

# 安信中证一带一路主题指数分级证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金		
基金简称	安信一带一路分级		
场内简称	一带分级		
基金主代码	167503		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日		
基金管理人	安信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1, 574, 656, 642. 60 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 5 月 22 日		
下属分级基金的基金简称	一带一 A	一带一 B	一带分级
下属分级基金的交易代码	150275	150276	167503
报告期末下属分级基金份额总额	648, 019, 321. 00 份	648, 019, 321. 00 份	278, 618, 000. 60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0. 35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	股票投资上，本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整；债券投资

	<p>上，本基金将以宏观形势及利率分析为基础，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价；权证投资上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，谨慎进行权证投资；资产支持证券投资方面，综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。</p>		
业绩比较基准	<p>中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%</p>		
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p>		
下属分级基金的风险收益特征	<p>安信一带一路 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。</p>	<p>安信一带一路 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。</p>	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p>

### 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	招商证券股份有限公司

	司		
信息披露负责人	姓名	乔江晖	郭杰
	联系电话	0755-82509999	0755-82943666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	4008-088-088	95565	
传真	0755-82799292	0755-82960794	
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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层	
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层	
邮政编码	518026	518026	
法定代表人	刘入领	霍达	

## 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	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-38,499,820.10
本期利润	-49,118,238.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0291
本期加权平均净值利润率	-3.62%
本期基金份额净值增长率	1.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-1,216,559,470.66
期末可供分配基金份额利润	-0.7726
期末基金资产净值	1,244,569,469.44
期末基金份额净值	0.790
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-48.01%

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	份额净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.81%	0.67%	4.05%	0.65%	-0.24%	0.02%

过去三个月	-4.93%	1.00%	-4.48%	1.02%	-0.45%	-0.02%
过去六个月	1.94%	0.88%	3.04%	0.91%	-1.10%	-0.03%
过去一年	16.77%	0.93%	19.18%	0.95%	-2.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-48.01%	2.12%	-36.95%	2.15%	-11.06%	-0.03%

### 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



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 34 只开放式基金，具体如下：从 2012 年 6 月 20 日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2012 年 9 月 25 日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从 2012 年 12 月 18 日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从 2013 年 2 月 5 日起管理安信现金管理货币市场基金；从 2013 年 7 月 24 日起管理安信宝利债券型证券投资基金(LOF)(原安信宝利分级债券型证券投资基金)；从 2013 年 11 月 8 日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从 2013 年 12 月 31 日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2014 年 4 月 21 日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从 2014 年 11 月 24 日起管理安信现金增利货币市场基金；从 2015 年 3 月 19 日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从 2015 年 4 月 15 日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 14 日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从 2015 年 5 月 20 日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 25 日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 6 月 5 日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日起管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日起管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年

10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 1 月 13 日起管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
龙川	本基金的基金经理、量化投资部总经理	2015 年 5 月 14 日	-	15	龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理	2015 年 11 月 9 日	-	4	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产

	助理			管理有限公司量化投资部研究员、安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理助理。现任安信中证一带一路指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式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

回顾 2017 年上半年，大盘总体运行平稳，但在结构上明显分化。以金融、家电为代表的蓝筹股一路上涨，反观中小盘题材股则走势疲软。截至 6 月 30 日收盘，上证综指、深证综指沪深 300、和创业板指数分别上涨 2.86%、-3.63%、10.78%和-7.34%。

安信一带一路分级基金 2017 年上半年涨幅为 1.94%，本基金采取完全复制指数的被动式指数管理策略，量化及人工管理相结合的投资方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。在报告期内，本基金未遇到大额申购赎回事件，较好地将跟踪误差以及日均跟踪偏离度控制在合理水平以内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.790 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.94%，业绩比较基准收益率为 3.04%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，“一带一路”建设全面提速，步入快车道，沿线贸易形势稳中有进，未来“一带一路”加速落地，出口占比较高的中游行业和“一带一路”贸易依存度较高区域或将受益。。从行业上看，我国对“一带一路”沿线国家出口主要集中在机电、纺织服装、基础金属、化工产品，以及交通运输设备等领域。从区域上看，西部地区与“一带一路”国家贸易依存度较高。当前无论是从国内环境，还是从国际形势来看，“一带一路”都处在加速推进期，伴随着未来“一带一路”战略进一步走向纵深，将会有更多国家和地区加入到与中国的经贸合作中来，对于逐步走向国门的中国企业而言，也意味着未来存在更多机遇。

安信中证一带一路分级基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将保持完全复制指数的被动式指数管理策略，力争使基金表现与指数收益尽量相似，使投资者充分分享一带一路

板块的长期收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证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。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经历。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	79,851,211.81	115,808,712.43
结算备付金		635,630.54	1,893,895.96
存出保证金		1,687,610.75	793,565.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,160,816,414.05	884,728,708.87
其中：股票投资		1,160,816,414.05	884,728,708.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		16,226,951.19	-
应收利息	6.4.7.5	39,925.92	35,812.49
应收股利		-	-
应收申购款		648,741.44	29,294,729.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	755.66	755.66
资产总计		1,259,907,241.36	1,032,556,180.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	40,635,933.11
应付赎回款		12,616,514.88	841,652.48
应付管理人报酬		1,078,580.96	792,476.57
应付托管费		215,716.18	158,495.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	984,250.22	604,964.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	442,709.68	434,625.22
负债合计		15,337,771.92	43,468,146.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,369,406,042.36	1,920,593,092.63
未分配利润	6.4.7.10	-1,124,836,572.92	-931,505,059.22
所有者权益合计		1,244,569,469.44	989,088,033.41
负债和所有者权益总计		1,259,907,241.36	1,032,556,180.16

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.790 元，基金份额总额 1,574,656,642.60 份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-37,713,838.71	-166,935,932.89
1.利息收入		973,121.56	357,044.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	973,121.56	357,044.45
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,539,447.43	-89,851,314.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-35,584,091.66	-93,617,013.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	6,044,644.23	3,765,698.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-10,618,418.73	-77,615,651.29
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	1,470,905.89	173,988.12
<b>减：二、费用</b>		11,404,400.12	4,705,330.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,698,170.05	2,892,595.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,339,634.01	578,519.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,957,853.47	945,256.25

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	408,742.59	288,959.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,118,238.83	-171,641,262.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,118,238.83	-171,641,262.93

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,920,593,092.63	-931,505,059.22	989,088,033.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-49,118,238.83	-49,118,238.83
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）	448,812,949.73	-144,213,274.87	304,599,674.86
其中：1.基金申购款	2,691,917,492.39	-1,209,593,111.23	1,482,324,381.16
2.基金赎回款	-2,243,104,542.66	1,065,379,836.36	-1,177,724,706.30
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）	2,369,406,042.36	-1,124,836,572.92	1,244,569,469.44
项目	上年度可比期间		
	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）	1,237,802,868.13	-511,665,873.82	726,136,994.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-171,641,262.93	-171,641,262.93
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）	228,957,347.28	-124,873,985.18	104,083,362.10
其中：1.基金申购款	531,871,438.97	-288,174,426.65	243,697,012.32
2.基金赎回款	-302,914,091.69	163,300,441.47	-139,613,650.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,466,760,215.41	-808,181,121.93	658,579,093.48

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：

\_\_\_\_\_  
刘入领  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
范瑛  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
尚尔航  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（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 4 月 29 日下发的证监许可[2015]770 号文《关于核准安信中证一带一路主题指数分级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《安信中证一带一路主题指数分级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 5 月 11 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\_H41 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 400,830,234.86 元。经向中国证监会备案，《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 14 日正式生效。截至 2015 年 4 月 21 日止，安信中证一带一路主题指数分级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 400,830,234.86 元，折合 400,830,234.86 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 7,525.59 元，折合 7,525.59 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 400,837,760.45 元，折合 400,837,760.45 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据基金合同，本基金份额包括安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“安信一带一路份额”）、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“安信一带一路 A 份额”）和安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“安信一带一路 B 份额”）。

根据《安信中证一带一路主题分级证券投资基金之一带一 A 与一带一 B 基金份额上市交易公告书》，安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额于 2015 年 5 月 22 日经深圳证券交易所深证上[2015]211 号文核准上市交易。于 2015 年 5 月 22 日，安信一带一路 A 份额上市交易份额为 174,086,578 份，安信一带一路 B 份额上市交易份额为 174,086,578 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同》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，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、股指期货、权证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

中国证监会的相关规定)。本基金各类资产投资比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证一带一路指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证一带一路指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率（税后）\*5%。

#### 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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。

### 6.4.6.2 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。

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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。

### 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，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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	79,851,211.81
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	79,851,211.81

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,182,830,700.29	1,160,816,414.05	-22,014,286.24
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	1,182,830,700.29	1,160,816,414.05	-22,014,286.24

### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	38,880.42
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	286.10
应收债券利息	-
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	759.40
合计	39,925.92

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	755.66
待摊费用	-
合计	755.66

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	984,250.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	984,250.22

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	47,529.91
预提费用	314,779.21
应付指数使用费	80,400.56
合计	442,709.68

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,276,240,436.82	1,920,593,092.63
本期申购	1,789,221,340.36	2,691,917,492.39
本期赎回(以“-”号填列)	-1,490,805,134.58	-2,243,104,542.66
本期末	1,574,656,642.60	2,369,406,042.36

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-958,840,774.73	27,335,715.51	-931,505,059.22
本期利润	-38,499,820.10	-10,618,418.73	-49,118,238.83
本期基金份额交易产生的变动数	-219,218,875.83	75,005,600.96	-144,213,274.87
其中：基金申购款	-1,351,348,389.31	141,755,278.08	-1,209,593,111.23
基金赎回款	1,132,129,513.48	-66,749,677.12	1,065,379,836.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,216,559,470.66	91,722,897.74	-1,124,836,572.92

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	944,873.01
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	16,519.68
其他	11,728.87
合计	973,121.56

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,038,463,308.61
减：卖出股票成本总额	1,074,047,400.27
买卖股票差价收入	-35,584,091.66

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 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
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,044,644.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,044,644.23

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,618,418.73
——股票投资	-10,618,418.73
——债券投资	-
——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	-10,618,418.73
----	----------------

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	1,470,905.89
合计	1,470,905.89

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,957,853.47
银行间市场交易费用	-
合计	2,957,853.47

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
其他	60,000.00
指数使用费	133,963.38
上市费	26,341.92
合计	408,742.59

### 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、基金销售机构
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：1、本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2、本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。

3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
安信证券	1,047,556,766.64	43.66%	110,821,921.92	14.48%

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	745,127.93	43.66%	558,179.00	56.71%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	78,828.28	14.48%	10,778.68	3.13%

#### 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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	6,698,170.05
其中：支付销售机构的客 户维护费	151,506.67	79,789.16

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,339,634.01	578,519.01

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费均按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均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内基金管理人均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末均未持有本基金份额。

#### 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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 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
招商证券	79,851,211.81	944,873.01	54,655,907.33	334,159.26

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按约定利率计息。

#### 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

本基金本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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
601989	中国重工	2017/5/31	重大事项	6.21	-	-	5,249,251	39,153,898.81	32,597,848.71	-
601727	上海电气	2017/6/22	重大事项	7.57	2017/7/3	7.54	3,406,449	30,823,565.83	25,786,818.93	-
601872	招商轮船	2017/5/2	重大事项	5.16	-	-	3,866,300	21,168,419.20	19,950,108.00	-
600545	新疆城建	2017/6/22	重大事项	11.96	2017/7/3	12.44	548,001	6,777,832.91	6,554,091.96	-
002606	大连电瓷	2017/3/2	重大事项	20.87	-	-	299,914	4,950,312.42	6,259,205.18	-

### 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，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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。

本基金为被动指数型基金，主要投资于标的指数成分股和备选成分股。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，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。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。

截至本期末，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 0.00%，因此本基金无重大信用风险（上年度末为 0.00%）。

### 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。本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易。期末本基金除部分停牌股票无法变现外，其余金融资产均能以合理价格及时变现。

### 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 2017 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	79,851,211.81	-	-	-	79,851,211.81
结算备付金	635,630.54	-	-	-	635,630.54
存出保证金	1,687,610.75	-	-	-	1,687,610.75
交易性金融资产	-	-	-	1,160,816,414.05	1,160,816,414.05
应收证券清算款	-	-	-	16,226,951.19	16,226,951.19
应收利息	-	-	-	39,925.92	39,925.92
应收申购款	-	-	-	648,741.44	648,741.44
其他资产	-	-	-	755.66	755.66
资产总计	82,174,453.10	-	-	1,177,732,788.26	1,259,907,241.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,616,514.88	12,616,514.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,078,580.96	1,078,580.96
应付托管费	-	-	-	215,716.18	215,716.18
应付交易费用	-	-	-	984,250.22	984,250.22
其他负债	-	-	-	442,709.68	442,709.68
负债总计	-	-	-	15,337,771.92	15,337,771.92
利率敏感度缺口	82,174,453.10	-	-	1,162,395,016.34	1,244,569,469.44
上年度末 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	115,808,712.43	-	-	-	115,808,712.43
结算备付金	1,893,895.96	-	-	-	1,893,895.96
存出保证金	793,565.41	-	-	-	793,565.41
交易性金融资产	-	-	-	884,728,708.87	884,728,708.87

应收利息	-	-	-	35,812.49	35,812.49
应收申购款	-	-	-	29,294,729.34	29,294,729.34
其他资产	-	-	-	755.66	755.66
资产总计	118,496,173.80	-	-	914,060,006.36	1,032,556,180.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	40,635,933.11	40,635,933.11
应付赎回款	-	-	-	841,652.48	841,652.48
应付管理人报酬	-	-	-	792,476.57	792,476.57
应付托管费	-	-	-	158,495.31	158,495.31
应付交易费用	-	-	-	604,964.06	604,964.06
其他负债	-	-	-	434,625.22	434,625.22
负债总计	-	-	-	43,468,146.75	43,468,146.75
利率敏感度缺口	118,496,173.80	-	-	870,591,859.61	989,088,033.41

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

截至本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（上年度末，本基金未持有交易性债券投资）。

#### 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融资产，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票、债券、资产支持证券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融资产，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。

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	1,160,816,414.05	93.27	884,728,708.87	89.45
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	1,160,816,414.05	93.27	884,728,708.87	89.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除一带一路指数以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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、一带一路指数上升 5%	66,658,886.91	42,258,749.01
	2、一带一路指数下降 5%	-66,658,886.91	-42,258,749.01

## § 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	1,160,816,414.05	92.14
	其中：股票	1,160,816,414.05	92.14
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	80,486,842.35	6.39
7	其他各项资产	18,603,984.96	1.48
8	合计	1,259,907,241.36	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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	113,896,999.45	9.15
C	制造业	542,069,703.63	43.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,498,107.24	0.20
E	建筑业	301,058,573.19	24.19

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	166,261,421.56	13.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,970,717.90	2.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,801,685.90	0.14
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	1,154,557,208.87	92.77

### 7.2.2 期末积极投资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	6,259,205.18	0.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	6,259,205.18	0.50

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	000063	中兴通讯	1,522,303	36,139,473.22	2.90
2	601668	中国建筑	3,646,999	35,302,950.32	2.84
3	601669	中国电建	4,398,289	34,834,448.88	2.80
4	600089	特变电工	3,310,216	34,194,531.28	2.75
5	601390	中国中铁	3,925,674	34,035,593.58	2.73
6	601186	中国铁建	2,823,907	33,971,601.21	2.73
7	600028	中国石化	5,711,339	33,868,240.27	2.72
8	601766	中国中车	3,343,869	33,839,954.28	2.72

9	601857	中国石油	4,355,770	33,495,871.30	2.69
10	601989	中国重工	5,249,251	32,597,848.71	2.62
11	600068	葛洲坝	2,857,885	32,122,627.40	2.58
12	000338	潍柴动力	2,227,397	29,401,640.40	2.36
13	600031	三一重工	3,599,773	29,266,154.49	2.35
14	601618	中国中冶	5,551,867	27,814,853.67	2.23
15	600406	国电南瑞	1,528,086	26,970,717.90	2.17
16	601727	上海电气	3,406,449	25,786,818.93	2.07
17	601800	中国交建	1,606,679	25,530,129.31	2.05
18	600522	中天科技	2,102,746	25,338,089.30	2.04
19	002202	金风科技	1,632,131	25,249,066.57	2.03
20	601018	宁波港	4,171,549	23,569,251.85	1.89
21	600487	亨通光电	795,183	22,304,883.15	1.79
22	600018	上港集团	3,349,402	21,235,208.68	1.71
23	000157	中联重科	4,461,355	20,031,483.95	1.61
24	601872	招商轮船	3,866,300	19,950,108.00	1.60
25	600820	隧道股份	1,929,800	19,490,980.00	1.57
26	600118	中国卫星	586,811	16,336,818.24	1.31
27	600150	中国船舶	698,586	15,976,661.82	1.28
28	002092	中泰化学	1,244,602	15,806,445.40	1.27
29	000425	徐工机械	4,075,747	15,284,051.25	1.23
30	600583	海油工程	2,401,800	14,987,232.00	1.20
31	601117	中国化学	1,986,072	13,882,643.28	1.12
32	600256	广汇能源	3,197,206	13,236,432.84	1.06
33	600528	中铁工业	896,501	12,810,999.29	1.03
34	601179	中国西电	2,129,247	11,838,613.32	0.95
35	600875	东方电气	1,233,098	11,813,078.84	0.95
36	601866	中远海发	3,229,220	11,625,192.00	0.93

37	600717	天津港	916,307	11,444,674.43	0.92
38	000400	许继电气	582,799	10,467,070.04	0.84
39	600970	中材国际	1,130,453	9,823,636.57	0.79
40	600312	平高电气	685,958	9,425,062.92	0.76
41	002051	中工国际	451,682	9,363,367.86	0.75
42	601880	大连港	3,156,360	9,342,825.60	0.75
43	600320	振华重工	1,778,840	9,214,391.20	0.74
44	600026	中远海能	1,345,833	8,922,872.79	0.72
45	300208	恒顺众昇	545,201	8,706,859.97	0.70
46	600017	日照港	1,869,300	8,411,850.00	0.68
47	300001	特锐德	489,540	8,204,690.40	0.66
48	600125	铁龙物流	894,221	8,012,220.16	0.64
49	002353	杰瑞股份	499,387	7,900,302.34	0.63
50	002266	浙富控股	1,613,761	7,875,153.68	0.63
51	000088	盐田港	739,318	7,770,232.18	0.62
52	600759	洲际油气	1,205,306	7,304,154.36	0.59
53	002047	宝鹰股份	799,076	6,904,016.64	0.55
54	000877	天山股份	535,477	6,784,493.59	0.55
55	000528	柳工	770,200	6,654,528.00	0.53
56	601808	中海油服	598,882	6,611,657.28	0.53
57	600545	新疆城建	548,001	6,554,091.96	0.53
58	600317	营口港	1,891,022	6,486,205.46	0.52
59	000777	中核科技	322,250	6,432,110.00	0.52
60	600495	晋西车轴	811,357	5,720,066.85	0.46
61	000928	中钢国际	596,231	5,640,345.26	0.45
62	000065	北方国际	223,769	5,321,226.82	0.43
63	600428	中远海特	852,458	5,302,288.76	0.43
64	300011	鼎汉技术	326,409	5,222,544.00	0.42

65	000018	神州长城	682,100	5,163,497.00	0.41
66	002307	北新路桥	284,000	5,126,200.00	0.41
67	603111	康尼机电	418,750	5,108,750.00	0.41
68	600580	卧龙电气	662,239	4,516,469.98	0.36
69	002554	惠博普	744,646	4,393,411.40	0.35
70	601002	晋亿实业	470,900	4,073,285.00	0.33
71	000582	北部湾港	354,700	4,025,845.00	0.32
72	600798	宁波海运	741,800	3,894,450.00	0.31
73	000022	深赤湾 A	128,800	3,831,800.00	0.31
74	603308	应流股份	261,930	3,787,507.80	0.30
75	601008	连云港	535,800	3,766,674.00	0.30
76	000905	厦门港务	255,511	3,336,973.66	0.27
77	603969	银龙股份	167,400	3,301,128.00	0.27
78	600279	重庆港九	432,400	2,914,376.00	0.23
79	300351	永贵电器	155,665	2,837,772.95	0.23
80	002524	光正集团	269,774	2,498,107.24	0.20
81	600368	五洲交通	417,681	2,418,372.99	0.19
82	300103	达刚路机	104,569	1,997,267.90	0.16
83	002738	中矿资源	88,753	1,801,685.90	0.14

### 7.3.2 期末积极投资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	002606	大连电瓷	299,914	6,259,205.18	0.50

### 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	601857	中国石油	43,476,004.50	4.40
2	600028	中国石化	38,724,090.78	3.92
3	601669	中国电建	38,265,845.43	3.87
4	600031	三一重工	36,985,197.50	3.74
5	601766	中国中车	36,855,451.68	3.73
6	000063	中兴通讯	36,498,039.34	3.69
7	601989	中国重工	35,281,541.00	3.57
8	600089	特变电工	34,111,052.84	3.45
9	601390	中国中铁	32,798,453.00	3.32
10	601186	中国铁建	32,404,491.58	3.28
11	601618	中国中冶	31,391,507.00	3.17
12	002202	金风科技	31,136,287.15	3.15
13	601668	中国建筑	30,221,626.00	3.06
14	600068	葛洲坝	29,711,332.49	3.00
15	000338	潍柴动力	29,300,033.26	2.96
16	601800	中国交建	28,906,645.61	2.92
17	000157	中联重科	27,776,893.00	2.81
18	600820	隧道股份	27,713,108.00	2.80
19	600522	中天科技	25,881,568.20	2.62
20	600583	海油工程	24,795,635.00	2.51
21	600150	中国船舶	24,125,586.42	2.44
22	600118	中国卫星	23,817,309.62	2.41
23	601018	宁波港	23,735,365.00	2.40
24	000425	徐工机械	21,953,678.00	2.22
25	600018	上港集团	21,116,337.74	2.13

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**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	000063	中兴通讯	42,427,015.30	4.29
2	600028	中国石化	34,531,427.00	3.49
3	600031	三一重工	34,139,343.31	3.45
4	601857	中国石油	33,595,868.03	3.40
5	601669	中国电建	31,090,257.99	3.14
6	601766	中国中车	26,960,760.64	2.73
7	600089	特变电工	26,260,159.42	2.65
8	601618	中国中冶	23,780,632.00	2.40
9	601668	中国建筑	23,334,088.00	2.36
10	002202	金风科技	22,576,393.00	2.28
11	601390	中国中铁	22,419,284.00	2.27
12	600068	葛洲坝	22,049,202.67	2.23
13	000157	中联重科	22,042,374.00	2.23
14	601186	中国铁建	21,186,374.00	2.14
15	600820	隧道股份	20,661,018.76	2.09
16	601800	中国交建	19,889,325.28	2.01
17	601106	*ST 一重	19,869,465.15	2.01
18	601989	中国重工	19,791,296.00	2.00
19	601018	宁波港	19,307,066.00	1.95
20	000425	徐工机械	18,748,736.00	1.90

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,360,753,524.18
卖出股票收入（成交）总额	1,038,463,308.61

注：买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

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

与国债期货交易。

### 7.11.2 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

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

## 7.12 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	1,687,610.75
2	应收证券清算款	16,226,951.19
3	应收股利	-
4	应收利息	39,925.92
5	应收申购款	648,741.44
6	其他应收款	755.66
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,603,984.96

### 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****7.12.5.1 期末指数投资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	601989	中国重工	32,597,848.71	2.62	重大事项

**7.12.5.2 期末积极投资前五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	002606	大连电瓷	6,259,205.18	0.50	重大事项

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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
一带一 A	1,467	441,730.96	621,526,887.00	95.91%	26,492,434.00	4.09%
一带一 B	28,635	22,630.32	116,336,160.00	17.95%	531,683,161.00	82.05%
一带分 级	12,193	22,850.65	158,453,357.10	56.87%	120,164,643.50	43.13%
合计	42,295	37,230.33	896,316,404.10	56.92%	678,340,238.50	43.08%

注：机构/个人投资者持有份额占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）。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

一带一 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国银河证券股份有限公司	95,908,744.00	14.80%
2	工银瑞信基金—招商银行—招商财 富资产管理有限公司	48,486,300.00	7.48%
3	广东君之健投资管理有限公司—君 之健翱翔稳进证券投资基金	38,690,000.00	5.97%
4	申万菱信基金—民生银行—中国民 生银行股份有限公司	27,623,079.00	4.26%

5	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	25,413,946.00	3.92%
6	深圳快快资产管理有限公司	20,633,234.00	3.18%
7	德邦基金—浙商银行—百年人寿保险—百年人寿保险股份有限公司	17,537,021.00	2.71%
8	富国基金—民生银行—中国民生银行股份有限公司	16,951,014.00	2.62%
9	民生加银基金—广州农商银行—中信证券股份有限公司	16,451,300.00	2.54%
10	富国基金—广州农商银行—民生证券股份有限公司	15,134,871.00	2.34%

一带一 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	瑞泰人寿保险有限公司-万能	46,927,900.00	7.24%
2	前海开源基金—工商银行—前海开源源远 2 号保本资产管理计划	9,588,178.00	1.48%
3	宋伟铭	8,358,315.00	1.29%
4	前海开源基金—工商银行—前海开源源远 1 号保本资产管理计划	8,308,726.00	1.28%
5	鲍秀文	7,872,300.00	1.21%
6	嘉实基金—工商银行—嘉实资本管理有限公司	7,000,000.00	1.08%
7	吕菁	6,376,105.00	0.98%
8	钱志芳	6,000,000.00	0.93%
9	前海开源基金—工商银行—前海开源源远 4 号保本资产管理计划	5,051,800.00	0.78%
10	郭启纯	4,900,000.00	0.76%

一带分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	银河资本—工商银行—银河资本资产管理 产管理有限公司	13,000,000.00	26.09%
2	上海均直资产管理有限公司—均直 孔最长强私募证券投资基金	9,000,000.00	18.06%
3	中融国际信托有限公司—中融—融金 添利单一资金信托	1,394,680.00	2.80%
4	富国基金—招商银行—富国基金招 商银行—量化对冲 4 号混合型资产	1,200,000.00	2.41%
5	韩伟	1,084,600.00	2.18%
6	江苏汇鸿汇升投资管理有限公司— 汇升稳进共盈一号私募投资基金	900,000.00	1.81%
7	李智慧	760,000.00	1.53%
8	吴郁	615,990.00	1.24%
9	中银资产—中国银行—中国银行股 份有限公司上海市分行	587,081.00	1.18%
10	邓春珍	413,852.00	0.83%

注：1. 持有人为场内持有人

2. 占上市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

### 8.3 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 持有本基金	一带一 A	-	-
	一带一 B	-	-
	一带分级	46,318.28	0.0166%
	合计	46,318.28	0.0029%

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）。

#### 8.4 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	一带一 A	0
	一带一 B	0
	一带分级	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	一带一 A	0
	一带一 B	0
	一带分级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	一带一 A	一带一 B	一带分级
基金合同生效日(2015 年 5 月 14 日) 基金份额总额	174,086,578.00	174,086,578.00	52,664,604.45
本报告期期初基金份额总额	573,764,996.00	573,764,996.00	128,710,444.82
本报告期基金总申购份额	-	-	1,789,221,340.36
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,490,805,134.58
本报告期基金拆分变动份额(份额 减少以“-”填列)	74,254,325.00	74,254,325.00	-148,508,650.00
本报告期末基金份额总额	648,019,321.00	648,019,321.00	278,618,000.60

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

		例			
国信证券	21,351,660,066.15	56.34%	961,433.01	56.34%	-
安信证券	21,047,556,766.64	43.66%	745,127.93	43.66%	-
国泰君安	2	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-

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

### 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

### 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鼎龙股份估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 14 日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下先导智能估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 17 日
3	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 21 日
4	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	2017 年 2 月 18 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下东方网力估值调整的公告	证券时报	2017 年 3 月 7 日
6	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台易购通渠道部分银行卡暂停开户及增卡业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 8 日
7	安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 15 日
8	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	2017 年 3 月 24 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中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日

10	安信基金管理有限责任公司关于临时暂停 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 13 日
11	安信基金管理有限责任公司关于恢复 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日
12	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	2017 年 4 月 18 日
13	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 22 日
14	关于安信基金管理有限责任公司实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 25 日
15	关于安信基金管理有限责任公司实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 26 日
16	关于安信基金管理有限责任公司实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 27 日
17	关于安信基金管理有限责任公司实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
18	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	2017 年 4 月 28 日
19	关于安信基金管理有限责任公司实施《深圳证券交易所分级基金业	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 29 日

	务管理指引》的风险提示公告		
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上海陆金所资产管理有限公司基金认购、申购、定投进行费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 3 日
21	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公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 18 日
22	安信基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参加武汉市伯嘉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	2017 年 5 月 25 日
23	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持国电南瑞（600406）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 2 日
24	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台增加中国民生银行股份有限公司厦门分行第三方支付业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
25	安信基金管理有限责任公司关于增加基金直销账户的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
26	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	2017 年 6 月 23 日
27	安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证一带一路主题指数分级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

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 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8月24日