

安信新常态沪港深精选股票型
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	10
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 7 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,691,534.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种投资策略，深入挖掘和把握市场投资机会，分享中国经济增长和资本市场发展的成果，力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在经济“新常态”的背景下，动态运用多种策略，实现基金资产长期稳定增值。资产配置上，基于宏观、政策及市场分析，将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间，股票投资方面，客观分析在“新常态”背景下行业景气度和发展前景、行业竞争结构和盈利模式，充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会；债券投资方面，利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合，并注重信用风险的控制；此外，本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% + 中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田 路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田 路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		刘入领	易会满

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	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田 路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	5,006,126.84
本期利润	9,676,013.66
加权平均基金份额本期利润	0.3259
本期加权平均净值利润率	31.37%
本期基金份额净值增长率	26.54%
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	7,826,582.35
期末可供分配基金份额利润	0.1923
期末基金资产净值	48,518,116.38
期末基金份额净值	1.192
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	19.20%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

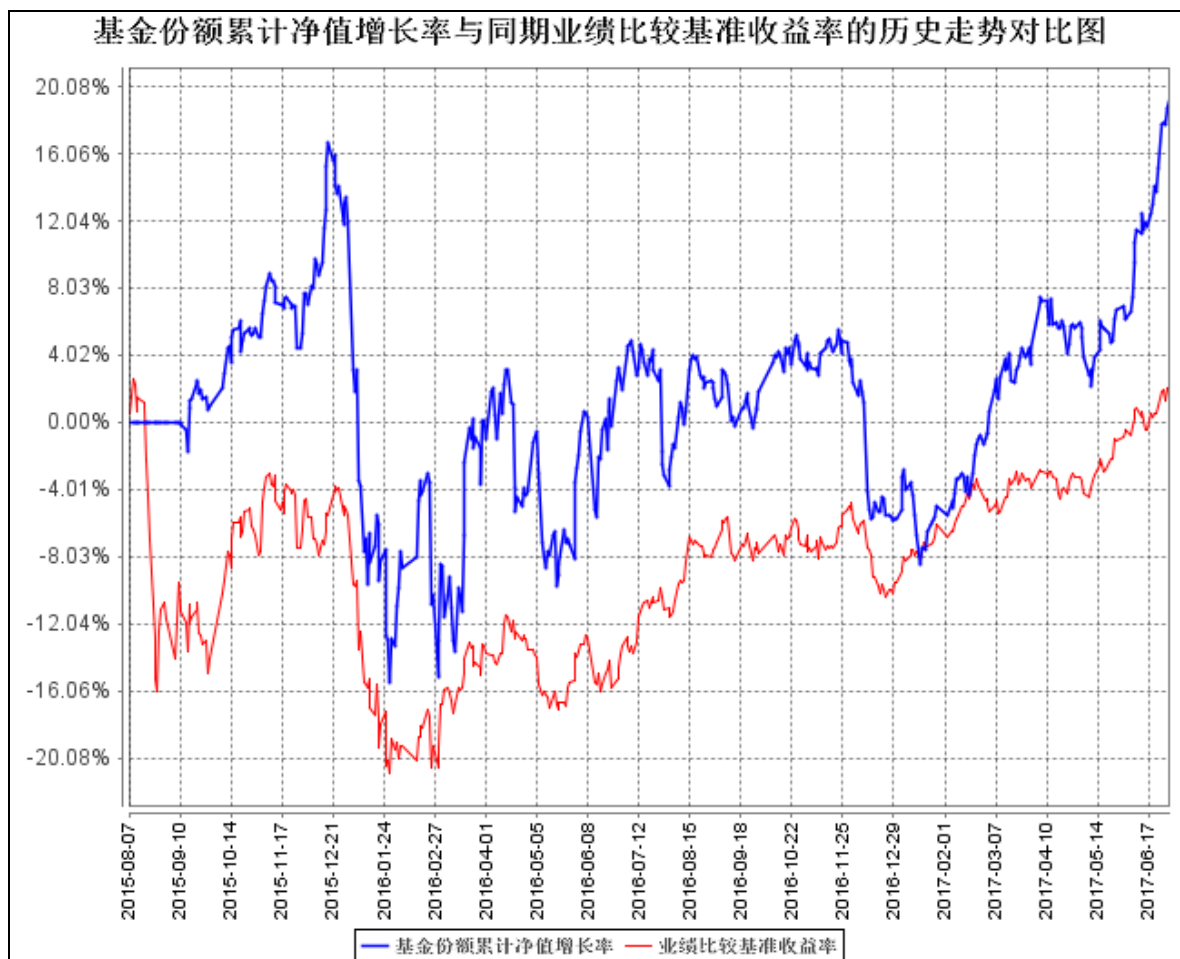
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.51%	0.77%	2.54%	0.49%	8.97%	0.28%

过去三个月	14.07%	0.84%	5.87%	0.45%	8.20%	0.39%
过去六个月	26.54%	0.83%	12.50%	0.45%	14.04%	0.38%
过去一年	16.18%	0.92%	18.13%	0.55%	-1.95%	0.37%
自基金合同 生效起至今	19.20%	1.47%	1.69%	1.05%	17.51%	0.42%

注：根据《安信新常态沪港深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：沪深 300 指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。其中沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

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 8 月 7 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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015 年 11 月 2 日	-	11	蓝雁书先生，理学硕士。历任桂林理工大学（原桂林工学院）理学院教师，华西证券有限责任公司证券研究所研究员，安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理	2016 年 4 月 11 日	-	7	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，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。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资

					基金的基金经理助理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，A 股市场整体小幅下跌，结构上继续出现分化，大盘股、消费股与优质成长股表现较好，小盘股、概念股表现依然低迷。其中白酒、家电、电子、新能源汽车、医药等行业表现相对抢眼。另外，周期股与人工智能板块在二季度末也后来居上，有较好的表现。

上半年我们的持仓还是以低估值蓝筹股为主，边际上我们增加了对周期股和成长股的配置，取得了不错的成绩。4、5 月上游商品价格出现了普遍性的调整，社会库存也被明显压缩，从而对应于二季度的经济数据较为疲软，市场预期重新变得悲观。然而，我们认为经济的真实需求并没有出现问题，房地产、基建和制造业投资都是不错的，再考虑到产业链库存去化得较为理想，以及供给侧改革依然在发挥效用等因素，我们在市场对经济周期较为悲观的二季度末逆势加大了对周期股的配置，降低了前期涨幅较大的大盘蓝筹股的配置，并取得了较好的效果。另外一方面，随着 2016 年成长股估值的调整，有不少优质个股已经具备了较强的风险收益比，在严格的选股条件下，我们加大了对这类优质成长股（尤其是人工智能板块的相关龙头）的配置，并且在上半年取得了令人满意的收益。

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 1.192 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.54%，业绩比较基准收益率为 12.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为目前国内的经济局势正在逐步明朗化，一方面，房地产调控政策不断加码再次彰显了政府对抑制房地产投机泡沫的决心，与此同时，雄安新区的规划出台，则为中国新常态下的经济发展指明了方向。国外方面，美国加息的落地可能反而是美元失去预期支撑的一个转折点，预计在未来一段时间内，美元会趋弱，人民币汇率会企稳，因此汇率问题对国内货币政策的约束力会显著降低。另外，被纳入 MSCI 将有助于强化 A 股的价值投资理念，A 股目前还是处在估值体系重塑的过程中，对应的是投资者自身理念的调整，但是受海外主要指数直接的影响将相对较小。港股目前的整体估值还是比较健康，很多 AH 股还处在大幅折价状态，相信结构性的机会依然不少，但港股受海外市场的影响会较大，这是个额外的风险需要注意。

考虑到金融去杠杆阶段性的高压期正在过去，在实体经济稳增长的主旋律下，我们认为资金面在边际上会有所宽松，利率整体还会维持在相对较低的水平，一方面原因在于目前市场上最活跃的 PPP 融资类主体项目收益率普遍较低、项目期限普遍较长，因此对资金成本的承受力非常有限，另一方面，收益率较高的房地产项目受到了国家政策的不断打压以及开发商对未来市场的谨

慎态度，使得有资金成本承受力的房地产开发商对资金的需求热情不高。

总体上，我们预计后期国内的经济会有所企稳，通胀会略有抬头，资金面会略有放松，利率会有所下降。投机性房地产在市场与政策的双重压力下会有所降温，A 股的吸引力会有所提升，市场的风险偏好会有所提升，市场风格将进一步趋于均衡。在具体投资标的上，我们认为市场风格不会很快转换，但会继续往相对均衡的方向转变，在经历了估值的持续调整后，我们坚信成长股的时间价值将会显现出来。我们将在 AH 股市场范围内，遵循最优风险收益比原则，围绕着景气度高、市场预期差较大的产业做重点布局，例如医药、人工智能、新能源汽车、中游周期、高端制造、消费电子等板块，同时关注国企改革与供给侧改革出现显著成效的传统领域。

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，本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形，时间范围为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 2 月 10 日、2017 年 2 月 22 日至 2017 年 5 月 17 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,307,834.84	3,267,609.77
结算备付金		457,829.14	207,238.25
存出保证金		41,426.59	34,418.53
交易性金融资产	6.4.7.2	44,259,369.46	21,034,381.52
其中：股票投资		44,259,369.46	21,034,381.52
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		6,559,560.72	-
应收利息	6.4.7.5	1,647.15	909.34
应收股利		-	-
应收申购款		2,105,098.92	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		61,732,766.82	24,544,557.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		12,812,168.18	9,252.09
应付管理人报酬		64,815.35	31,822.98
应付托管费		10,802.52	5,303.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	137,157.52	45,044.26
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	189,706.87	350,010.10
负债合计		13,214,650.44	441,433.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	40,691,534.03	25,594,398.57
未分配利润	6.4.7.10	7,826,582.35	-1,491,274.39
所有者权益合计		48,518,116.38	24,103,124.18
负债和所有者权益总计		61,732,766.82	24,544,557.41

注：截至本报告期末，基金份额净值 1.192 元，基金份额总额 40,691,534.03 份。

6.2 利润表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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	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

一、收入		10,444,899.50	-993,908.94
1.利息收入		20,571.06	29,202.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,571.06	29,202.82
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）		5,338,846.08	-2,478,515.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,996,093.72	-2,558,963.16
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	342,752.36	80,447.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,669,886.82	1,206,681.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	415,595.54	248,722.84
减：二、费用		768,885.84	970,670.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	226,412.98	280,301.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,735.50	46,716.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	419,548.09	460,511.15
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	85,189.27	183,141.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,676,013.66	-1,964,579.89

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,676,013.66	-1,964,579.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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）	25,594,398.57	-1,491,274.39	24,103,124.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,676,013.66	9,676,013.66
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）	15,097,135.46	-358,156.92	14,738,978.54
其中：1.基金申购款	75,115,566.11	2,301,765.74	77,417,331.85
2.基金赎回款	-60,018,430.65	-2,659,922.66	-62,678,353.31
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）	40,691,534.03	7,826,582.35	48,518,116.38
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）	32,513,371.87	3,885,459.47	36,398,831.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,964,579.89	-1,964,579.89
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）	83,507.97	-1,082,798.44	-999,290.47
其中：1.基金申购款	52,073,635.42	-3,245,523.92	48,828,111.50
2.基金赎回款	-51,990,127.45	2,162,725.48	-49,827,401.97
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）	32,596,879.84	838,081.14	33,434,960.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信新常态沪港深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”）2015年6月15日下发的证监许可[2015]1248号文《关于核准安信新常态沪港深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《安信新常态沪港深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2015年7月2日至2015年8月3日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2015)验字60962175_H87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224,675,782.53元。经向中国证监会备案，《安信新常态沪港深精

选股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 7 日正式生效。截至 2015 年 8 月 7 日止，安信新常态沪港深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 224,675,782.53 元，折合 224,675,782.53 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 47,579.66 元，折合 47,579.66 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 224,723,362.19 元，折合 224,723,362.19 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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）、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具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相关规定）。本基金各类资产投资比例为：本基金股票投资比例为基金资产的 80%-95%（其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的 0-95%），基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，本基金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：沪深 300 指数收益率*45%+恒生指数收益率*45%+中证全债指数收益率*10%。

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

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

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	8,307,834.84
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,307,834.84

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	41,436,278.27	44,259,369.46	2,823,091.19
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		41,436,278.27	44,259,369.46	2,823,091.19

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	1,422.45
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	206.10
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	18.60
合计	1,647.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	137,157.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	137,157.52

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	15,323.11
预提费用	174,383.76
合计	189,706.87

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	25,594,398.57	25,594,398.57
本期申购	75,115,566.11	75,115,566.11
本期赎回(以“-”号填列)	-60,018,430.65	-60,018,430.65
本期末	40,691,534.03	40,691,534.03

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	2,102,320.48	-3,593,594.87	-1,491,274.39
本期利润	5,006,126.84	4,669,886.82	9,676,013.66
本期基金份额交易产生的变动数	3,225,109.00	-3,583,265.92	-358,156.92
其中：基金申购款	10,333,961.29	-8,032,195.55	2,301,765.74
基金赎回款	-7,108,852.29	4,448,929.63	-2,659,922.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,333,556.32	-2,506,973.97	7,826,582.35

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	18,207.71
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	1,896.76
其他	466.59
合计	20,571.06

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	155,979,241.92
减：卖出股票成本总额	150,983,148.20

买卖股票差价收入	4,996,093.72
----------	--------------

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	342,752.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	342,752.36

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	4,669,886.82
——股票投资	4,669,886.82
——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	4,669,886.82

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	311,576.78
其他	100,000.00
转换费收入	4,018.76
合计	415,595.54

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	419,548.09
银行间市场交易费用	-
合计	419,548.09

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	24,795.19
信息披露费	49,588.57
银行划款费用	1,805.51

银行间帐户维护费	9,000.00
合计	85,189.27

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

截至财务报表批准日，本基金无需披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

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交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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管理费	226,412.98	280,301.52
其中：支付销售机构的客户维护费	66,577.85	88,877.65

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	37,735.50	46,716.89

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

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

本报告期及上年度可比期间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
工商银行	8,307,834.84	18,207.71	5,052,401.57	25,624.53

注：本基金银行存款由基金托管人工商银行保管，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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300367	东方网力	2016/12/15	重大事项	20.63	2017/7/3	18.01	61,681	1,575,084.42	1,272,479.03	-

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。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截止本期末，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。本基金投资于一家公司发行的证券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，所持证券均可在证券交易所和银行间同业市场交易。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	8,307,834.84	-	-	-	8,307,834.84
结算备付金	457,829.14	-	-	-	457,829.14
存出保证金	41,426.59	-	-	-	41,426.59
交易性金融资产	-	-	-	44,259,369.46	44,259,369.46
应收证券清算款	-	-	-	6,559,560.72	6,559,560.72
应收利息	-	-	-	1,647.15	1,647.15
应收申购款	-	-	-	2,105,098.92	2,105,098.92
资产总计	8,807,090.57	-	-	52,925,676.25	61,732,766.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,812,168.18	12,812,168.18
应付管理人报酬	-	-	-	64,815.35	64,815.35
应付托管费	-	-	-	10,802.52	10,802.52
应付交易费用	-	-	-	137,157.52	137,157.52
其他负债	-	-	-	189,706.87	189,706.87
负债总计	-	-	-	13,214,650.44	13,214,650.44
利率敏感度缺口	8,807,090.57	-	-	39,711,025.81	48,518,116.38
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	3,267,609.77	-	-	-	3,267,609.77
结算备付金	207,238.25	-	-	-	207,238.25
存出保证金	34,418.53	-	-	-	34,418.53
交易性金融资产	-	-	-	21,034,381.52	21,034,381.52
应收利息	-	-	-	909.34	909.34
资产总计	3,509,266.55	-	-	21,035,290.86	24,544,557.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,252.09	9,252.09
应付管理人报酬	-	-	-	31,822.98	31,822.98
应付托管费	-	-	-	5,303.80	5,303.80

应付交易费用	-	-	-	45,044.26	45,044.26
其他负债	-	-	-	350,010.10	350,010.10
负债总计	-	-	-	441,433.23	441,433.23
利率敏感度缺口	3,509,266.55	-	-	20,593,857.63	24,103,124.18

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，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。本基金的允许投资香港联合交易所上市的股票等其他金融工具，因此存在一定的外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券等金融衍生工具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，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 80%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	44,259,369.46	91.22	21,034,381.52	87.27
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	44,259,369.46	91.22	21,034,381.52	87.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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、沪深 300 指数上升 5%	2,611,766.22	1,654,152.94
	2、沪深 300 指数下降 5%	-2,611,766.22	-1,654,152.94

§ 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	44,259,369.46	71.70
	其中：股票	44,259,369.46	71.70
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	8,765,663.98	14.20
7	其他各项资产	8,707,733.38	14.11
8	合计	61,732,766.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	891,237.24	1.84
B	采矿业	837,005.88	1.73
C	制造业	19,576,016.13	40.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	436,990.00	0.90
E	建筑业	2,917,033.68	6.01
F	批发和零售业	1,744,068.14	3.59

G	交通运输、仓储和邮政业	1,304,277.00	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,309,702.16	8.88
J	金融业	6,049,092.14	12.47
K	房地产业	2,207,742.31	4.55
L	租赁和商务服务业	789,741.44	1.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,509,314.02	5.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	687,149.32	1.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,259,369.46	91.22

7.2.2 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

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	002230	科大讯飞	72,526	2,893,787.40	5.96
2	002466	天齐锂业	35,890	1,950,621.50	4.02
3	600581	八一钢铁	165,100	1,662,557.00	3.43
4	000776	广发证券	83,100	1,433,475.00	2.95
5	601318	中国平安	28,134	1,395,727.74	2.88
6	601668	中国建筑	143,301	1,387,153.68	2.86
7	000069	华侨城A	131,417	1,322,055.02	2.72
8	600270	外运发展	68,900	1,304,277.00	2.69

9	600048	保利地产	129,942	1,295,521.74	2.67
10	300367	东方网力	61,681	1,272,479.03	2.62
11	600019	宝钢股份	177,799	1,193,031.29	2.46
12	300070	碧水源	63,660	1,187,259.00	2.45
13	600030	中信证券	67,700	1,152,254.00	2.37
14	000963	华东医药	21,277	1,057,466.90	2.18
15	300115	长盈精密	35,393	1,032,767.74	2.13
16	002271	东方雨虹	27,576	1,023,069.60	2.11
17	600585	海螺水泥	44,869	1,019,872.37	2.10
18	002074	国轩高科	29,800	940,190.00	1.94
19	300203	聚光科技	32,468	913,000.16	1.88
20	600383	金地集团	79,531	912,220.57	1.88
21	002714	牧原股份	32,742	891,237.24	1.84
22	601699	潞安环能	107,034	837,005.88	1.73
23	000910	大亚圣象	33,600	834,624.00	1.72
24	000921	海信科龙	46,838	806,081.98	1.66
25	002027	分众传媒	57,394	789,741.44	1.63
26	300463	迈克生物	30,871	787,210.50	1.62
27	300033	同花顺	12,400	771,404.00	1.59
28	002202	金风科技	49,472	765,331.84	1.58
29	002372	伟星新材	38,378	716,901.04	1.48
30	300244	迪安诊断	21,842	687,149.32	1.42
31	000501	鄂武商 A	37,194	686,601.24	1.42
32	000661	长春高新	5,092	657,428.12	1.36
33	600570	恒生电子	13,807	644,510.76	1.33
34	000488	晨鸣纸业	48,622	627,223.80	1.29
35	300197	铁汉生态	45,500	604,240.00	1.25
36	600068	葛洲坝	51,100	574,364.00	1.18

37	600312	平高电气	41,200	566,088.00	1.17
38	600782	新钢股份	148,212	540,973.80	1.11
39	002294	信立泰	14,914	531,833.24	1.10
40	600079	人福医药	27,000	529,740.00	1.09
41	601336	新华保险	10,200	524,280.00	1.08
42	601818	光大银行	128,700	521,235.00	1.07
43	601166	兴业银行	30,700	517,602.00	1.07
44	000651	格力电器	12,283	505,691.11	1.04
45	600015	华夏银行	54,720	504,518.40	1.04
46	002179	中航光电	14,859	463,452.21	0.96
47	600674	川投能源	44,500	436,990.00	0.90
48	601186	中国铁建	29,200	351,276.00	0.72
49	000630	铜陵有色	83,045	235,847.80	0.49

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	002460	赣锋锂业	6,132,266.41	25.44
2	002271	东方雨虹	5,816,718.91	24.13
3	002466	天齐锂业	5,665,151.11	23.50
4	600048	保利地产	5,319,577.00	22.07
5	601012	隆基股份	5,147,195.00	21.35
6	002074	国轩高科	5,110,224.00	21.20
7	601318	中国平安	5,035,395.00	20.89
8	002230	科大讯飞	3,982,002.36	16.52
9	000921	海信科龙	3,912,018.00	16.23
10	002078	太阳纸业	3,511,680.00	14.57

11	002372	伟星新材	3,383,988.23	14.04
12	300115	长盈精密	3,362,792.00	13.95
13	000069	华侨城A	3,356,197.00	13.92
14	300070	碧水源	3,224,416.00	13.38
15	000625	长安汽车	3,214,099.00	13.33
16	600570	恒生电子	3,186,711.00	13.22
17	000488	晨鸣纸业	3,184,643.84	13.21
18	000977	浪潮信息	3,090,111.00	12.82
19	601818	光大银行	3,060,104.00	12.70
20	601021	春秋航空	3,049,515.00	12.65
21	300059	东方财富	2,980,734.00	12.37
22	601668	中国建筑	2,829,738.00	11.74
23	000963	华东医药	2,608,158.40	10.82
24	000651	格力电器	2,604,350.00	10.81
25	600383	金地集团	2,574,787.00	10.68
26	002573	清新环境	2,546,038.00	10.56
27	002179	中航光电	2,536,817.32	10.52
28	600019	宝钢股份	2,531,283.44	10.50
29	601699	潞安环能	2,502,087.00	10.38
30	600885	宏发股份	2,460,340.60	10.21
31	300203	聚光科技	2,288,743.85	9.50
32	600409	三友化工	2,133,136.00	8.85
33	002027	分众传媒	2,057,998.00	8.54
34	000501	鄂武商A	2,021,007.00	8.38
35	600585	海螺水泥	1,991,851.87	8.26
36	002714	牧原股份	1,956,176.00	8.12
37	300408	三环集团	1,933,918.76	8.02
38	600741	华域汽车	1,823,085.68	7.56

39	600581	八一钢铁	1,811,476.00	7.52
40	601336	新华保险	1,770,942.00	7.35
41	300463	迈克生物	1,717,781.00	7.13
42	000661	长春高新	1,705,090.42	7.07
43	300033	同花顺	1,686,126.00	7.00
44	600079	人福医药	1,666,101.00	6.91
45	002294	信立泰	1,641,956.00	6.81
46	600270	外运发展	1,547,483.00	6.42
47	600562	国睿科技	1,541,825.00	6.40
48	000776	广发证券	1,424,356.00	5.91
49	000983	西山煤电	1,347,840.00	5.59
50	600066	宇通客车	1,326,940.00	5.51
51	300244	迪安诊断	1,306,056.00	5.42
52	600782	新钢股份	1,304,245.00	5.41
53	300284	苏文科	1,284,051.44	5.33
54	600030	中信证券	1,143,490.00	4.74
55	600309	万华化学	1,138,716.00	4.72
56	600703	三安光电	1,122,972.60	4.66
57	000910	大亚圣象	1,054,961.00	4.38
58	603019	中科曙光	1,051,206.00	4.36
59	600219	南山铝业	972,885.00	4.04
60	601328	交通银行	961,233.00	3.99
61	000630	铜陵有色	912,725.00	3.79
62	600015	华夏银行	767,379.00	3.18
63	601166	兴业银行	751,542.00	3.12
64	001979	招商蛇口	750,037.00	3.11
65	002202	金风科技	724,329.08	3.01
66	600372	中航电子	719,136.00	2.98

67	600674	川投能源	684,368.00	2.84
68	000960	锡业股份	660,557.00	2.74
69	002242	九阳股份	659,742.00	2.74
70	601899	紫金矿业	608,547.00	2.52
71	300197	铁汉生态	596,594.00	2.48
72	600029	南方航空	591,204.00	2.45
73	601633	长城汽车	571,926.00	2.37
74	600068	葛洲坝	559,034.00	2.32
75	600312	平高电气	557,670.00	2.31
76	300439	美康生物	538,092.00	2.23
77	600477	杭萧钢构	535,111.00	2.22
78	601006	大秦铁路	514,174.00	2.13
79	600016	民生银行	513,252.00	2.13
80	002045	国光电器	511,280.00	2.12
81	000709	河钢股份	492,331.00	2.04

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	002460	赣锋锂业	6,884,327.28	28.56
2	002466	天齐锂业	6,016,460.60	24.96
3	002271	东方雨虹	5,426,810.96	22.51
4	601012	隆基股份	5,223,764.62	21.67
5	002074	国轩高科	4,869,594.51	20.20
6	601318	中国平安	4,332,703.29	17.98
7	002230	科大讯飞	4,262,302.30	17.68

8	600048	保利地产	4,225,160.11	17.53
9	600570	恒生电子	3,609,076.43	14.97
10	002078	太阳纸业	3,467,486.25	14.39
11	000921	海信科龙	3,338,145.72	13.85
12	000625	长安汽车	3,269,319.70	13.56
13	601021	春秋航空	3,140,006.15	13.03
14	000977	浪潮信息	3,060,784.81	12.70
15	300059	东方财富	3,005,095.65	12.47
16	002372	伟星新材	2,867,566.46	11.90
17	000488	晨鸣纸业	2,691,328.58	11.17
18	000069	华侨城 A	2,556,435.29	10.61
19	601818	光大银行	2,552,416.28	10.59
20	600885	宏发股份	2,549,501.54	10.58
21	300115	长盈精密	2,465,393.14	10.23
22	002573	清新环境	2,422,600.03	10.05
23	000651	格力电器	2,397,245.41	9.95
24	600409	三友化工	2,256,143.88	9.36
25	002179	中航光电	2,150,619.43	8.92
26	300070	碧水源	2,090,966.91	8.68
27	600741	华域汽车	2,080,212.36	8.63
28	300408	三环集团	2,077,102.88	8.62
29	300284	苏交科	2,066,294.93	8.57
30	000709	河钢股份	1,980,907.01	8.22
31	600562	国睿科技	1,934,588.10	8.03
32	600383	金地集团	1,710,954.22	7.10
33	000963	华东医药	1,670,621.47	6.93
34	601699	潞安环能	1,620,009.38	6.72
35	601668	中国建筑	1,531,370.27	6.35

36	000501	鄂武商 A	1,490,038.54	6.18
37	600019	宝钢股份	1,487,600.60	6.17
38	300463	迈克生物	1,470,824.17	6.10
39	601965	中国汽研	1,440,115.78	5.97
40	002635	安洁科技	1,436,074.85	5.96
41	002027	分众传媒	1,404,122.64	5.83
42	000983	西山煤电	1,393,858.23	5.78
43	601336	新华保险	1,323,010.72	5.49
44	002294	信立泰	1,320,664.40	5.48
45	600066	宇通客车	1,320,662.80	5.48
46	300203	聚光科技	1,314,185.33	5.45
47	600309	万华化学	1,301,523.48	5.40
48	600703	三安光电	1,192,353.98	4.95
49	300054	鼎龙股份	1,178,448.66	4.89
50	002714	牧原股份	1,164,267.28	4.83
51	000661	长春高新	1,151,323.79	4.78
52	600079	人福医药	1,150,111.67	4.77
53	600585	海螺水泥	1,117,125.39	4.63
54	603019	中科曙光	1,082,729.71	4.49
55	300033	同花顺	990,360.74	4.11
56	601328	交通银行	985,100.00	4.09
57	600219	南山铝业	950,193.34	3.94
58	600782	新钢股份	871,286.33	3.61
59	000498	山东路桥	842,212.00	3.49
60	002478	常宝股份	830,001.41	3.44
61	002049	紫光国芯	800,989.00	3.32
62	600773	西藏城投	787,440.78	3.27
63	603993	洛阳钼业	779,319.00	3.23

64	001979	招商蛇口	771,420.00	3.20
65	000762	西藏矿业	734,153.91	3.05
66	600372	中航电子	726,539.01	3.01
67	300244	迪安诊断	709,580.23	2.94
68	000630	铜陵有色	695,289.80	2.88
69	000960	锡业股份	671,944.00	2.79
70	002242	九阳股份	671,273.96	2.79
71	601899	紫金矿业	623,435.00	2.59
72	300406	九强生物	588,900.00	2.44
73	600029	南方航空	587,535.69	2.44
74	002444	巨星科技	581,094.04	2.41
75	601633	长城汽车	568,692.10	2.36
76	600477	杭萧钢构	538,153.00	2.23
77	601006	大秦铁路	530,508.53	2.20
78	300439	美康生物	512,001.12	2.12
79	600016	民生银行	511,980.00	2.12
80	002045	国光电器	491,421.00	2.04

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	169,538,249.32
卖出股票收入（成交）总额	155,979,241.92

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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

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	41,426.59
2	应收证券清算款	6,559,560.72
3	应收股利	-
4	应收利息	1,647.15
5	应收申购款	2,105,098.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,707,733.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300367	东方网力	1,272,479.03	2.62	重大事项停牌

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

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
758	53,682.76	13,694,606.40	33.65%	26,996,927.63	66.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	97,740.97	0.2402%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 8 月 7 日 ）基金份额总额	224,723,362.19
本报告期期初基金份额总额	25,594,398.57
本报告期基金总申购份额	75,115,566.11
减：本报告期基金总赎回份额	60,018,430.65
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	40,691,534.03

§ 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

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
广发证券	2	167,515,269.10	51.46%	119,151.55	50.77%	-
国泰君安	1	157,993,772.14	48.54%	115,541.04	49.23%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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。

已退租交易单元：国信证券、民生证券、东兴证券。

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

无。

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	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	2017年1月13日
2	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
3	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
4	安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金2016年第4季度报告	证券时报	2017年1月21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	2017年1月25日
6	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
7	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
8	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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017年3月8日

	卡业务的公告		
9	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3月15日
10	安信新常态沪港深精选股票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3月24日
11	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
12	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	2017年3月30日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金2017年第1季度报告	中国证券报、证券时报	2017年4月22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

20	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
21	安信基金管理有限责任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
22	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
23	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
24	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
25	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

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170210-20170223	-	27,948,240.17	27,948,240.17	-	0.00%
	2	20170101-20170313	10,001,250.00	-	10,001,250.00	-	0.00%
	3	20170427-20170630	-	8,901,701.32	-	8,901,701.32	21.88%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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新常态沪港深精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新常态沪港深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

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