

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 20 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	103,875,096.57 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	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的模式，在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上，行业运行周期和公司竞争优势分析为根本，结合金融市场行为分析，根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断，动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	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	基金管理人和基金托管人住所。

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	772,996.99
本期利润	3,715,614.24
加权平均基金份额本期利润	0.0350
本期加权平均净值利润率	3.39%
本期基金份额净值增长率	3.26%
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	4,790,626.88
期末可供分配基金份额利润	0.0461
期末基金资产净值	108,665,723.45
期末基金份额净值	1.046
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	68.43%

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。

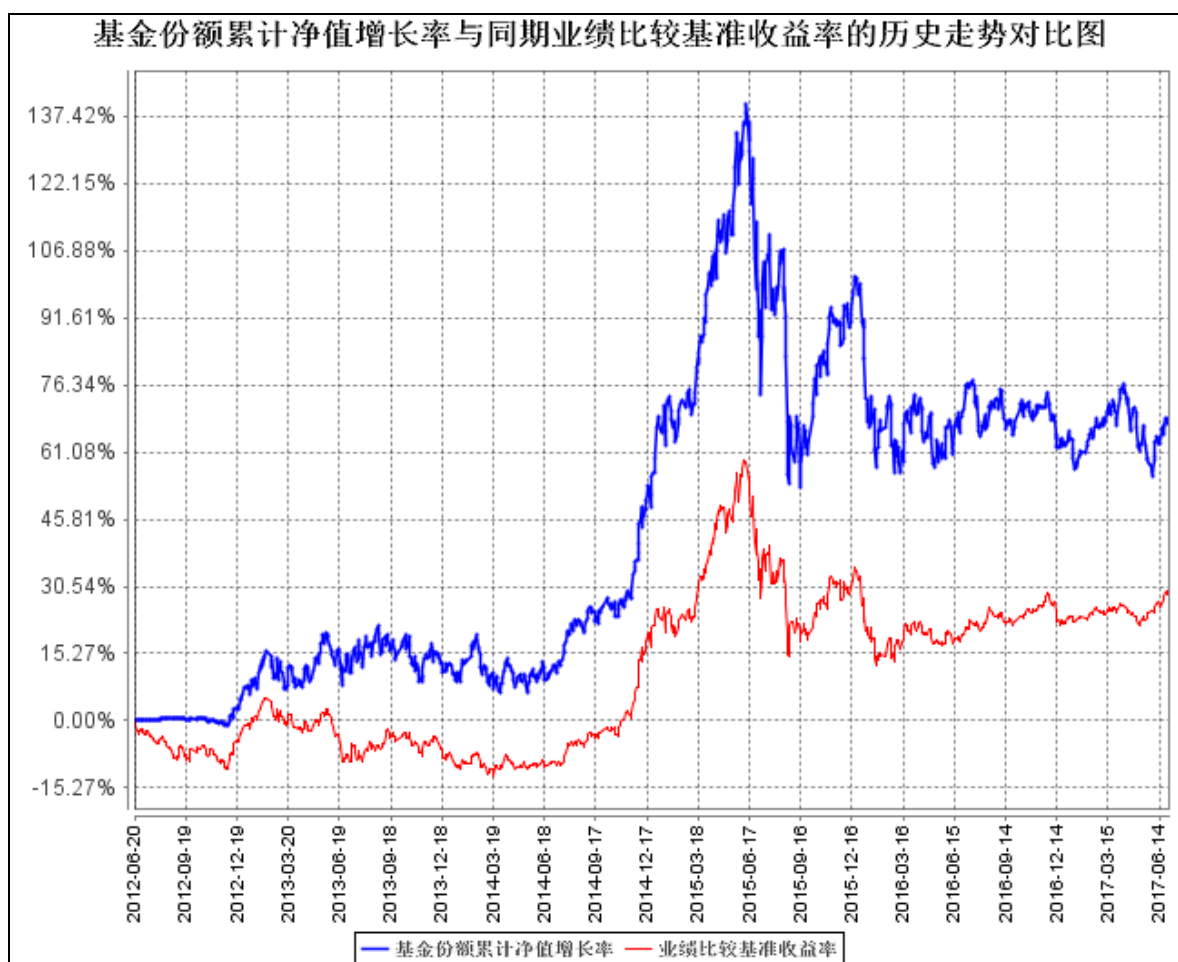
3.2 基金净值表现

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	6.52%	0.86%	3.33%	0.41%	3.19%	0.45%

过去三个月	-0.29%	1.06%	3.21%	0.39%	-3.50%	0.67%
过去六个月	3.26%	0.91%	5.32%	0.35%	-2.06%	0.56%
过去一年	-0.88%	0.89%	7.91%	0.42%	-8.79%	0.47%
过去三年	51.14%	1.67%	42.78%	1.05%	8.36%	0.62%
自基金合同生效起至今	68.43%	1.45%	29.15%	0.95%	39.28%	0.50%

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 2012 年 6 月 20 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		
占冠良	本基金的基金经理、研究部总经理	2015 年 12 月 1 日	-	16	占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现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。
庄园	本基金的基金经理助理	2012 年 6 月 21 日	-	13	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

				<p>资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012 年 5 月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信宝利债券型证券投资基金(LOF)(原安信宝利分级债券型证券投资基金)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投</p>
--	--	--	--	---

					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。
--	--	--	--	--	------------------------------

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，从上证指数来看 A 股市场总体上维持宽幅震荡，指数先扬后抑再上行，但是其中结构分化明显。

一季度，国内投资数据保持相对强劲，中游行业存在补库存以及资本开支扩张的需求或预期，三四线城市的消费升级也日渐受到关注，市场参与者对短期经济普遍持谨慎乐观态度。反映在 A 股市场上，投资者风险偏好缓慢抬升，市场较平稳上行。季度中虽然发生略超预期的美元加息，以及国内的货币政策转向收缩，但对市场并未构成明显压力。一季度市场风格特征并不显著，白酒家电等稳定消费板块、建筑建材及机械等投资属性板块、以及电子等新兴成长板块均有较好表现。相对而言，市场更偏重于基于业绩增长和估值合理性的板块及个股挖掘。

市场剧烈波动出现在二季度。千年大计雄安新区公告令投资者群情激奋，雄安相关主题个股连续封板，带动本已上行出现颓势的市场再次昂“扬”向上。但是监管层喊话痛斥市场主题炒作之风，市场情绪受冲击而开始 4、5 月份的较为“分裂”的大跌行情。分裂之处在于以中小创为代表的绝大多数个股急速下跌呈现小股灾，极少数的龙头白马呈现“漂亮 50”牛市行情。究其原因，下跌主要在于金融监管去杠杆的雷厉风行，提高市场利率水平又打击降低了市场风险偏好，同时 IPO 还在持续发行彰显监管层的高压态势；同时，风险偏好降低趋势下的龙头白马公司由于未来前景确定性的优势，同时受到 MSCI 纳入 A 股预期下的北上资金的持续买入的市场引导，本土机构也竞相抱团投资“漂亮 50”。6 月份 IPO 节奏的变化，以及金融监管的节奏有所缓和，才令市场走势有所修复，以钢铁、煤炭等为代表的周期行业由于高业绩和低 PE 的特性受到市场关注，市场结构特征有所变化。

回顾本基金的半年投资运作，一季度的投资总体尚可，二季度则在市场大跌行情中未能及时调整应对，组合净值在该阶段出现较大波动。相对而言，一季度组合更为分散均衡，具有相当的平稳增长预期的板块，包括电子、建筑、环保、白酒、家电等，均有持续的相当比例的投资，周期属性较强的板块中，石化化工在季度前期有所投资侧重，而后期则偏向于建材、钢铁板块。二季度前期组合基于 PEG 选股思路，在电子、建筑、环保的投资比例相对较高，而后二个行业受市场利率上行影响的负面预期而出现较大下跌，在季度后期，适当加强了组合的灵活调整力度，根据市场特征变化，适当增持了长期向好的新能源汽车产业链偏上游个股，以及受益于供给侧改革的中报业绩较好估值较低的钢铁、有色等个股，净值有所回升。

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 1.046 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.26%，业绩

比较基准收益率为 5.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年宏观经济数据已经公布，消费平稳，出口向好，投资超预期，中国宏观经济运行超预期。从大的周期而言，中国经济存在一定程度上的补库存周期和朱格拉投资周期的叠加共振。中观而言，地产因城施策的调控政策效果显现，销售数据大大好于之前地产调控初期的市场悲观预期，地产企业资产状况改善，地产后周期产业显著受益；钢铁、煤炭行业的供给侧改革有效提升行业整体盈利，带动相关产业链的良性发展。

我们预计，在地产销售良好的形势下，地产投资在下半年有望维持相对较好的局面，在本届政府较强的政策执行力下，供给侧改革、环保督查治理等将继续推进，相关行业盈利与资产状况进一步改善，也将推动制造业投资继续扩张；另一方面，海外美国、欧洲经济也将保持较好的增长，尤其是欧洲，而人民币汇率平稳但相对欧元有一定贬值，也有利于中国经济向欧洲的出口增长。国内投资数据和出口将继续支持宏观经济保持较好的格局。

导致上半年 A 股市场出现大幅波动的金融监管去杠杆，在下半年有望呈现边际上的缓和。银监会推迟银行提交关于同业业务和委托理财业务的自查报告，可以认为已经是缓和的明证；最近的全国金融工作会议，重点强调金融监管从严，但是也突出了要协调金融监管。从中长期而言，金融监管从严对金融行业发展无疑会有压制，但是放在今年下半年，尤其是考虑到之前市场的大跌反应，考虑到十九大之前的维稳，有理由相信，下半年的金融监管应该会有注重“协调性”的缓和。这种边际的缓和变化，对市场利率，对投资者风险偏好，对 A 股市场是偏正面的。

A 股纳入 MSCI，以及债券通的实施，对 A 股中长期而言意义重大。相比海外经济体，中国具有的全产业链优势带来的经济稳定性，以及经济增长率仍然具有较好的绝对水平，奠定了国内证券市场的投资吸引力。上半年漂亮 50 的行情已经证明了这一点，海外投资资金有望持续流入，占国内市场的投资比重也将逐步上升。对于本土机构而言，国际估值比较需要纳入视野，而海外资金的流入 A 股，也为部分具有国际估值比较优势的行业增强了投资信心。而债券通的开通实施，以及未来若顺利的话国内债券也可能纳入某些国际债券指数，对于海外债券投资资金的流入，由此带来的国内流动性的宽松支持，是可以有一定的期望的。

总体来说，考虑国内经济环境，金融监管环境，投资者参与结构，十九大召开等因素，A 股市场在下半年将可能表现为震荡上行的格局。尤其在十九大召开之前，维稳预期可能一直都在，市场指数的波动幅度可能不大。十九大之后，市场可能存在一定的变数，这将取决于十九大后相对明朗的新一届政府安排。

经济保持相对强劲，市场风险偏好有所修复，再加上中小创之前的下跌，下半年 A 股市场的结构分化应有所缓和。漂亮 50 为代表的蓝筹龙头，周期行业，具有真成长特征的二线成长股等均可能有阶段性的表现。三四线城市的消费升级对经济的拉动可能值得关注，该主题在上半年的家具电行业已经有所体现，后续不排除继续扩散而成为市场焦点的可能。

观察以往，本届政府的政策执行力应该是非常强的，包括一带一路、供给侧改革、环保治理等，均有持续的政策和行政执行力度来推进。因此而言，一带一路、受益供给侧改革的电解铝等板块，将是市场持续的关注热点。我们也同样关注国企改革主题，国企改革同样也是经济国策重点，但是在证券市场上由于缺乏较为显性的正面影响，而且行业、区域分布相对离散，因此而更多是自下而上的个股挖掘。

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，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：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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	7,553,483.13	5,666,680.66
结算备付金		371,220.81	1,486,906.35
存出保证金		42,676.44	58,761.08
交易性金融资产	6.4.7.2	89,481,848.92	93,956,528.12
其中：股票投资		85,995,396.42	86,047,237.58
基金投资		-	-
债券投资		3,486,452.50	7,909,290.54
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	12,500,000.00	10,800,000.00
应收证券清算款		1,252,735.71	887,196.15
应收利息	6.4.7.5	8,740.88	16,491.82
应收股利		-	-
应收申购款		4,992.51	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		111,215,698.40	112,872,564.18
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		1,864,309.58	883,213.92
应付赎回款		61,654.72	1,410.08
应付管理人报酬		130,510.84	144,692.82
应付托管费		21,751.82	24,115.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	197,995.01	196,689.95
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	273,752.98	350,002.34
负债合计		2,549,974.95	1,600,124.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	103,875,096.57	109,865,517.88
未分配利润	6.4.7.10	4,790,626.88	1,406,921.70
所有者权益合计		108,665,723.45	111,272,439.58
负债和所有者权益总计		111,215,698.40	112,872,564.18

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 103,875,096.57 份。

6.2 利润表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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		5,586,661.46	-17,350,709.15
1.利息收入		203,355.02	182,843.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,072.57	33,268.55
债券利息收入		21,121.75	33,861.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		126,160.70	115,713.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,364,285.64	-17,485,897.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,531,838.47	-17,270,772.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	478,193.24	-368,769.52
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	354,253.93	153,645.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,942,617.25	-174,068.23
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	76,403.55	126,413.06
减：二、费用		1,871,047.22	1,579,501.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	813,917.54	594,392.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	135,652.91	99,065.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	726,072.49	688,664.62
5. 利息支出		-	263.23
其中：卖出回购金融资产支出		-	263.23
6. 其他费用	6.4.7.21	195,404.28	197,115.71

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,715,614.24	-18,930,210.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,715,614.24	-18,930,210.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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）	109,865,517.88	1,406,921.70	111,272,439.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,715,614.24	3,715,614.24
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）	-5,990,421.31	-331,909.06	-6,322,330.37
其中：1.基金申购款	2,400,159.06	90,943.59	2,491,102.65
2.基金赎回款	-8,390,580.37	-422,852.65	-8,813,433.02
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)	103,875,096.57	4,790,626.88	108,665,723.45
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)	84,595,293.31	63,448,453.25	148,043,746.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,930,210.51	-18,930,210.51
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)	-38,430,021.34	-21,361,160.98	-59,791,182.32
其中：1.基金申购款	27,633,445.63	15,587,083.50	43,220,529.13
2.基金赎回款	-66,063,466.97	-36,948,244.48	-103,011,711.45
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)	46,165,271.97	23,157,081.76	69,322,353.73

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

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2012年4月5日下发的证监许可[2012]442号文“关于核准安信策略精选灵活配置混合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《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2012年5月21日至2012年6月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币743,292,609.47元，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(2012)验字第60962175_H04号验资报告。经向中国证监会备案，《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2012年6月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为743,426,623.31份基金份额，其中认购资金利息折合134,013.84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《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的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（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规允许或中国证监会批准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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例为30%—80%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为20%—70%，权证投资占基金资产净值的比例不得超过3%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 40\% \times \text{中债总指数收益率}$ 。

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

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	7,553,483.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,553,483.13

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	84,263,282.93	85,995,396.42	1,732,113.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	3,391,632.58	3,486,452.50	94,819.92
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,391,632.58	3,486,452.50	94,819.92
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	87,654,915.51	89,481,848.92	1,826,933.41	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	12,500,000.00	-
合计	12,500,000.00	-

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	1,353.12
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	167.00
应收债券利息	4,033.62
应收买入返售证券利息	3,167.94
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.20
合计	8,740.88

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	197,995.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	197,995.01

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	192.08
预提费用	273,560.90
合计	273,752.98

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	109,865,517.88	109,865,517.88
本期申购	2,400,159.06	2,400,159.06
本期赎回(以“-”号填列)	-8,390,580.37	-8,390,580.37
本期末	103,875,096.57	103,875,096.57

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	13,914,252.81	-12,507,331.11	1,406,921.70
本期利润	772,996.99	2,942,617.25	3,715,614.24
本期基金份额交易产生的变动数	-768,507.16	436,598.10	-331,909.06
其中：基金申购款	319,545.07	-228,601.48	90,943.59
基金赎回款	-1,088,052.23	665,199.58	-422,852.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,918,742.64	-9,128,115.76	4,790,626.88

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	29,394.34
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	7,919.62
其他	18,758.61
合计	56,072.57

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	272,745,671.00
减：卖出股票成本总额	271,213,832.53
买卖股票差价收入	1,531,838.47

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	478,193.24
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	478,193.24

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,640,930.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,138,588.77
减：应收利息总额	24,148.40
买卖债券差价收入	478,193.24

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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	354,253.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	354,253.93

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	2,942,617.25
——股票投资	2,570,704.01
——债券投资	371,913.24
——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	2,942,617.25

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	6,357.63
其他	70,000.00
转换费收入	45.92
合计	76,403.55

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	726,072.49

银行间市场交易费用	-
合计	726,072.49

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	148,765.71
银行划款费用	3,243.38
银行间帐户维护费	18,600.00
合计	195,404.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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	基金管理人的股东、基金销售机构

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

3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未产生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	813,917.54	594,392.37
其中：支付销售机构的客户维护费	149,866.45	208,391.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%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	135,652.91	99,065.43

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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2012年6月20日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	5,668,367.35
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	5,668,367.35
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	12.2800%

注：1. 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

2. 本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率与本基金法律文件的规定一致。

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
中国建设银行	7,553,483.13	29,394.34	2,463,778.04	22,996.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事项	16.92	-	-	150,169	2,466,609.67	2,540,859.48	-
002675	东诚药业	2017年1月3日	重大事项	14.26	2017年7月17日	12.84	27,700	450,583.00	395,002.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事项	21.65	2017年7月27日	19.49	846	23,708.38	18,315.90	-

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 3.21%（上年度末为 7.10%），因此本基金无重大信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	3,490,486.12	7,917,645.22
未评级	-	-

合计	3,490,486.12	7,917,645.22
----	--------------	--------------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种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，所持证券均在证券交易所或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	7,553,483.13	-	-	-	7,553,483.13
结算备付金	371,220.81	-	-	-	371,220.81
存出保证金	42,676.44	-	-	-	42,676.44
交易性金融资产	-	3,486,452.50	-	85,995,396.42	89,481,848.92
买入返售金融资产	12,500,000.00	-	-	-	12,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,252,735.71	1,252,735.71
应收利息	-	-	-	8,740.88	8,740.88
应收申购款	-	-	-	4,992.51	4,992.51
资产总计	20,467,380.38	3,486,452.50	-	87,261,865.52	111,215,698.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,864,309.58	1,864,309.58
应付赎回款	-	-	-	61,654.72	61,654.72
应付管理人报酬	-	-	-	130,510.84	130,510.84
应付托管费	-	-	-	21,751.82	21,751.82
应付交易费用	-	-	-	197,995.01	197,995.01
其他负债	-	-	-	273,752.98	273,752.98
负债总计	-	-	-	2,549,974.95	2,549,974.95
利率敏感度缺口	20,467,380.38	3,486,452.50	-	84,711,890.57	108,665,723.45
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	5,666,680.66	-	-	-	5,666,680.66
结算备付金	1,486,906.35	-	-	-	1,486,906.35
存出保证金	58,761.08	-	-	-	58,761.08

交易性金融资产	-	3,103,712.64	4,805,577.90	86,047,237.58	93,956,528.12
买入返售金融资产	10,800,000.00	-	-	-	10,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	887,196.15	887,196.15
应收利息	-	-	-	16,491.82	16,491.82
资产总计	18,012,348.09	3,103,712.64	4,805,577.90	86,950,925.55	112,872,564.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	883,213.92	883,213.92
应付赎回款	-	-	-	1,410.08	1,410.08
应付管理人报酬	-	-	-	144,692.82	144,692.82
应付托管费	-	-	-	24,115.49	24,115.49
应付交易费用	-	-	-	196,689.95	196,689.95
其他负债	-	-	-	350,002.34	350,002.34
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,600,124.60	1,600,124.60
利率敏感度缺口	18,012,348.09	3,103,712.64	4,805,577.90	85,350,800.95	111,272,439.58

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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、市场利率下降 25 个基点	39,444.94	90,622.91
	2、市场利率上升 25 个基点	-38,872.39	-89,306.13

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资金占基金资产的比例为 30%-80%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为 20%-70%。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	85,995,396.42	79.14	86,047,237.58	77.33
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	85,995,396.42	79.14	86,047,237.58	77.33

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	上年度末（2016 年 12 月

		30 日)	31 日)
	1、沪深 300 指数上升 5%	5,095,712.64	4,547,444.55
	2、沪深 300 指数下降 5%	-5,095,712.64	-4,547,444.55

§ 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	85,995,396.42	77.32
	其中：股票	85,995,396.42	77.32
2	固定收益投资	3,486,452.50	3.13
	其中：债券	3,486,452.50	3.13
	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	12,500,000.00	11.24
	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	7,924,703.94	7.13
7	其他各项资产	1,309,145.54	1.18
8	合计	111,215,698.40	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	1,075,677.72	0.99
B	采矿业	3,822,648.00	3.52
C	制造业	56,789,916.74	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42.48	0.00
E	建筑业	12,703,637.22	11.69
F	批发和零售业	1,034,264.00	0.95
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	711,092.70	0.65
J	金融业	3,285,543.92	3.02
K	房地产业	3,768,722.52	3.47
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	2,803,851.12	2.58
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	85,995,396.42	79.14

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	600703	三安光电	223,776	4,408,387.20	4.06
2	600068	葛洲坝	315,633	3,547,714.92	3.26
3	002217	合力泰	357,072	3,527,871.36	3.25
4	000066	中国长城	364,972	3,288,397.72	3.03
5	300296	利亚德	165,863	3,118,224.40	2.87
6	600502	安徽水利	355,800	2,736,102.00	2.52
7	601336	新华保险	51,715	2,658,151.00	2.45
8	600581	八一钢铁	253,200	2,549,724.00	2.35
9	300145	中金环境	150,169	2,540,859.48	2.34
10	600487	亨通光电	87,523	2,455,020.15	2.26
11	000933	神火股份	314,500	2,292,705.00	2.11
12	000928	中钢国际	240,144	2,271,762.24	2.09
13	002466	天齐锂业	41,551	2,258,296.85	2.08
14	300156	神雾环保	68,879	2,256,476.04	2.08
15	002497	雅化集团	219,865	2,132,690.50	1.96
16	001979	招商蛇口	95,900	2,048,424.00	1.89
17	002475	立讯精密	69,734	2,039,022.16	1.88
18	603993	洛阳钼业	386,800	1,957,208.00	1.80
19	600497	驰宏锌锗	284,800	1,865,440.00	1.72
20	300362	天翔环境	103,038	1,756,797.90	1.62
21	300115	长盈精密	50,213	1,465,215.34	1.35
22	000651	格力电器	34,800	1,432,716.00	1.32
23	002008	大族激光	40,800	1,413,312.00	1.30
24	300197	铁汉生态	101,385	1,346,392.80	1.24
25	000820	神雾节能	35,300	1,340,694.00	1.23
26	000921	海信科龙	74,500	1,282,145.00	1.18
27	002460	赣锋锂业	25,600	1,184,000.00	1.09
28	002450	康得新	51,548	1,160,860.96	1.07

29	000069	华侨城 A	114,100	1,147,846.00	1.06
30	002310	东方园林	68,467	1,144,768.24	1.05
31	600884	杉杉股份	66,500	1,095,255.00	1.01
32	600522	中天科技	90,300	1,088,115.00	1.00
33	600498	烽火通信	42,800	1,084,980.00	1.00
34	002200	云投生态	62,322	1,075,677.72	0.99
35	600963	岳阳林纸	142,700	1,074,531.00	0.99
36	000065	北方国际	45,167	1,074,071.26	0.99
37	300355	蒙草生态	99,838	1,072,260.12	0.99
38	002589	瑞康医药	67,160	1,034,264.00	0.95
39	000858	五粮液	15,600	868,296.00	0.80
40	600750	江中药业	24,400	847,900.00	0.78
41	000488	晨鸣纸业	59,800	771,420.00	0.71
42	600622	嘉宝集团	46,434	755,945.52	0.70
43	600690	青岛海尔	43,200	650,160.00	0.60
44	300568	星源材质	15,300	649,485.00	0.60
45	600048	保利地产	64,900	647,053.00	0.60
46	601628	中国人寿	23,254	627,392.92	0.58
47	000333	美的集团	13,918	599,030.72	0.55
48	600718	东软集团	38,260	594,943.00	0.55
49	300070	碧水源	31,300	583,745.00	0.54
50	002431	棕榈股份	52,888	582,825.76	0.54
51	300037	新宙邦	22,940	527,161.20	0.49
52	002508	老板电器	11,950	519,586.00	0.48
53	002635	安洁科技	13,917	504,073.74	0.46
54	000568	泸州老窖	9,434	477,171.72	0.44
55	000786	北新建材	28,927	458,203.68	0.42
56	601231	环旭电子	28,800	452,448.00	0.42

57	000423	东阿阿胶	5,800	416,962.00	0.38
58	002675	东诚药业	27,700	395,002.00	0.36
59	600325	华发股份	38,000	317,300.00	0.29
60	000878	云南铜业	16,500	217,635.00	0.20
61	000997	新大陆	3,100	70,339.00	0.06
62	002032	苏泊尔	1,523	62,519.15	0.06
63	300113	顺网科技	1,703	45,810.70	0.04
64	002372	伟星新材	1,604	29,962.72	0.03
65	002236	大华股份	990	22,581.90	0.02
66	300210	森远股份	2,162	20,971.40	0.02
67	002415	海康威视	570	18,411.00	0.02
68	300252	金信诺	846	18,315.90	0.02
69	600056	中国医药	629	16,322.55	0.02
70	600167	联美控股	2	42.48	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	5,983,286.40	5.38
2	000066	中国长城	5,826,063.52	5.24
3	000928	中钢国际	4,781,530.60	4.30
4	002310	东方园林	4,126,860.60	3.71
5	002217	合力泰	3,982,735.00	3.58
6	600977	中国电影	3,946,837.00	3.55
7	002431	棕榈股份	3,945,019.89	3.55
8	600068	葛洲坝	3,754,989.00	3.37

9	000789	万年青	3,660,893.00	3.29
10	300197	铁汉生态	3,618,535.36	3.25
11	600340	华夏幸福	3,553,258.00	3.19
12	300362	天翔环境	3,512,132.47	3.16
13	300115	长盈精密	3,364,140.52	3.02
14	601336	新华保险	3,360,507.00	3.02
15	600502	安徽水利	3,355,785.10	3.02
16	002475	立讯精密	3,318,875.99	2.98
17	600183	生益科技	3,200,179.84	2.88
18	600884	杉杉股份	3,198,014.00	2.87
19	300156	神雾环保	3,177,058.00	2.86
20	000065	北方国际	3,174,914.83	2.85
21	000983	西山煤电	3,163,123.14	2.84
22	300296	利亚德	3,122,382.21	2.81
23	300145	中金环境	3,008,573.12	2.70
24	600622	嘉宝集团	2,974,853.44	2.67
25	002497	雅化集团	2,965,714.00	2.67
26	002200	云投生态	2,899,660.00	2.61
27	601628	中国人寿	2,824,244.00	2.54
28	000967	盈峰环境	2,800,148.50	2.52
29	603588	高能环境	2,718,622.30	2.44
30	000501	鄂武商A	2,716,888.20	2.44
31	601678	滨化股份	2,638,886.32	2.37
32	000820	神雾节能	2,611,343.30	2.35
33	300355	蒙草生态	2,609,047.00	2.34
34	600801	华新水泥	2,572,225.00	2.31
35	000418	小天鹅A	2,511,529.00	2.26
36	600858	银座股份	2,504,611.46	2.25

37	600581	八一钢铁	2,426,952.00	2.18
38	002436	兴森科技	2,418,998.27	2.17
39	600827	百联股份	2,384,312.25	2.14
40	600809	山西汾酒	2,359,538.47	2.12
41	300203	聚光科技	2,359,089.00	2.12
42	000980	众泰汽车	2,280,802.00	2.05
43	000933	神火股份	2,265,201.81	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	000568	泸州老窖	6,735,689.58	6.05
2	000065	北方国际	6,050,471.60	5.44
3	300197	铁汉生态	5,861,975.39	5.27
4	000998	隆平高科	4,742,003.88	4.26
5	002508	老板电器	4,500,553.48	4.04
6	002431	棕榈股份	4,322,010.63	3.88
7	002310	东方园林	4,291,018.40	3.86
8	600340	华夏幸福	4,233,567.38	3.80
9	600977	中国电影	3,824,617.93	3.44
10	600487	亨通光电	3,587,345.89	3.22
11	002456	欧菲光	3,405,822.42	3.06
12	601186	中国铁建	3,338,894.21	3.00
13	600183	生益科技	3,264,516.50	2.93
14	000789	万年青	3,248,864.70	2.92
15	601009	南京银行	3,170,434.94	2.85

16	300156	神雾环保	3,082,539.05	2.77
17	600502	安徽水利	2,992,657.89	2.69
18	000967	盈峰环境	2,967,064.40	2.67
19	002475	立讯精密	2,943,721.95	2.65
20	300038	梅泰诺	2,897,775.53	2.60
21	000418	小天鹅A	2,823,678.29	2.54
22	000501	鄂武商A	2,770,863.92	2.49
23	600759	洲际油气	2,767,630.02	2.49
24	300136	信维通信	2,696,537.42	2.42
25	000983	西山煤电	2,664,505.18	2.39
26	603588	高能环境	2,652,821.61	2.38
27	300450	先导智能	2,640,554.72	2.37
28	601678	滨化股份	2,595,679.46	2.33
29	600801	华新水泥	2,594,260.58	2.33
30	600477	杭萧钢构	2,580,727.79	2.32
31	002450	康得新	2,566,165.80	2.31
32	600622	嘉宝集团	2,538,323.35	2.28
33	600827	百联股份	2,508,341.65	2.25
34	600110	诺德股份	2,443,125.88	2.20
35	000488	晨鸣纸业	2,432,874.73	2.19
36	300203	聚光科技	2,422,390.92	2.18
37	601155	新城控股	2,388,801.25	2.15
38	600809	山西汾酒	2,374,022.88	2.13
39	600858	银座股份	2,332,537.74	2.10
40	002436	兴森科技	2,236,942.43	2.01

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	268,591,287.36
卖出股票收入（成交）总额	272,745,671.00

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

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	-	-
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）	3,486,452.50	3.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,486,452.50	3.21

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110034	九州转债	27,550	3,486,452.50	3.21

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。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除合力泰(002217)，本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。根据 2017 年 3 月 1 日合力泰科技股份有限公司（下称合力泰，股票代码：002217）《合力泰科技股份有限公司关于深圳证券交易所对公司问询函回复的公告》，合力泰科技股份有限公司 2017 年 2 月 27 日收到深圳证券交易所（以下简称“深交所”）《关于对合力泰科技股份有限公司的问询函（中小板问询函【2017】第 84 号）》，根据《股票上市规则（2014 年修订）》第 17.2 条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，深交所决定对合力泰给予通报批评的处分。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	42,676.44
2	应收证券清算款	1,252,735.71
3	应收股利	-
4	应收利息	8,740.88
5	应收申购款	4,992.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,309,145.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110034	九州转债	3,486,452.50	3.21

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	300145	中金环境	2,540,859.48	2.34	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

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
1,219	85,213.37	66,543,608.80	64.06%	37,331,487.77	35.94%

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	1,725,222.52	1.6609%

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	0~10
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（2012年6月20日）基金份额总额	743,426,623.31
本报告期期初基金份额总额	109,865,517.88
本报告期基金总申购份额	2,400,159.06
减：本报告期基金总赎回份额	8,390,580.37
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	103,875,096.57

§ 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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
五矿证券	2	189,741,498.11	35.05%	134,963.93	33.33%	-
国泰君安	2	150,158,467.78	27.74%	106,808.19	26.37%	-
中金公司	2	99,707,426.94	18.42%	90,863.12	22.44%	-
长江证券	2	59,291,020.58	10.95%	42,173.84	10.41%	-
西南证券	1	42,407,329.95	7.83%	30,164.46	7.45%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	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

五矿证券	1,119,419.20	5.60%	362,700,000.00	60.18%	-	-
国泰君安	12,228,883.82	61.17%	117,500,000.00	19.50%	-	-
中金公司	2,886,766.11	14.44%	122,500,000.00	20.33%	-	-
长江证券	651,802.50	3.26%	-	-	-	-
西南证券	3,106,050.86	15.54%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-

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	安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金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
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	上海证券报	2017年1月25日

	构的公告		
6	安信策略精选灵活配置混合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	2017 年 1 月 26 日
7	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
8	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
9	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
10	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
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	上海证券报、中国证	2017 年 4 月 13 日

	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	券报、证券时报	
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	安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金 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
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	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	20170101-20170630	66,049,537.65	-	-	66,049,537.65	63.59%
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策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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