

安信价值精选股票型证券投资基金 2016 年 年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了 2016 年度标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
8.7 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	56

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10 开放式基金份额变动	58
§11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	61
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信价值精选股票型证券投资基金
基金简称	安信价值精选股票
基金主代码	000577
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 21 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	266,517,625.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金的股票资产主要投资于价值型股票，坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上，分析基础利率的走势，研究利率期限结构和中长期收益率走势，在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金，属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	田青
	联系电话	0755-82509999	010-67595096
	电子邮箱	service@essencefund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	010-67595096

传真	0755-82799292	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	刘入领	王洪章

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	安信基金管理有限公司 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限公司	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 4 月 21 日 (基金合同生效日)–2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,472,056.13	28,482,422.68	6,014,903.22
本期利润	-1,154,449.97	28,279,001.94	13,115,275.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0218	0.8279	0.1992
本期加权平均净值利润率	-1.10%	47.36%	19.10%
本期基金份额净值增长率	8.49%	48.40%	31.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配利润	275,892,697.05	46,327,329.11	6,353,622.76
期末可供分配基金份额利润	1.0352	0.9439	0.1770
期末基金资产净值	562,131,705.03	95,409,917.96	47,000,671.49
期末基金份额净值	2.109	1.944	1.310
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	110.90%	94.40%	31.00%

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

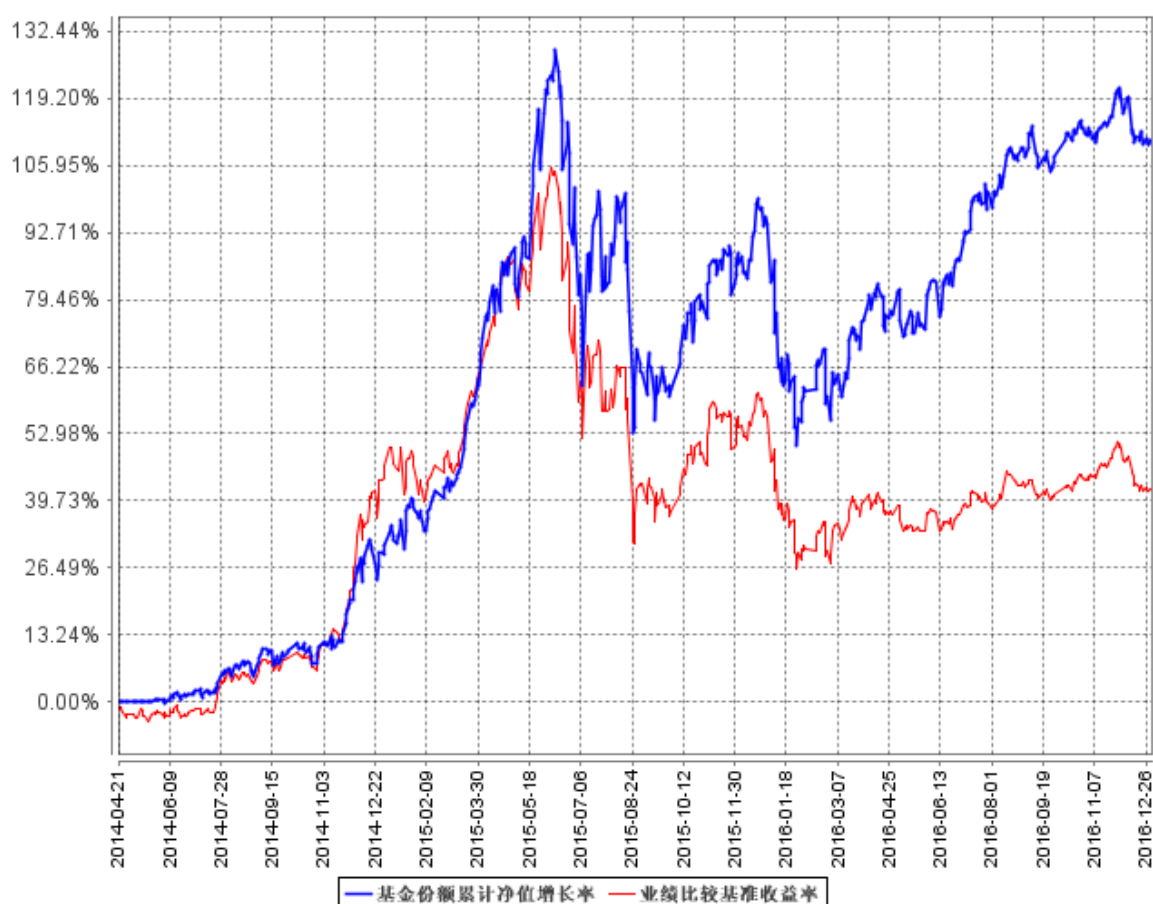
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.54%	0.72%	0.89%	0.58%	0.65%	0.14%
过去六个月	12.42%	0.81%	3.71%	0.61%	8.71%	0.20%
过去一年	8.49%	1.52%	-9.11%	1.12%	17.60%	0.40%
自基金合同生效起至今	110.90%	1.73%	42.13%	1.47%	68.77%	0.26%

注：根据《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债总指数收益率。其中沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

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

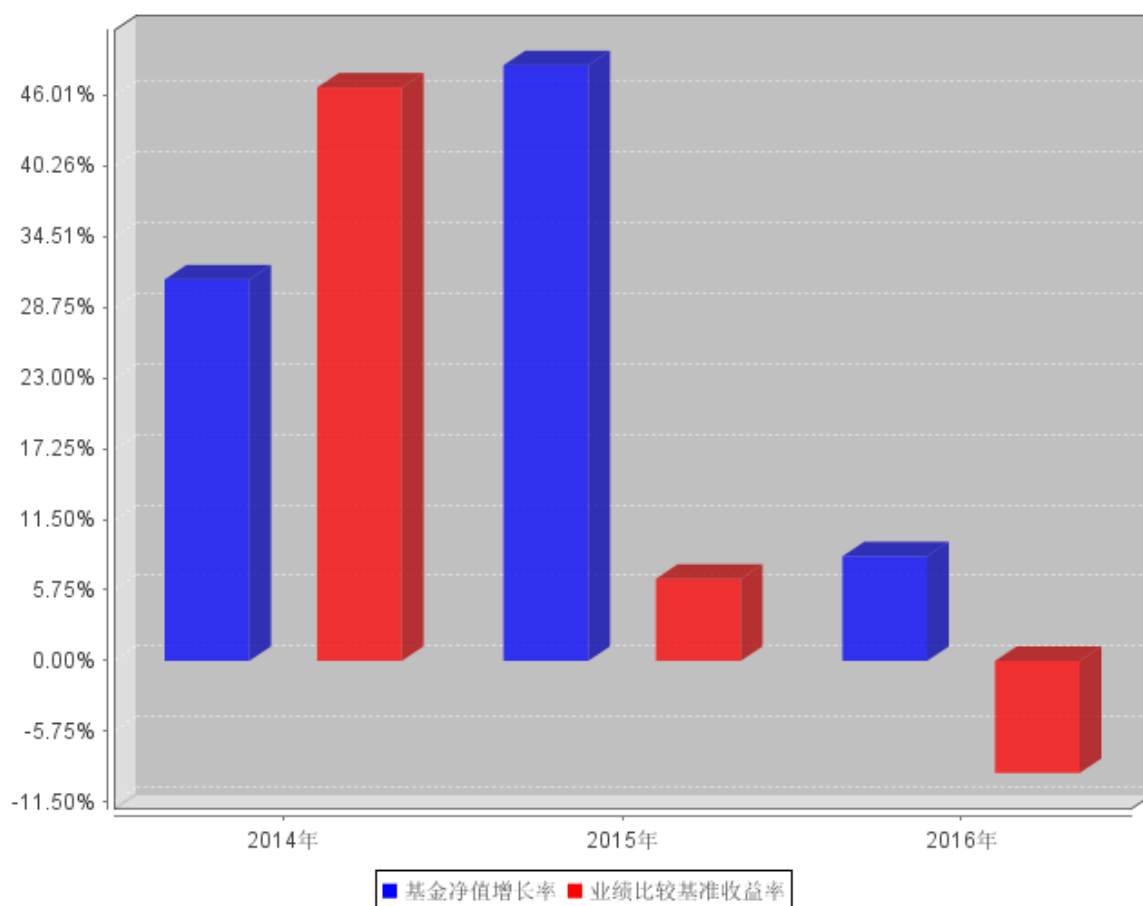


注：1、本基金的建仓期为 2014 年 4 月 21 日至 2014 年 10 月 20 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 4 月 21 日。图示日期为 2014 年 4 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2014 年 4 月 21 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 30 只开放式基金，具体如下：从 2012 年 6 月 20 日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2012 年 9 月 25 日起管理安信目

标收益债券型证券投资基金；从 2012 年 12 月 18 日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从 2013 年 2 月 5 日起管理安信现金管理货币市场基金；从 2013 年 7 月 24 日起管理安信宝利债券型证券投资基金(LOF)(原安信宝利分级债券型证券投资基金)；从 2013 年 11 月 8 日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从 2013 年 12 月 31 日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2014 年 4 月 21 日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从 2014 年 11 月 24 日起管理安信现金增利货币市场基金；从 2015 年 3 月 19 日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从 2015 年 4 月 15 日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 14 日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从 2015 年 5 月 20 日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 25 日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 6 月 5 日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日起管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日起管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年 10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈一峰	本基金的基金经理	2014 年 4 月 21 日	-	8	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司基

					金投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理助理	2015 年 3 月 19 日	-	11	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、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基

					金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李巍	本基金基金经理助理	2016 年 11 月 21 日	-	4	李巍先生，理学硕士。曾任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员，富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
徐立华	本基金的基金经理助理	2015 年 4 月 20 日	2016 年 10 月 13 日	5	徐立华先生，理学博士。曾任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任研究员。
许杰	本基金基金经理助理	2016 年 8 月 15 日	-	6	许杰先生，理学博士。历任深圳市裕晋投资有限公司投资研究部研究员、投资经理，安信基

					金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年年初市场经历了惨烈的熔断之后，一直波动盘升，年末又受到债市去杠杆引起的流动性紧张，市场出现大幅回落。虽然全年市场表现低迷，但我们一直秉承注重基本面和估值的思路精选股票，获得了较为理想的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.109 元，本报告期份额净值增长率为 8.49%，同期业绩比较基准增长率为-9.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济在积极财政政策带动下有望继续保持平稳，流动性则难进一步宽松，因此我们对后市维持震荡上升的格局判断。

虽然市场难有大幅度行情，但仍存在结构性机会。我们看好 PPP 产业链、石化产业链中的优秀股票，以及高端装备、新能源汽车、TMT、医药生物等行业中具有真实成长逻辑的优质个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 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。截至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。

4.8 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。

4.9 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，中国建设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合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60962175_H08 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信价值精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的安信价值精选股票型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人安信基金管理有限责任公司的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相

	关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信价值精选股票型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	昌华	陈立群
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信价值精选股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	119,140,380.49	19,400,352.95
结算备付金		1,052,525.37	330,820.34
存出保证金		44,824.74	21,675.04
交易性金融资产	7.4.7.2	529,218,863.24	81,888,847.04
其中：股票投资		515,605,583.54	81,888,847.04
基金投资		-	-
债券投资		13,613,279.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	220,966.90	1,658.98
应收股利		-	-
应收申购款		394,617.48	8,395,640.55
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		650,072,178.22	110,038,994.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		86,535,766.42	14,412,780.48
应付赎回款		389,422.38	44,531.19
应付管理人报酬		267,186.86	51,425.15
应付托管费		66,796.74	12,856.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	330,818.01	57,406.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	350,482.78	50,076.91
负债合计		87,940,473.19	14,629,076.94
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	266,517,625.65	49,082,588.85
未分配利润	7.4.7.10	295,614,079.38	46,327,329.11
所有者权益合计		562,131,705.03	95,409,917.96
负债和所有者权益总计		650,072,178.22	110,038,994.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.109 元，基金份额总额 266,517,625.65 份。

7.2 利润表

会计主体：安信价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		1,206,898.91	29,751,912.40
1. 利息收入		120,106.77	82,202.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	70,434.53	40,262.12
债券利息收入		46,268.56	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,403.68	41,940.32
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,129,623.32	29,439,407.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,144,237.80	28,632,330.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	65,189.58	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	920,195.94	807,076.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-5,626,506.10	-203,420.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	583,674.92	433,723.13
减：二、费用		2,361,348.88	1,472,910.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,027,379.66	595,151.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	256,844.89	148,787.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	695,583.26	346,795.93
5. 利息支出		5,861.30	-
其中：卖出回购金融资产支出		5,861.30	-
6. 其他费用	7.4.7.21	375,679.77	382,175.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,154,449.97	28,279,001.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,154,449.97	28,279,001.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	49,082,588.85	46,327,329.11	95,409,917.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,154,449.97	-1,154,449.97
三、本期基金份额交易产	217,435,036.80	250,441,200.24	467,876,237.04

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	284,732,014.12	313,195,647.33	597,927,661.45
2. 基金赎回款	-67,296,977.32	-62,754,447.09	-130,051,424.41
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)	266,517,625.65	295,614,079.38	562,131,705.03
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	35,891,215.29	11,109,456.20	47,000,671.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,279,001.94	28,279,001.94
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)	13,191,373.56	6,938,870.97	20,130,244.53
其中: 1. 基金申购款	62,366,940.45	45,303,594.13	107,670,534.58
2. 基金赎回款	-49,175,566.89	-38,364,723.16	-87,540,290.05
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)	49,082,588.85	46,327,329.11	95,409,917.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信价值精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2014 年 1 月 21 日下发的证监许可[2014]114 号文“关于核准安信价值精选

股票型证券投资基金募集的批复”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《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2014 年 3 月 20 日至 2014 年 4 月 17 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(2014)验字 60962175_H10 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,942,239.67 元。经向中国证监会备案，《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 4 月 21 日正式生效。截至 2014 年 4 月 21 日止，安信价值精选股票型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 200,942,239.67 元，折合 200,942,239.67 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 48,990.66 元，折合 48,990.66 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 200,991,230.33 元，折合 200,991,230.33 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信价值精选股票型证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金各类资产投资比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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

金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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；有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金的固定管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提；本基金的浮动管理费根据每份基金份额在持有期间的年化收益率水平收取，浮动管理费在基金份额持有人赎回/转出基金份额

额时收取。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提；

(3) 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。

7.4.4.11 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 3 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分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(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) 本基金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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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。

自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定,2017 年 7 月 1 日(含)以后,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 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、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	119,140,380.49	19,400,352.95
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-

其他存款	-	-
合计：	119,140,380.49	19,400,352.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		514,301,610.70	515,605,583.54	1,303,972.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	13,646,807.50	13,613,279.70	-33,527.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,646,807.50	13,613,279.70	-33,527.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		527,948,418.20	529,218,863.24	1,270,445.04
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		74,991,895.90	81,888,847.04	6,896,951.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		74,991,895.90	81,888,847.04	6,896,951.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	13,419.25	1,484.52
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	520.96	163.79
应收债券利息	207,004.47	-
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	22.22	10.67
合计	220,966.90	1,658.98

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	330,818.01	57,406.89
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	330,818.01	57,406.89

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	482.78	76.91
预提费用	350,000.00	50,000.00
合计	350,482.78	50,076.91

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,082,588.85	49,082,588.85
本期申购	284,732,014.12	284,732,014.12
本期赎回（以“-”号填列）	-67,296,977.32	-67,296,977.32
- 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	266,517,625.65	266,517,625.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 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
上年度末	47,788,180.12	-1,460,851.01	46,327,329.11
本期利润	4,472,056.13	-5,626,506.10	-1,154,449.97
本期基金份额交易产生的变动数	223,632,460.80	26,808,739.44	250,441,200.24
其中：基金申购款	289,265,470.01	23,930,177.32	313,195,647.33
基金赎回款	-65,633,009.21	2,878,562.12	-62,754,447.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	275,892,697.05	19,721,382.33	295,614,079.38

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	64,627.07	34,033.88
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	4,966.19	5,490.94
其他	841.27	737.30
合计	70,434.53	40,262.12

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。

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	134,675,728.26	122,870,701.19
减：卖出股票成本总额	129,531,490.46	94,238,370.50
买卖股票差价收入	5,144,237.80	28,632,330.69

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	400,264.20	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	334,998.41	-
减：应收利息总额	76.21	-
买卖债券差价收入	65,189.58	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	920,195.94	807,076.88
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	920,195.94	807,076.88

7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-5,626,506.10	-203,420.74
——股票投资	-5,592,978.30	-203,420.74
——债券投资	-33,527.80	-
——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	-	-
合计	-5,626,506.10	-203,420.74

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	581,828.83	423,332.16
转换费收入	1,846.09	10,390.97
合计	583,674.92	433,723.13

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	695,583.26	346,795.93
银行间市场交易费用	-	-
合计	695,583.26	346,795.93

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
----	---	--

审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	240,000.00
银行划款费用	4,479.77	3,115.37
银行间帐户维护费	21,200.00	13,500.00
其他	-	20,560.00
律师费	-	55,000.00
合计	375,679.77	382,175.37

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
安信证券	34,624,414.17	4.94%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
安信证券	24,628.42	4.94%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
安信证券	-	-	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	1,027,379.66	595,151.32

的管理费		
其中：支付销售机构的客 户维护费	154,136.51	57,333.02

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	256,844.89	148,787.84

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上期未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联 方名 称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
安信乾 盛财富 管 理	10,000,000.00	3.7521%	21,160,916.44	43.1129%

(深圳) 有 限公司				
-----------------	--	--	--	--

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	119,140,380.49	64,627.07	19,400,352.95	34,033.88

注：本基金资金托管账户的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期及上年度可比期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	23.16	23.16	1,257	29,112.12	29,112.12	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.12.2 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
------	------	------	------	----------------	------	----------------	-------	------------	------------	----

002464	金利科技	2016 年 12 月 28 日	重大事 项	78.20	2017 年 1 月 5 日	78.03	26,200	1,989,604.00	2,048,840.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	13.79	-	-	16,979	242,847.10	234,140.41	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大事 项	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	4,000	96,620.00	103,760.00	-
600973	宝胜股份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	8.05	2017 年 2 月 23 日	-	12,300	98,892.00	99,015.00	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大事 项	16.63	-	-	4,900	67,620.00	81,487.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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为 0 元，无质押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

截至 2016 年 12 月 31 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 0%，因此本基金无重大信用风险。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,820,284.17	-
合计	13,820,284.17	-

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。

7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 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、监控投资品种的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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	119,140,380.49	-	-	-	119,140,380.49
结算备付金	1,052,525.37	-	-	-	1,052,525.37
存出保证金	44,824.74	-	-	-	44,824.74
交易性金融资产	13,613,279.70	-	-	515,605,583.54	529,218,863.24
应收利息	-	-	-	220,966.90	220,966.90
应收申购款	-	-	-	394,617.48	394,617.48
资产总计	133,851,010.30	-	-	516,221,167.92	650,072,178.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	86,535,766.42	86,535,766.42
应付赎回款	-	-	-	389,422.38	389,422.38
应付管理人报酬	-	-	-	267,186.86	267,186.86
应付托管费	-	-	-	66,796.74	66,796.74
应付交易费用	-	-	-	330,818.01	330,818.01
其他负债	-	-	-	350,482.78	350,482.78
负债总计	-	-	-	87,940,473.19	87,940,473.19
利率敏感度缺口	133,851,010.30	-	-	428,280,694.73	562,131,705.03
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	19,400,352.95	-	-	-	19,400,352.95
结算备付金	330,820.34	-	-	-	330,820.34
存出保证金	21,675.04	-	-	-	21,675.04
交易性金融资产	-	-	-	81,888,847.04	81,888,847.04
应收利息	-	-	-	1,658.98	1,658.98
应收申购款	-	-	-	8,395,640.55	8,395,640.55
资产总计	19,752,848.33	-	-	90,286,146.57	110,038,994.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,412,780.48	14,412,780.48
应付赎回款	-	-	-	44,531.19	44,531.19
应付管理人报酬	-	-	-	51,425.15	51,425.15
应付托管费	-	-	-	12,856.32	12,856.32
应付交易费用	-	-	-	57,406.89	57,406.89
其他负债	-	-	-	50,076.91	50,076.91
负债总计	-	-	-	14,629,076.94	14,629,076.94
利率敏感度缺口	19,752,848.33	-	-	75,657,069.63	95,409,917.96

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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1、市场利率下降 25 个基点	11,628.92	-
	2、市场利率上升 25 个基点	-11,609.89	-

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 60%-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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	515,605,583.54	91.72	81,888,847.04	85.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	515,605,583.54	91.72	81,888,847.04	85.83

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	1、业绩比较基准上升 5%	11,439,380.20	4,647,717.31
	2、业绩比较基准下降 5%	-11,439,380.20	-4,647,717.31

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 512,600,383.85 元，划分为第二层级的余额为人民币 16,618,479.39 元，无划分为第三层级余额（于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 81,570,745.44 元，划分为第二层级的余额为人民币 318,101.60 元，无划分为第三层级余额）。

公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并

根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	515,605,583.54	79.32
	其中：股票	515,605,583.54	79.32
2	固定收益投资	13,613,279.70	2.09
	其中：债券	13,613,279.70	2.09
	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	120,192,905.86	18.49
7	其他各项资产	660,409.12	0.10
8	合计	650,072,178.22	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,194,986.00	1.81
C	制造业	328,545,964.42	58.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,751,053.66	0.85
E	建筑业	32,084,157.18	5.71
F	批发和零售业	28,606,815.60	5.09
G	交通运输、仓储和邮政业	9,426,204.68	1.68
H	住宿和餐饮业	75,438.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,713,029.11	5.11
J	金融业	42,523,247.40	7.56
K	房地产业	3,290,926.12	0.59
L	租赁和商务服务业	2,560,551.29	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,610,065.87	3.84
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	3,223,144.21	0.57
S	综合	-	-
	合计	515,605,583.54	91.72

8.2.2 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。

8.3 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	002142	宁波银行	1,505,258	25,047,493.12	4.46
2	600887	伊利股份	932,821	16,417,649.60	2.92
3	000625	长安汽车	924,100	13,806,054.00	2.46
4	600487	亨通光电	722,424	13,480,431.84	2.40
5	000651	格力电器	503,100	12,386,322.00	2.20

6	000963	华东医药	163,280	11,767,589.60	2.09
7	000488	晨鸣纸业	1,128,732	11,693,663.52	2.08
8	002573	清新环境	639,393	11,170,195.71	1.99
9	600566	济川药业	340,914	10,656,971.64	1.90
10	300070	碧水源	595,883	10,439,870.16	1.86
11	000501	鄂武商 A	534,300	10,429,536.00	1.86
12	600816	安信信托	420,400	9,929,848.00	1.77
13	600519	贵州茅台	28,984	9,685,003.60	1.72
14	601088	中国神华	595,000	9,627,100.00	1.71
15	002271	东方雨虹	441,020	9,565,723.80	1.70
16	600104	上汽集团	407,900	9,565,255.00	1.70
17	002415	海康威视	393,683	9,373,592.23	1.67
18	002217	合力泰	509,100	9,112,890.00	1.62
19	002078	太阳纸业	1,308,500	8,740,780.00	1.55
20	002466	天齐锂业	253,100	8,213,095.00	1.46
21	600585	海螺水泥	462,873	7,850,326.08	1.40
22	300287	飞利信	638,700	7,600,530.00	1.35
23	300182	捷成股份	605,579	6,243,519.49	1.11
24	002372	伟星新材	402,419	6,209,325.17	1.10
25	603306	华懋科技	170,072	6,188,920.08	1.10
26	002002	鸿达兴业	814,575	5,978,980.50	1.06
27	600170	上海建工	1,186,500	5,612,145.00	1.00
28	002310	东方园林	393,000	5,560,950.00	0.99
29	002019	亿帆医药	347,700	5,316,333.00	0.95
30	002304	洋河股份	72,774	5,137,844.40	0.91
31	002450	康得新	263,194	5,029,637.34	0.89
32	601179	中国西电	895,100	4,994,658.00	0.89
33	600298	安琪酵母	278,816	4,968,501.12	0.88
34	002354	天神娱乐	71,000	4,910,360.00	0.87
35	002083	孚日股份	684,700	4,840,829.00	0.86
36	002589	瑞康医药	147,400	4,783,130.00	0.85
37	002203	海亮股份	582,800	4,697,368.00	0.84
38	002705	新宝股份	277,520	4,692,863.20	0.83
39	300017	网宿科技	84,998	4,556,742.78	0.81
40	000910	大亚圣象	234,546	4,479,828.60	0.80
41	600183	生益科技	402,706	4,429,766.00	0.79
42	002508	老板电器	119,918	4,412,982.40	0.79
43	600312	平高电气	279,961	4,372,990.82	0.78
44	002074	国轩高科	140,372	4,350,128.28	0.77

45	000895	双汇发展	202,699	4,242,490.07	0.75
46	600309	万华化学	193,803	4,172,578.59	0.74
47	600350	山东高速	633,900	4,107,672.00	0.73
48	000703	恒逸石化	265,100	3,984,453.00	0.71
49	300197	铁汉生态	310,200	3,933,336.00	0.70
50	600068	葛洲坝	426,911	3,923,312.09	0.70
51	000587	金洲慈航	249,800	3,717,024.00	0.66
52	300296	利亚德	107,200	3,614,784.00	0.64
53	600079	人福医药	176,400	3,519,180.00	0.63
54	000498	山东路桥	437,000	3,465,410.00	0.62
55	002202	金风科技	199,527	3,413,906.97	0.61
56	002597	金禾实业	215,600	3,369,828.00	0.60
57	601668	中国建筑	338,268	2,997,054.48	0.53
58	601328	交通银行	514,000	2,965,780.00	0.53
59	300072	三聚环保	62,600	2,897,754.00	0.52
60	002051	中工国际	121,340	2,781,112.80	0.49
61	601012	隆基股份	204,300	2,735,577.00	0.49
62	600660	福耀玻璃	146,400	2,727,432.00	0.49
63	002460	赣锋锂业	101,500	2,690,765.00	0.48
64	000338	潍柴动力	259,200	2,581,632.00	0.46
65	600373	中文传媒	123,500	2,494,700.00	0.44
66	600276	恒瑞医药	52,180	2,374,190.00	0.42
67	300040	九洲电气	199,800	2,289,708.00	0.41
68	002108	沧州明珠	112,182	2,285,147.34	0.41
69	601009	南京银行	207,045	2,244,367.80	0.40
70	000429	粤高速 A	320,000	2,188,800.00	0.39
71	000858	五粮液	63,072	2,174,722.56	0.39
72	600323	瀚蓝环境	147,000	2,110,920.00	0.38
73	002464	金利科技	26,200	2,048,840.00	0.36
74	002050	三花智控	184,600	2,037,984.00	0.36
75	601139	深圳燃气	207,800	1,888,902.00	0.34
76	002594	比亚迪	36,400	1,808,352.00	0.32
77	000786	北新建材	171,900	1,768,851.00	0.31
78	002247	帝龙文化	89,500	1,619,055.00	0.29
79	002600	江粉磁材	157,800	1,615,872.00	0.29
80	002053	云南能投	83,700	1,606,203.00	0.29
81	600036	招商银行	90,500	1,592,800.00	0.28
82	300262	巴安水务	85,500	1,453,500.00	0.26
83	600438	通威股份	216,800	1,381,016.00	0.25

84	300121	阳谷华泰	75,000	1,367,250.00	0.24
85	600325	华发股份	105,676	1,352,652.80	0.24
86	600056	中国医药	70,500	1,341,615.00	0.24
87	600273	嘉化能源	133,805	1,285,866.05	0.23
88	300269	联建光电	53,999	1,248,456.88	0.22
89	600297	广汇汽车	144,200	1,234,352.00	0.22
90	000967	盈峰环境	84,500	1,181,310.00	0.21
91	600873	梅花生物	176,600	1,151,432.00	0.20
92	601107	四川成渝	221,900	1,122,814.00	0.20
93	002624	完美世界	37,600	1,120,104.00	0.20
94	600074	保千里	84,000	1,112,160.00	0.20
95	002426	胜利精密	132,000	1,091,640.00	0.19
96	300115	长盈精密	41,200	1,073,672.00	0.19
97	600548	深高速	125,300	1,065,050.00	0.19
98	000921	海信科龙	103,700	1,058,777.00	0.19
99	600196	复星医药	45,200	1,045,928.00	0.19
100	002768	国恩股份	40,000	993,600.00	0.18
101	002411	必康股份	36,276	981,265.80	0.17
102	000059	华锦股份	82,000	975,800.00	0.17
103	600340	华夏幸福	40,564	969,479.60	0.17
104	002563	森马服饰	93,533	960,583.91	0.17
105	000726	鲁 泰 A	73,800	945,378.00	0.17
106	300267	尔康制药	70,300	917,415.00	0.16
107	002531	天顺风能	131,207	902,704.16	0.16
108	600066	宇通客车	44,140	864,702.60	0.15
109	002311	海大集团	56,200	845,810.00	0.15
110	300237	美晨科技	48,127	802,758.36	0.14
111	002179	中航光电	21,900	794,751.00	0.14
112	300145	中金环境	30,000	783,000.00	0.14
113	600037	歌华有线	50,456	772,985.92	0.14
114	600757	长江传媒	82,491	685,500.21	0.12
115	000065	北方国际	24,968	676,632.80	0.12
116	600376	首开股份	49,862	588,870.22	0.10
117	600522	中天科技	55,300	582,309.00	0.10
118	600093	禾嘉股份	39,700	575,650.00	0.10
119	000900	现代投资	70,700	570,549.00	0.10
120	002020	京新药业	49,151	556,389.32	0.10
121	300199	翰宇药业	29,000	521,420.00	0.09
122	002027	分众传媒	35,200	502,304.00	0.09

123	600000	浦发银行	27,288	442,338.48	0.08
124	300476	胜宏科技	17,200	393,020.00	0.07
125	000813	德展健康	25,200	363,636.00	0.06
126	002092	中泰化学	30,000	363,000.00	0.06
127	601390	中国中铁	40,900	362,374.00	0.06
128	601633	长城汽车	32,500	359,450.00	0.06
129	000623	吉林敖东	11,300	350,187.00	0.06
130	002555	三七互娱	21,000	344,400.00	0.06
131	002100	天康生物	36,700	329,199.00	0.06
132	600681	百川能源	19,500	308,880.00	0.05
133	002615	哈尔斯	17,500	307,125.00	0.05
134	002504	弘高创意	38,800	306,908.00	0.05
135	600172	黄河旋风	16,100	287,868.00	0.05
136	300033	同花顺	4,132	284,198.96	0.05
137	603589	口子窖	8,635	277,442.55	0.05
138	002042	华孚色纺	22,930	262,777.80	0.05
139	600226	升华拜克	25,100	262,295.00	0.05
140	000333	美的集团	9,100	256,347.00	0.05
141	600518	康美药业	14,300	255,255.00	0.05
142	002726	龙大肉食	13,900	242,277.00	0.04
143	600986	科达股份	15,700	239,268.00	0.04
144	300194	福安药业	9,000	236,700.00	0.04
145	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.04
146	002400	省广股份	16,979	234,140.41	0.04
147	603355	莱克电气	5,000	230,850.00	0.04
148	600261	阳光照明	30,300	218,766.00	0.04
149	600856	中天能源	15,600	215,280.00	0.04
150	002554	惠博普	25,000	204,250.00	0.04
151	603128	华贸物流	20,100	201,000.00	0.04
152	000537	广宇发展	21,500	195,220.00	0.03
153	300158	振东制药	9,900	193,842.00	0.03
154	002394	联发股份	10,900	192,712.00	0.03
155	000883	湖北能源	41,300	189,154.00	0.03
156	603766	隆鑫通用	9,100	189,098.00	0.03
157	300315	掌趣科技	19,599	181,094.76	0.03
158	002419	天虹商场	11,600	174,232.00	0.03
159	002275	桂林三金	9,300	170,841.00	0.03
160	000063	中兴通讯	10,301	164,300.95	0.03
161	600418	江淮汽车	14,200	164,152.00	0.03

162	600075	新疆天业	12,700	157,988.00	0.03
163	000915	山大华特	3,700	155,881.00	0.03
164	601689	拓普集团	5,100	150,042.00	0.03
165	600197	伊力特	10,034	145,392.66	0.03
166	603611	诺力股份	3,800	145,084.00	0.03
167	603609	禾丰牧业	10,567	136,631.31	0.02
168	600699	均胜电子	4,100	135,669.00	0.02
169	601965	中国汽研	12,500	133,125.00	0.02
170	300136	信维通信	4,600	131,100.00	0.02
171	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.02
172	600755	厦门国贸	14,900	122,180.00	0.02
173	601000	唐山港	28,500	114,285.00	0.02
174	601186	中国铁建	9,400	112,424.00	0.02
175	002385	大北农	15,072	107,011.20	0.02
176	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
177	600779	水井坊	5,500	105,105.00	0.02
178	000055	方大集团	7,700	104,951.00	0.02
179	000887	中鼎股份	4,000	103,760.00	0.02
180	601169	北京银行	10,600	103,456.00	0.02
181	600973	宝胜股份	12,300	99,015.00	0.02
182	002356	赫美集团	3,900	94,380.00	0.02
183	000401	冀东水泥	7,800	92,820.00	0.02
184	600664	哈药股份	10,700	91,806.00	0.02
185	300203	聚光科技	3,000	91,650.00	0.02
186	601166	兴业银行	5,600	90,384.00	0.02
187	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
188	601058	赛轮金宇	21,100	85,877.00	0.02
189	600406	国电南瑞	4,900	81,487.00	0.01
190	002035	华帝股份	3,100	80,445.00	0.01
191	600176	中国巨石	7,846	77,204.64	0.01
192	600258	首旅酒店	3,300	75,438.00	0.01
193	002080	中材科技	4,300	75,336.00	0.01
194	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
195	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
196	300219	鸿利智汇	6,333	68,713.05	0.01
197	002146	荣盛发展	8,700	68,295.00	0.01
198	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
199	601155	新城控股	5,710	67,092.50	0.01
200	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01

201	300113	顺网科技	2,300	61,847.00	0.01
202	002511	中顺洁柔	3,100	61,690.00	0.01
203	601233	桐昆股份	3,900	56,004.00	0.01
204	002322	理工环科	2,300	54,878.00	0.01
205	002709	天赐材料	1,300	54,821.00	0.01
206	600211	西藏药业	1,000	54,140.00	0.01
207	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
208	002138	顺络电子	3,043	52,674.33	0.01
209	603997	继峰股份	2,600	50,856.00	0.01
210	603368	柳州医药	600	48,366.00	0.01
211	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
212	600060	海信电器	2,800	47,936.00	0.01
213	601216	君正集团	10,200	47,430.00	0.01
213	600327	大东方	5,100	47,430.00	0.01
214	600368	五洲交通	8,200	46,576.00	0.01
215	300251	光线传媒	4,400	42,944.00	0.01
216	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
217	002081	金螳螂	4,300	42,097.00	0.01
218	300138	晨光生物	2,300	41,929.00	0.01
219	300048	合康新能	5,100	41,922.00	0.01
220	600703	三安光电	2,967	39,728.13	0.01
221	600039	四川路桥	8,133	38,550.42	0.01
222	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
223	002366	台海核电	700	37,534.00	0.01
224	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
225	603886	元祖股份	1,724	30,514.80	0.01
226	600048	保利地产	3,200	29,216.00	0.01
227	603228	景旺电子	1,257	29,112.12	0.01
228	002507	涪陵榨菜	2,100	28,098.00	0.00
229	000541	佛山照明	2,700	26,568.00	0.00
230	000889	茂业通信	1,700	25,959.00	0.00
231	002171	楚江新材	1,600	25,360.00	0.00
232	300043	星辉娱乐	2,500	25,350.00	0.00
233	600388	龙净环保	2,039	25,222.43	0.00
234	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
235	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
236	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
237	603239	浙江仙通	686	21,574.70	0.00
238	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00

239	600064	南京高科	1,200	20,100.00	0.00
240	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
241	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
242	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
243	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
244	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
245	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
246	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
247	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
248	000825	太钢不锈	400	1,576.00	0.00
249	002043	兔宝宝	34	393.38	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	24,527,274.24	25.71
2	600887	伊利股份	17,101,817.99	17.92
3	000625	长安汽车	14,790,967.00	15.50
4	600487	亨通光电	12,578,391.00	13.18
5	000651	格力电器	12,103,991.00	12.69
6	000963	华东医药	11,286,821.34	11.83
7	000488	晨鸣纸业	11,075,383.28	11.61
8	000501	鄂武商A	10,717,609.06	11.23
9	002573	清新环境	10,652,667.39	11.17
10	300070	碧水源	10,509,994.41	11.02
11	002415	海康威视	9,971,833.00	10.45
12	002271	东方雨虹	9,937,605.25	10.42
13	600566	济川药业	9,901,873.00	10.38
14	601088	中国神华	9,702,615.00	10.17
15	600104	上汽集团	9,575,470.80	10.04
16	600816	安信信托	9,483,268.00	9.94
17	002466	天齐锂业	9,245,781.20	9.69
18	002217	合力泰	8,870,472.00	9.30
19	002078	太阳纸业	8,784,674.00	9.21

20	600519	贵州茅台	8,437,549.00	8.84
21	600585	海螺水泥	8,143,744.00	8.54
22	300287	飞利信	7,987,992.00	8.37
23	300182	捷成股份	7,247,263.17	7.60
24	002202	金风科技	6,942,820.84	7.28
25	603306	华懋科技	6,094,157.50	6.39
26	002002	鸿达兴业	6,010,321.72	6.30
27	601179	中国西电	5,737,420.00	6.01
28	600170	上海建工	5,736,895.46	6.01
29	002019	亿帆医药	5,501,224.00	5.77
30	002310	东方园林	5,499,877.00	5.76
31	002083	孚日股份	5,411,775.51	5.67
32	002372	伟星新材	5,334,265.33	5.59
33	002354	天神娱乐	5,300,018.00	5.55
34	002304	洋河股份	5,032,103.23	5.27
35	600298	安琪酵母	4,951,781.98	5.19
36	002705	新宝股份	4,946,596.00	5.18
37	002589	瑞康医药	4,836,635.80	5.07
38	002203	海亮股份	4,821,347.97	5.05
39	002074	国轩高科	4,628,682.00	4.85
40	300017	网宿科技	4,503,078.00	4.72
41	600183	生益科技	4,453,417.00	4.67
42	002450	康得新	4,406,685.84	4.62
43	002311	海大集团	4,369,531.00	4.58
44	600309	万华化学	4,162,693.21	4.36
45	000895	双汇发展	4,123,810.00	4.32
46	600350	山东高速	4,048,683.00	4.24
47	002508	老板电器	4,013,602.00	4.21
48	600068	葛洲坝	3,910,574.00	4.10
49	300296	利亚德	3,910,442.72	4.10
50	300197	铁汉生态	3,883,722.00	4.07
51	000587	金洲慈航	3,877,961.21	4.06
52	000910	大亚圣象	3,862,153.00	4.05
53	600312	平高电气	3,860,581.50	4.05
54	000703	恒逸石化	3,751,881.00	3.93
55	600079	人福医药	3,518,170.26	3.69

56	000498	山东路桥	3,514,241.00	3.68
57	002597	金禾实业	3,310,322.72	3.47
58	002051	中工国际	3,176,598.48	3.33
59	601328	交通银行	2,957,939.00	3.10
60	002460	赣锋锂业	2,956,885.00	3.10
61	600660	福耀玻璃	2,905,419.00	3.05
62	601012	隆基股份	2,781,682.00	2.92
63	002411	必康股份	2,758,559.64	2.89
64	600373	中文传媒	2,684,077.05	2.81
65	000338	潍柴动力	2,557,604.00	2.68
66	601668	中国建筑	2,457,747.00	2.58
67	002108	沧州明珠	2,425,517.33	2.54
68	600276	恒瑞医药	2,310,265.00	2.42
69	300040	九洲电气	2,240,119.00	2.35
70	000858	五 粮 液	2,150,786.00	2.25
71	600323	瀚蓝环境	2,128,615.00	2.23
72	000429	粤高速 A	2,090,711.00	2.19
73	002594	比亚迪	2,037,371.00	2.14
74	002050	三花智控	2,020,133.00	2.12
75	601139	深圳燃气	1,993,691.00	2.09
76	002464	金利科技	1,989,604.00	2.09
77	600036	招商银行	1,919,825.00	2.01

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（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002202	金风科技	5,785,782.29	6.06
2	601318	中国平安	4,583,587.79	4.80
3	002311	海大集团	3,608,951.57	3.78
4	000423	东阿阿胶	2,799,361.37	2.93
5	002411	必康股份	2,689,229.07	2.82
6	002437	誉衡药业	2,606,716.92	2.73

7	002032	苏 泊 尔	2,528,988.77	2.65
8	600004	白云机场	2,450,802.58	2.57
9	600422	昆药集团	2,409,071.17	2.52
10	600398	海澜之家	2,251,012.22	2.36
11	002415	海康威视	2,221,833.82	2.33
12	300274	阳光电源	2,167,446.69	2.27
13	600066	宇通客车	2,131,344.72	2.23
14	002516	旷达科技	2,018,905.26	2.12
15	300118	东方日升	1,957,202.69	2.05
16	000063	中兴通讯	1,946,228.54	2.04
17	002475	立讯精密	1,759,886.70	1.84
18	000418	小天鹅 A	1,673,340.10	1.75
19	600686	金龙汽车	1,605,772.68	1.68
20	002630	华西能源	1,564,682.18	1.64

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	568,841,205.26
卖出股票收入（成交）总额	134,675,728.26

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,613,279.70	2.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,613,279.70	2.42

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019539	16 国债 11	136,310	13,613,279.70	2.42

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库，本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	44,824.74
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	220,966.90
5	应收申购款	394,617.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	660,409.12

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,998	44,434.42	223,018,931.78	83.68%	43,498,693.87	16.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,203,466.59	0.8268%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月21日）基金份额总额	200,991,230.33
本报告期期初基金份额总额	49,082,588.85
本报告期基金总申购份额	284,732,014.12
减:本报告期基金总赎回份额	67,296,977.32
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	266,517,625.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年，本报告期应支付的报酬为人民币 50,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	328,116,143.59	46.80%	233,388.56	46.80%	-
五矿证券	2	177,582,863.66	25.33%	126,314.85	25.33%	-
国泰君安	2	110,281,062.39	15.73%	78,443.22	15.73%	-
民生证券	1	50,506,805.92	7.20%	35,925.74	7.20%	-
安信证券	2	34,624,414.17	4.94%	24,628.42	4.94%	-
申银万国	2	-	-	-	-	-

西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	6,848,028.50	48.75%	88,400,000.00	85.66%	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	5,999,582.80	42.71%	-	-	-	-
民生证券	1,199,460.40	8.54%	14,800,000.00	14.34%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	安信价值精选股票型证券投资基金 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的公告	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	安信基金管理有限责任公司关于	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 18 日

	旗下基金所持科大讯飞(002230)估值调整的公告	券报、证券时报	
11	关于新增销售服务机构为我司旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 21 日
12	安信价值精选股票型证券投资基金 2015 年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	安信价值精选股票型证券投资基金 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
18	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
19	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
20	关于安信基金管理有限责任公司	上海证券报、中国证券	2016 年 5 月 11 日

	新增开放式基金销售代理服务机构的公告	券报、证券时报	
21	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
22	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
23	安信价值精选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 24 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
27	安信基金管理有限责任公司关于安信价值精选股票型证券投资基金参加安信证券股份有限公司基金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 7 月 1 日
28	安信基金管理有限责任公司关于上海陆金所资产管理有限公司公司名称的更正公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 1 日
29	安信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泰信财富投资管理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 7 月 12 日
30	关于安信基金管理有限责任公司	上海证券报、中国证券	2016 年 7 月 15 日

	新增开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告（第一创业）	券报、证券时报	
31	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 7 月 15 日
32	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告（珠海盈米）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日
33	安信价值精选股票型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 7 月 20 日
34	安信基金管理有限责任公司关于旗下西藏城投估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 8 月 9 日
35	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 8 月 12 日
36	安信价值精选股票型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 8 月 25 日
37	安信基金关于调整旗下基金申购与赎回数额限制以及最低持有份额的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 8 月 29 日
38	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 9 月 28 日
39	安信价值精选股票型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 10 月 24 日
40	安信基金管理有限责任公司关于旗下常宝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 10 月 25 日
41	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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 10 月 25 日

	变更的公告		
42	安信基金管理有限责任公司关于新增中国中投证券有限责任公司为安信价值精选灵活配置混合型证券投资基金的销售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 10 月 26 日
43	安信基金管理有限责任公司新平台上线的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 10 月 28 日
44	关于新增销售服务机构为我司旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 11 月 11 日
45	安信基金管理有限责任公司关于开通电子直销交易平台汇款交易业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 11 月 25 日
46	安信价值精选、消费医药股票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 11 月 30 日
47	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 11 月 30 日
48	安信价值精选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 2 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 5 日
49	安信基金管理有限责任公司关于旗下安洁科技估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 13 日
50	关于安信基金管理有限责任公司参加代销机构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 12 月 14 日
51	关于修改安信价值精选股票型证	上海证券报、中国证	2016 年 12 月 20 日

	券投资基金托管协议的公告	券报、证券时报	
52	关于新增销售服务机构为我司旗下基金代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 29 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信价值精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信价值精选股票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。

12.2 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

12.3 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
2017 年 3 月 27 日