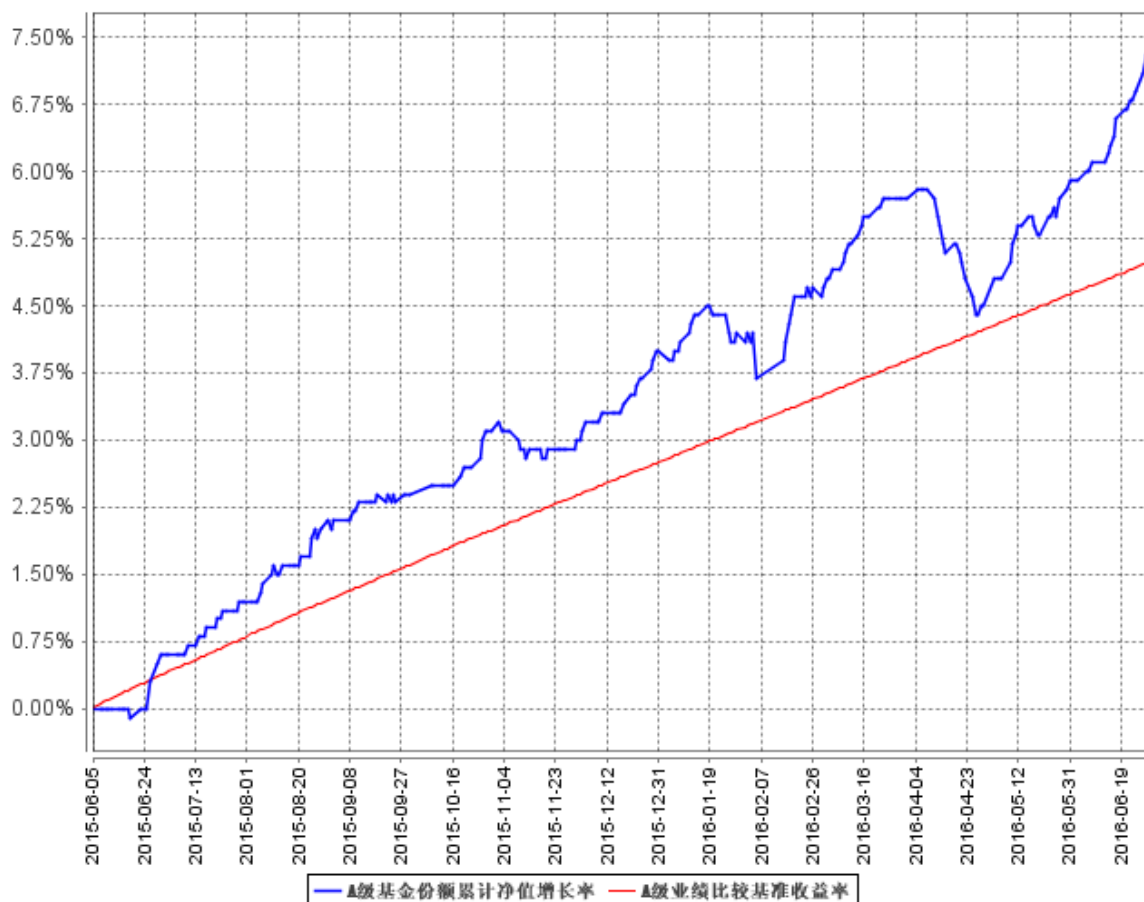
安信鑫安得利 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.43%	0.08%	0.35%	0.01%	1.08%	0.07%
过去三个月	1.52%	0.11%	1.08%	0.01%	0.44%	0.10%
过去六个月	3.19%	0.10%	2.18%	0.01%	1.01%	0.09%
过去一年	5.96%	0.08%	4.61%	0.01%	1.35%	0.07%
自基金合同生效起至今	6.60%	0.08%	5.00%	0.01%	1.60%	0.07%

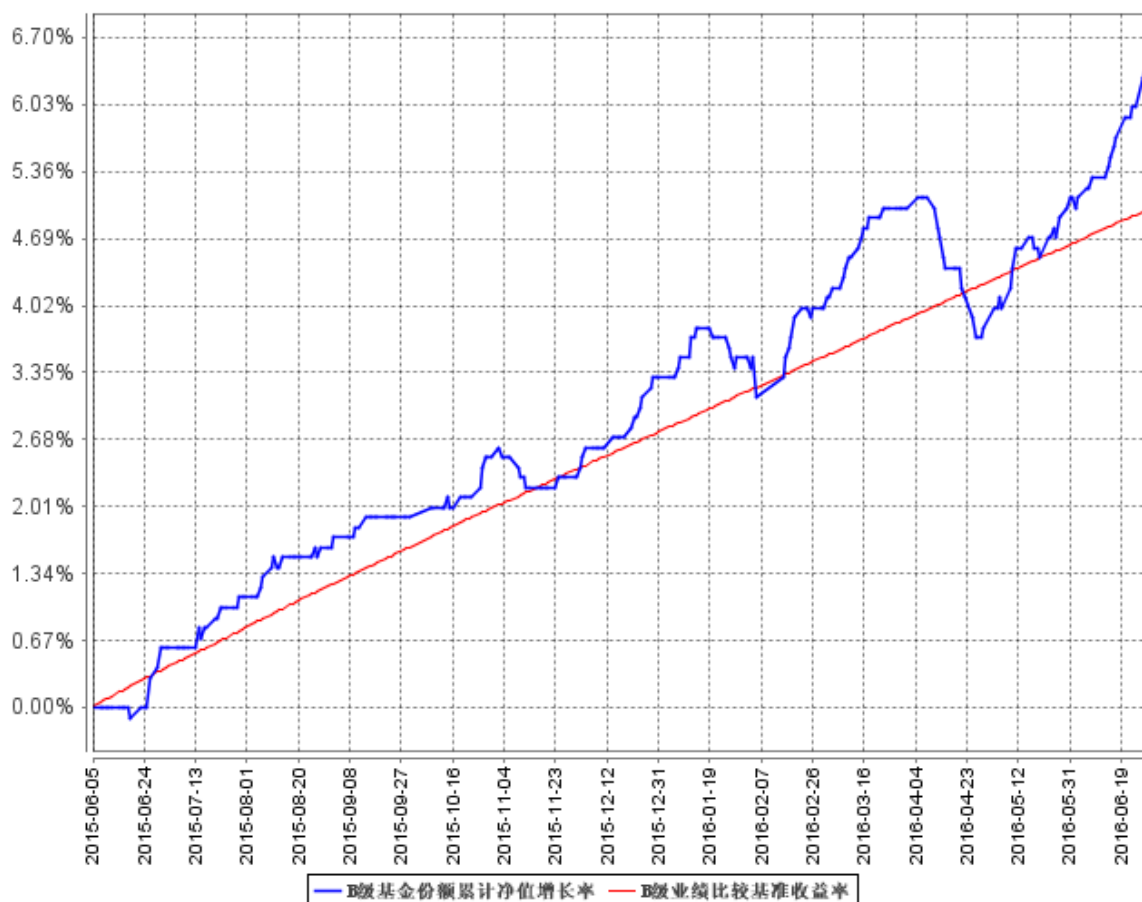
注：1、根据《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

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

A级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



B级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 2015 年 6 月 5 日。图示日期为 2015 年 6 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金的建仓期为 2015 年 6 月 5 日至 2015 年 12 月 4 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 3.5 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 38.72%的股权，安信证券股份有限公司持有 33%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 19.71%的股权，中广核财务有限责任公司持有 8.57%的股权。

截至 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		
庄园	本基金的基金经理	2015 年 6 月 5 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。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度债券市场继续走出了牛市行情，央行继续维持宽松的货币政策，债市资金供给增多，债券配置需求持续上升，收益率小幅下行，信用利差持续缩窄，处于历史较低水平，5 年 AA 的企业债收益率处于 4.5% 以下水平。另外，美联储加息预期减弱，人民币汇率稳定，以及外围宽松的货币政策，均对债券构成利好因素，债市做多热情依旧。但 3 月下旬始，经济基本面数据和金融数据均持续好转，引发市场经济企稳预期，谨慎情绪上升。二季度固定收益市场在针对各类券种的种种利空、后又逐步解除的影响下，总体走出了 V 型走势。股票市场在年初大幅下跌之后二季度基本是一个震荡走势，上证指数在上下 2% 左右的区间内波动。

一季度鑫安得利维持了股票低仓位，参与了部分新股的 IPO，对基金净值有一定的贡献。债券方面维持了一定的杠杆，具体品种方面以公司债、中票和同业存单为主，组合久期控制在 2-3 年左右。二季度股票维持了前期的低仓位，由于固定收益仓位较重，在四月份固定收益市场调整期间净值有所回落，在总体对债券市场后市乐观的判断下，除了必要的减仓之外维持了前期的杠杆，五月份以来随着股票市场和债券市场的双双走强，基金净值走势也有所体现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本报告期本基金 A 类份额净值增长率为 3.27%，本基金 C 类份额净值增长率为 3.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末以来，各类债券品种收益率整体下行，市场情绪有所恢复，但是利率债各期限利差已经处于历史相对低位，利率虽然下行，但是和去年下半年已不能同日而语，每个点位争夺都比较激烈，市场情绪仍然不稳，也反应了现在投资对于未来市场的预期走势的不确定。在目前稳健货币政策的环境下，央行大概率会持续利用逆回购、MLF 等多种手段平复货币市场波动，降准或不可预期。信用债方面，未来 2 个月也是评级下调的密集期，市场对于风险的防范明显提高，下半年还有 2.8 万亿信用债到期，8 月和 11 月是兑付高峰，这也会进一步阻止利率下行的步伐。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

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，宁波银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：安信鑫安得利灵活配置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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,122,972.79	28,026,501.73
结算备付金		30,577,647.61	37,471,722.69
存出保证金		378,297.57	778,604.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,019,138,108.35	3,897,722,254.37
其中：股票投资		22,640,834.49	34,013,649.24
基金投资		-	-

债券投资		996,497,273.86	3,863,708,605.13
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	400,000,720.00
应收证券清算款		15,829,818.14	32,089,393.53
应收利息	6.4.7.5	23,803,770.91	42,671,545.48
应收股利		-	-
应收申购款		10,351.54	10,992.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,100,860,966.91	4,438,771,734.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
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		293,317,000.00	980,000,000.00
应付证券清算款		16,054,383.97	9,040,270.83
应付赎回款		250,192.71	275,842.76
应付管理人报酬		548,109.47	2,350,954.82
应付托管费		68,513.69	293,869.35
应付销售服务费		124,999.95	528,763.63
应付交易费用	6.4.7.7	21,784.12	152,638.92
应交税费		-	-
应付利息		24,444.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,935.36	110,199.54
负债合计		310,613,363.73	992,752,539.85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	740,863,482.16	3,332,588,227.65
未分配利润	6.4.7.10	49,384,121.02	113,430,967.27
所有者权益合计		790,247,603.18	3,446,019,194.92
负债和所有者权益总计		1,100,860,966.91	4,438,771,734.77

注：报告截止日为 2016 年 6 月 30 日，安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.074 元，安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.066 元；基金份额总额 740,863,482.16 份，其中安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 66,397,706.50 份，安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 674,465,775.66 份。

6.2 利润表

会计主体：安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月5日(基金合 同生效日)至2015年6 月30日
一、收入		53,065,351.55	77,293,495.23
1.利息收入		44,635,589.33	10,618,243.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	768,317.23	8,602,274.21
债券利息收入		43,390,613.45	632,468.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		476,658.65	1,383,500.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		30,729,872.86	27,167,904.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,829,909.11	27,090,954.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	17,869,363.75	-
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	30,600.00	76,950.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-22,372,501.88	39,492,114.27
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	72,391.24	15,232.76
减：二、费用		16,963,377.22	7,804,156.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,677,499.37	5,055,498.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	959,687.46	631,937.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,700,959.98	1,066,739.07
4. 交易费用	6.4.7.20	87,670.82	737,504.86
5. 利息支出		6,314,931.37	281,124.26
其中：卖出回购金融资产支出		6,314,931.37	281,124.26
6. 其他费用	6.4.7.21	222,628.22	31,352.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,101,974.33	69,489,338.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,101,974.33	69,489,338.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,332,588,227.65	113,430,967.27	3,446,019,194.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,101,974.33	36,101,974.33
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)	-2,591,724,745.49	-100,148,820.58	-2,691,873,566.07
其中：1.基金申购款	801,093,259.15	38,259,162.13	839,352,421.28
2.基金赎回款	-3,392,818,004.64	-138,407,982.71	-3,531,225,987.35
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)	740,863,482.16	49,384,121.02	790,247,603.18
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 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)	2,495,462,744.08	-	2,495,462,744.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,556,077.43	70,556,077.43
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)	9,544,043,365.04	11,227.91	9,544,054,592.95
其中：1.基金申购款	9,546,390,557.49	13,760.13	9,546,404,317.62
2.基金赎回款	-2,347,192.45	-2,532.22	-2,349,724.67
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)	12,039,506,109.12	70,567,305.34	12,110,073,414.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4. 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>尚尔航</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2015年5月18日下发的证监许可[2015]924号文“关于准予安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”的核准,由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。

本基金募集期间为2015年6月1日至2015年6月2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_H64号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,495,390,544.02元。经向中国证监会备案,《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月5日正式生效。截至2015年6月4日止,安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币2,495,390,544.02元,折合2,495,390,544.02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为人民币72,200.06元,折合72,200.06份基金份额。其中鑫安得利A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565,446,845.02元,折合565,446,845.02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为人民币16,443.13元,折合16,443.13份基金份额;鑫安得利C已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币1,929,943,699.00元,折合1,929,943,699.00份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币55,756.93元,折合21,240.09份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币2,495,462,744.08元,折合2,495,462,744.08份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金投资范围包括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、国债期货、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币定期存款基准利率 +3.00%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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〉》、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。

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 1 月 1 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	11,122,972.79
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	11,122,972.79

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	23,118,595.79	22,640,834.49	-477,761.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	553,588,429.50	556,238,473.86
	银行间市场	434,770,977.83	440,258,800.00
	合计	988,359,407.33	996,497,273.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,011,478,003.12	1,019,138,108.35	7,660,105.23

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	4,661.50
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	13,759.90
应收债券利息	23,785,179.31
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	170.20
合计	23,803,770.91

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	2,826.07
银行间市场应付交易费用	18,958.05
合计	21,784.12

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	57.14
预提费用	203,878.22
合计	203,935.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信鑫安得利 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	326,529,719.45	326,529,719.45
本期申购	1,253,397.64	1,253,397.64
本期赎回(以“-”号填列)	-261,385,410.59	-261,385,410.59
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	66,397,706.50	66,397,706.50

金额单位：人民币元

安信鑫安得利 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,006,058,508.20	3,006,058,508.20
本期申购	799,839,861.51	799,839,861.51
本期赎回(以“-”号填列)	-3,131,432,594.05	-3,131,432,594.05
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	674,465,775.66	674,465,775.66

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信鑫安得利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,263,663.63	2,763,814.70	13,027,478.33
本期利润	7,124,823.00	-3,375,806.43	3,749,016.57
本期基金份额交易产生的变动数	-13,221,608.74	1,379,562.48	-11,842,046.26
其中：基金申购款	54,068.07	4,647.16	58,715.23
基金赎回款	-13,275,676.81	1,374,915.32	-11,900,761.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,166,877.89	767,570.75	4,934,448.64

单位：人民币元

安信鑫安得利 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,064,055.21	25,339,433.73	100,403,488.94
本期利润	51,349,653.21	-18,996,695.45	32,352,957.76
本期基金份额交易产生的变动数	-89,707,250.74	1,400,476.42	-88,306,774.32
其中：基金申购款	32,971,486.48	5,228,960.42	38,200,446.90
基金赎回款	-122,678,737.22	-3,828,484.00	-126,507,221.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,706,457.68	7,743,214.70	44,449,672.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	329,158.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	436,070.93
其他	3,087.95
合计	768,317.23

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	26,831,981.46
减：卖出股票成本总额	14,002,072.35
买卖股票差价收入	12,829,909.11

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1月1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	17,869,363.75
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	17,869,363.75

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1月1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	6,235,643,962.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,120,626,062.09
减：应收利息总额	97,148,537.10
买卖债券差价收入	17,869,363.75

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1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	30,600.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,600.00

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1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-22,240,331.88
——股票投资	-4,026,520.99
——债券投资	-18,213,810.89
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-132,170.00
合计	-22,372,501.88

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	30,168.17
基金转换费收入	42,223.07
合计	72,391.24

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	56,145.82
银行间市场交易费用	31,525.00
合计	87,670.82

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	149,178.12
银行间帐户维护费	18,300.00
其他	450.00
合计	222,628.22

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
宁波银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：1、本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。
2、本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。
3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,677,499.37	5,055,498.59
其中：支付销售机构的客户维护费	157,241.95	81,884.08

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

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	959,687.46	631,937.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，托管费的计算方法如下：

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信鑫安得利 A	安信鑫安得利 C	合计
安信证券股份有限公司	-	17.08	17.08
宁波银行股份有限公司	-	3,025.12	3,025.12
安信基金管理有限责任公司	-	1,662,355.40	1,662,355.40
合计	-	1,665,397.60	1,665,397.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 6 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信鑫安得利 A	安信鑫安得利 C	合计
安信证券股份有限公司	-	0.75	0.75
宁波银行股份有限公司	-	2,164.33	2,164.33
安信基金管理有限责任公司	-	1,064,483.09	1,064,483.09
合计	-	1,066,648.17	1,066,648.17

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末及上年度可比期间未持有本基金份额。

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 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	11,122,972.79	768,317.23	290,421,666.96	862,046.04

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

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
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	25,715	89,231.05	537,957.80	-

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 0 元，无质押债券。

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 293,317,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 7 月 12 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 124.72%。

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	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	11,109,961.90	1,499,976,071.68
合计	11,109,961.90	1,499,976,071.68

- 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	上年度末 2015年12月31日
AAA	391,148,026.20	839,462,015.30
AAA 以下	618,024,465.00	1,384,685,274.63
未评级	0.00	182,148,222.51
合计	1,009,172,491.27	2,406,295,512.44

- 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	11,122,972.79	-	-	-	11,122,972.79
结算备付金	30,577,647.61	-	-	-	30,577,647.61
存出保证金	378,297.57	-	-	-	378,297.57
交易性金融资产	10,857,914.10	927,782,776.00	57,856,583.76	22,640,834.49	1,019,138,108.35
应收证券清算款	-	-	-	15,829,818.14	15,829,818.14
应收利息	-	-	-	23,803,770.91	23,803,770.91
应收申购款	-	-	-	10,351.54	10,351.54
资产总计	52,936,832.07	927,782,776.00	57,856,583.76	62,284,775.08	1,100,860,966.91
负债					
卖出回购金融资产款	293,317,000.00	-	-	-	293,317,000.00
应付证券清算款	-	-	-	16,054,383.97	16,054,383.97
应付赎回款	-	-	-	250,192.71	250,192.71

应付管理人报酬	-	-	-	548,109.47	548,109.47
应付托管费	-	-	-	68,513.69	68,513.69
应付销售服务费	-	-	-	124,999.95	124,999.95
应付交易费用	-	-	-	21,784.12	21,784.12
应付利息	-	-	-	24,444.46	24,444.46
其他负债	-	-	-	203,935.36	203,935.36
负债总计	293,317,000.00	-	-	17,296,363.73	310,613,363.73
利率敏感度缺口	-240,380,167.93	927,782,776.00	57,856,583.76	44,988,411.35	790,247,603.18
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,026,501.73	-	-	-	28,026,501.73
结算备付金	37,471,722.69	-	-	-	37,471,722.69
存出保证金	778,604.91	-	-	-	778,604.91
交易性金融资产	1,676,877,689.20	2,147,138,761.80	39,692,154.13	34,013,649.24	3,897,722,254.37
买入返售金融资产	400,000,720.00	-	-	-	400,000,720.00
应收证券清算款	-	-	-	32,089,393.53	32,089,393.53
应收利息	-	-	-	42,671,545.48	42,671,545.48
应收申购款	-	-	-	10,992.06	10,992.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,143,155,238.53	2,147,138,761.80	39,692,154.13	108,785,580.31	4,438,771,734.77
负债					
卖出回购金融资产款	980,000,000.00	-	-	-	980,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	9,040,270.83	9,040,270.83
应付赎回款	-	-	-	275,842.76	275,842.76
应付管理人报酬	-	-	-	2,350,954.82	2,350,954.82
应付托管费	-	-	-	293,869.35	293,869.35
应付销售服务费	-	-	-	528,763.63	528,763.63
应付交易费用	-	-	-	152,638.92	152,638.92
其他负债	-	-	-	110,199.54	110,199.54
负债总计	980,000,000.00	-	-	12,752,539.85	992,752,539.85
利率敏感度缺口	1,163,155,238.53	2,147,138,761.80	39,692,154.13	96,033,040.46	3,446,019,194.92

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）	上年度末（2015年12月31日）
	1、市场利率下降 25 个基点	7,378,338.45	17,999,137.51
2、市场利率上升 25 个基点	-7,297,563.05	-17,843,582.19	

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。本基金投资于股票的资金占基金资产的比例为 0%-95%。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		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

交易性金融资产-股票投资	22,640,834.49	2.87	34,013,649.24	0.99
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	22,640,834.49	2.87	34,013,649.24	0.99

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 2.86%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于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	22,640,834.49	2.06
	其中：股票	22,640,834.49	2.06
2	固定收益投资	996,497,273.86	90.52
	其中：债券	996,497,273.86	90.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	41,700,620.40	3.79
7	其他各项资产	40,022,238.16	3.64
8	合计	1,100,860,966.91	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	-	-

C	制造业	8,724,258.19	1.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	537,957.80	0.07
F	批发和零售业	-	-
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	0.01
J	金融业	13,288,000.00	1.68
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	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,640,834.49	2.87

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	601288	农业银行	3,500,000	11,200,000.00	1.42
2	002594	比亚迪	100,000	6,101,000.00	0.77
3	000063	中兴通讯	150,000	2,151,000.00	0.27
4	000001	平安银行	240,000	2,088,000.00	0.26
5	601611	中国核建	25,715	537,957.80	0.07
6	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.03
7	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
8	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01

9	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
10	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
11	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
12	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
13	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
14	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
15	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
16	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	000063	中兴通讯	3,008,000.00	0.09
2	000001	平安银行	2,030,000.00	0.06
3	002797	第一创业	138,320.00	0.00
4	603377	东方时尚	113,750.40	0.00
5	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
6	601611	中国核建	89,231.05	0.00
7	603608	天创时尚	78,341.20	0.00
8	603919	金徽酒	72,247.76	0.00
9	002792	通宇通讯	70,678.14	0.00
10	002788	鹭燕医药	68,314.95	0.00
11	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
12	601127	小康股份	50,326.22	0.00
13	002790	瑞尔特	50,104.76	0.00
14	300512	中亚股份	39,164.43	0.00
15	603861	白云电器	34,476.00	0.00
16	002789	建艺集团	33,795.00	0.00
17	300474	景嘉微	33,649.88	0.00
18	300516	久之洋	33,142.50	0.00
19	601020	华钰矿业	31,426.86	0.00
20	603101	汇嘉时代	31,390.03	0.00

注：1、买入包括基金二级市场上的主动的买入、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	000725	京东方 A	7,860,000.00	0.23
2	603508	思维列控	1,884,276.00	0.05
3	300496	中科创达	1,299,254.00	0.04
4	603999	读者传媒	1,253,849.00	0.04
5	603866	桃李面包	1,158,963.30	0.03
6	300495	美尚生态	892,687.50	0.03
7	603996	中新科技	875,261.28	0.03
8	000063	中兴通讯	693,000.00	0.02
9	300494	盛天网络	600,096.00	0.02
10	002782	可立克	519,301.12	0.02
11	002786	银宝山新	513,567.90	0.01
12	300493	润欣科技	500,112.00	0.01
13	603778	乾景园林	492,877.40	0.01
14	603299	井神股份	469,980.00	0.01
15	002787	华源包装	419,679.90	0.01
16	300497	富祥股份	417,096.96	0.01
17	002780	三夫户外	393,829.04	0.01
18	601900	南方传媒	387,539.20	0.01
19	603377	东方时尚	374,544.00	0.01
20	002797	第一创业	324,220.00	0.01

注:、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	6,655,778.59
卖出股票收入(成交)总额	26,831,981.46

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	10,857,914.10	1.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	549,608,404.21	69.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	433,843,000.00	54.90
7	可转债（可交换债）	2,187,955.55	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	996,497,273.86	126.10

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	112276	15 金鸿债	780,000	78,514,800.00	9.94
2	101569028	15 泛海 MTN001	700,000	72,016,000.00	9.11
3	112259	15 甘电债	700,000	71,400,000.00	9.04
4	101554099	15 泰达投资 MTN001	600,000	60,504,000.00	7.66
5	122415	15 增碧 01	600,000	60,036,000.00	7.60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	378,297.57
2	应收证券清算款	15,829,818.14
3	应收股利	-
4	应收利息	23,803,770.91
5	应收申购款	10,351.54

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,022,238.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601611	中国核建	537,957.80	0.07	临时停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
安信鑫安得利 A	857	77,476.90	0.00	0.00%	66,397,706.50	100.00%
安信鑫安得利 C	120	5,620,548.13	671,077,060.66	99.50%	3,388,715.00	0.50%
合计	977	758,304.49	671,077,060.66	90.58%	69,786,421.50	9.42%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	安信鑫安	295,356.27	0.4448%

持有本基金	得利 A		
	安信鑫安得利 C	-	-
	合计	295,356.27	0.0399%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信鑫安得利 A	10~50
	安信鑫安得利 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	安信鑫安得利 A	0
	安信鑫安得利 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信鑫安得利 A	安信鑫安得利 C
基金合同生效日（2015 年 6 月 5 日）基金份额总额	565,463,288.15	1,929,999,455.93
本报告期期初基金份额总额	326,529,719.45	3,006,058,508.20
本报告期基金总申购份额	1,253,397.64	799,839,861.51
减：本报告期基金总赎回份额	261,385,410.59	3,131,432,594.05
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	66,397,706.50	674,465,775.66

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

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	2	31,869,981.46	100.00%	22,669.12	100.00%	-

注：公司制定《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》，对选择证券公司的标准和程序、以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度，由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分，评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等，由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	2,446,111,360.59	100.00%	61,047,235,000.00	100.00%	-	-

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	安信基金管理有限责任公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月6日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持清新环境(002573)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月12日
3	安信基金管理有限责任公司关于公司法定代表人变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月16日
4	安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月20日
5	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1月28日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持万科 A(000002)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月29日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持众和股份(002070)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年2月4日
8	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公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年2月25日
9	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
10	关于恢复安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额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3月12日

11	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
12	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
13	安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2015年3月25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村商业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月7日
16	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
17	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
18	安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年4月22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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年5月19日

	估值调整的公告		
24	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持苏交科、天通股份估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 1 日
25	安信基金管理有限责任公司关于调整开户证件类型的公告	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鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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