

# 安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 03 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信新趋势混合	
基金主代码	001710	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	614, 204, 499. 59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
下属分级基金的交易代码:	001710	001711
报告期末下属分级基金的份额总额	604, 144, 027. 88 份	10, 060, 471. 71 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金旨在追求绝对回报，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	罗菲菲
	联系电话	0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95568
传真		0755-82799292	010-58560798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年 12 月 9 日(基金合同生效日) - 2016 年 12 月 31 日	
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
本期已实现收益	34,313,069.12	6,488,502.84	179,458.57	204,723.86
本期利润	41,718,139.07	7,741,806.85	404,377.17	-432,805.08
加权平均基金份额本期利润	0.0773	0.0630	0.0031	-0.0022
本期基金份额净值增长率	7.52%	7.32%	-0.20%	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0028	0.0013	-0.0020	-0.0022
期末基金资产净值	612,221,561.07	10,180,332.23	200,412,308.14	199,831,861.76
期末基金份额净值	1.013	1.012	0.998	0.998

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信新趋势混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.10%	0.11%	1.82%	0.40%	0.28%	-0.29%

过去六个月	3.68%	0.09%	3.97%	0.34%	-0.29%	-0.25%
过去一年	7.52%	0.09%	8.11%	0.32%	-0.59%	-0.23%
自基金合同生效起至今	7.31%	0.09%	5.23%	0.34%	2.08%	-0.25%

安信新趋势混合 C

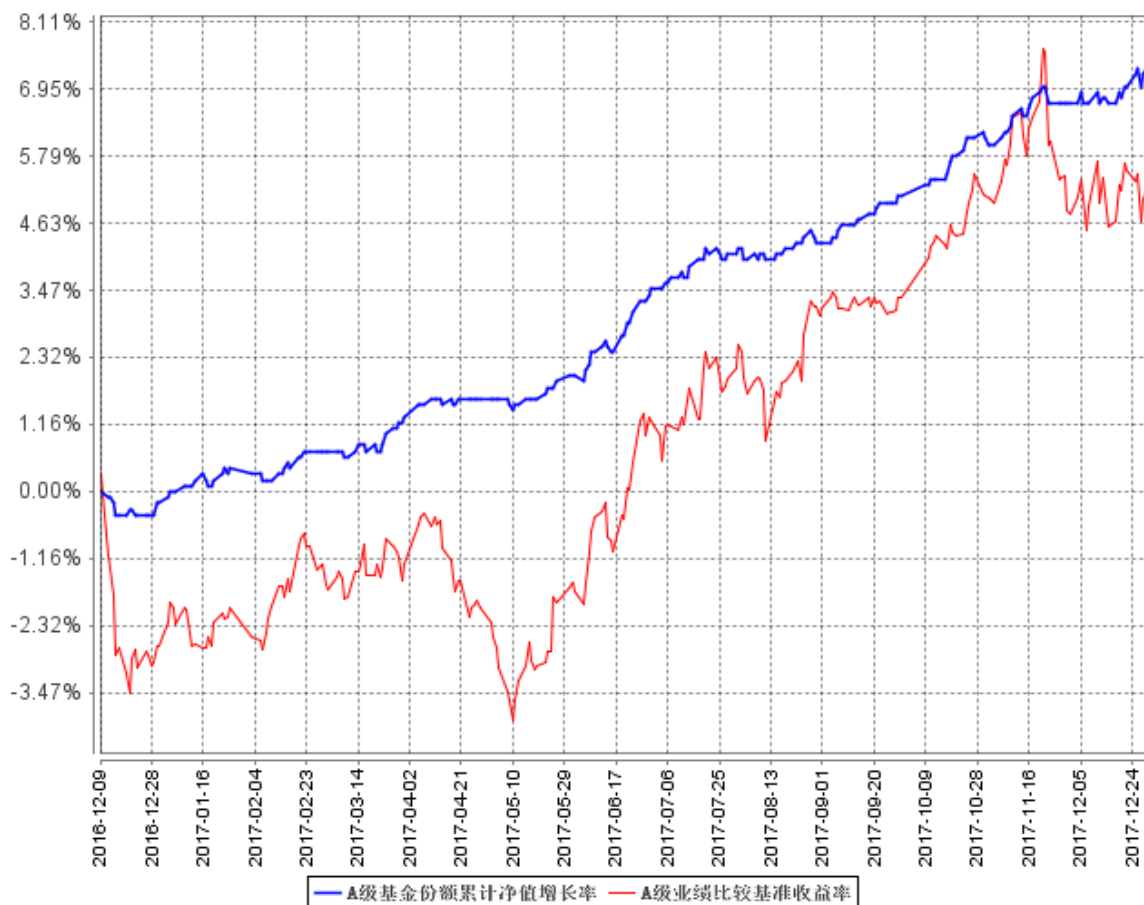
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.01%	0.12%	1.82%	0.40%	0.19%	-0.28%
过去六个月	3.58%	0.10%	3.97%	0.34%	-0.39%	-0.24%
过去一年	7.32%	0.09%	8.11%	0.32%	-0.79%	-0.23%
自基金合同生效起至今	7.11%	0.09%	5.23%	0.34%	1.88%	-0.25%

注：根据《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为： $50\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+50\% \times$ 中债总指数（全价）收益率。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。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

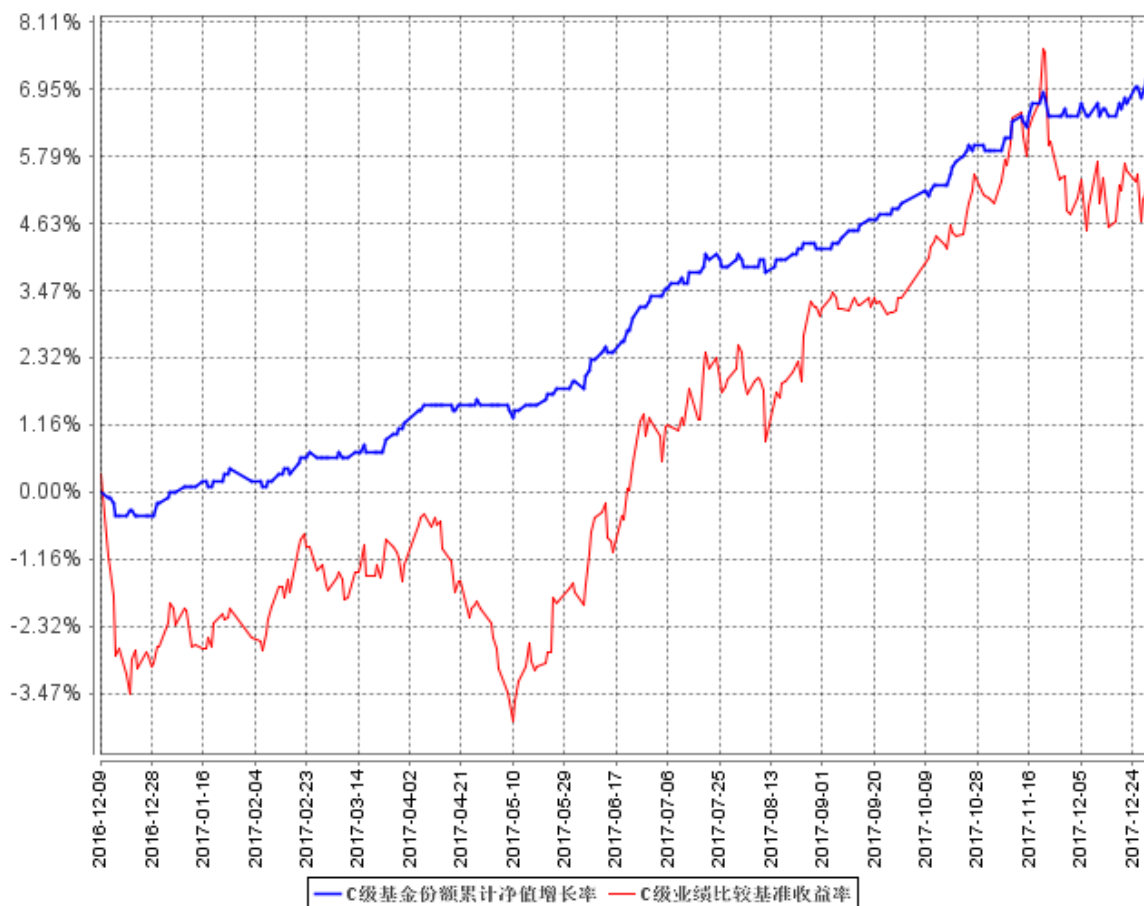
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



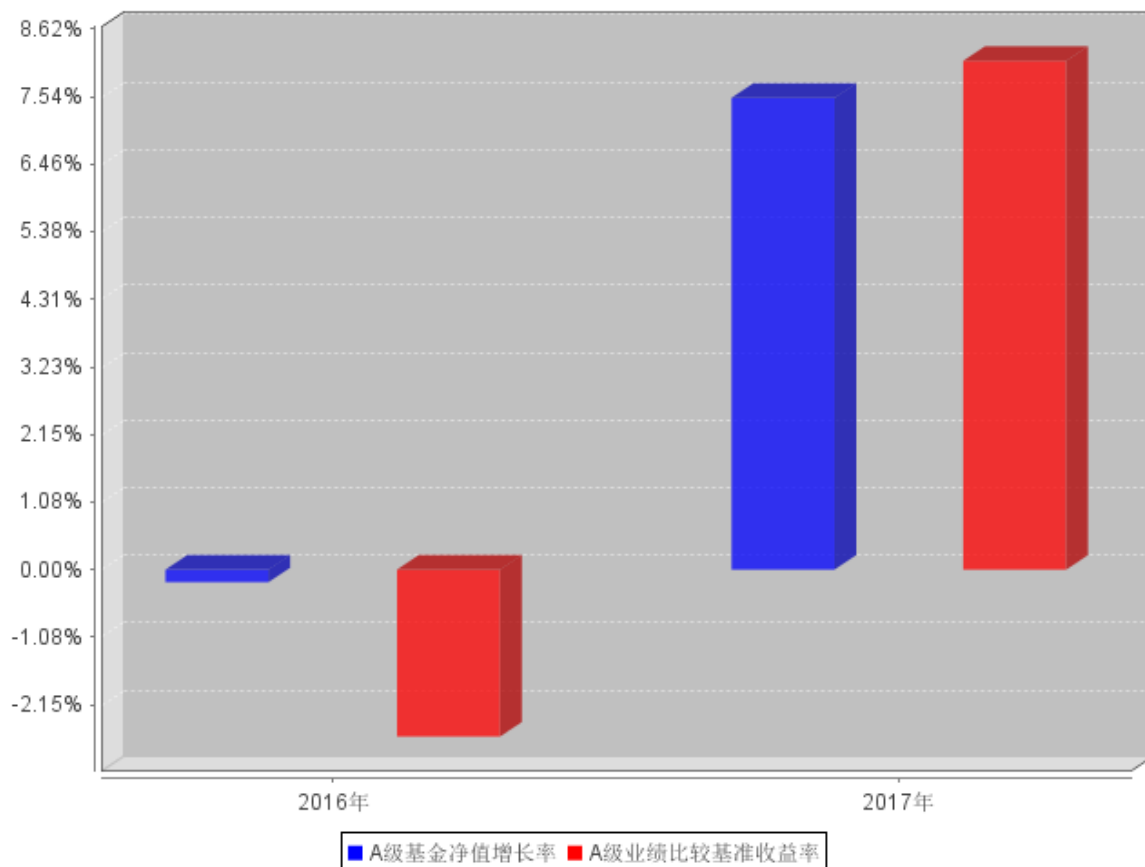
注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 09 日。

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。

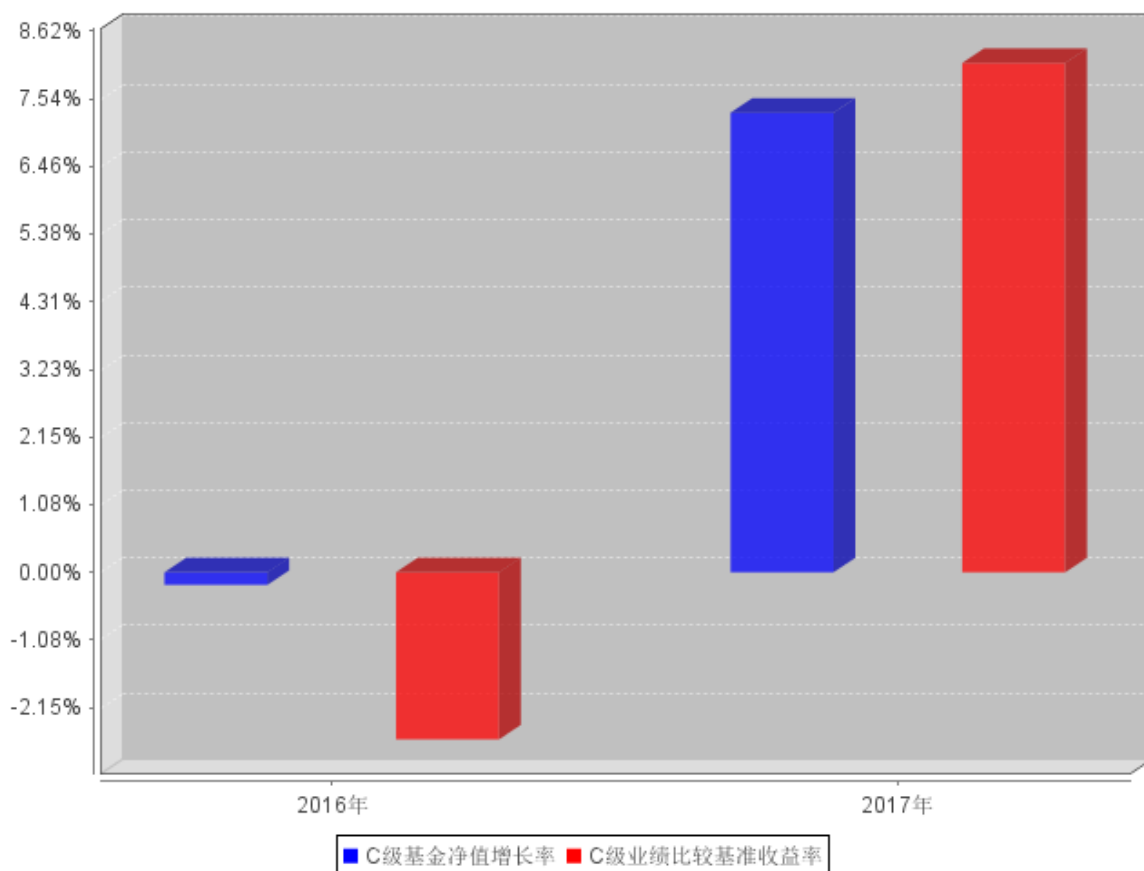


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

安信新趋势混合 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.6000	29,905,941.20	5,988,025.15	35,893,966.35	
2016	-	-	-	-	
合计	0.6000	29,905,941.20	5,988,025.15	35,893,966.35	

单位：人民币元

安信新趋势混合 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.5900	593,573.65	-	593,573.65	
2016	-	-	-	-	
合计	0.5900	593,573.65	-	593,573.65	

## § 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 5.0625 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 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 38 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；从 2017 年 7 月 3 日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 20 日起管理安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 12 月 6 日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金；从 2017 年 12 月 28 日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
张翼飞	本基金的基金经理	2016 年 12 月 9 日	-	6.5 年	张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、财务主管，上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理；现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、

					安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李君	本基金的基金经理	2017 年 12 月 26 日	-	12 年	李君先生，管理学硕士，具有 12 年证券研究投资相关工作经验。历任光大证券研究所研究部行业分析师、国信证券研究所研究部高级行业分析师、上海泽熙投资管理有限公司投资研究部投资研究员、太和先机资产管理有限公司投资研究部研究总监、东方睿德（上海）投资管理有限公司股权投资部投资总监、上海东证橡睿投资管理有限公司投资部总经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王坤	本基金的	2016 年	-	2 年	王坤先生，金融学硕

	基金经理助理	12 月 9 日		<p>士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。现任安信基金目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券式证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。</p>
--	--------	----------	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，2017 年是价值投资的黄金的一年。我们继续坚持了价值投资理念，通过细致的研究分析，筛选估值合理、财务稳健、有增长潜力的价值股进行投资，权益仓位取得了非常好的收益。

债券方面，2017 年在去杠杆的政策大背景下，虽然宏观经济并没有大的波动，但债市的收益率持续上行。期间，我们基于对政策和基本面的研究分析，始终对市场持谨慎的态度；除了少量的中短久期的中高评级债券以外，绝大部分仓位配置了同业存单。始终坚持了短久期、高评级的策略，很好的规避了市场下跌风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新趋势混合 A 基金份额净值为 1.013 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.52%；截至本报告期末安信新趋势混合 C 基金份额净值为 1.012 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.32%；同期业绩比较基准收益率为 8.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，展望 2018 年，我们的观点如下：

1、消费升级导致品牌溢价持续提升，以及优势企业的竞争优势不断确立、稳固、加强，大多数行业的市场份额，有望持续的向优势企业集中，甚至这种集中有加速的趋势。

2、自身业务竞争力不够强，但热衷于通过外延式并购扩张获得增长的中小盘股，在重组定增严监管的态势下，作为资产上市通道的壳资源价值部分，或持续贬值。

3、降杠杆的政策逐步出台的大环境下，虽然债券利率持续上升，但投资债券的可用杠杆程度也在逐步降低，导致债券投资的收益率可能性上限在逐步降低。在这种环境下，更看重估值逻辑的价值股，它的投资的机会成本也在很大程度上也降低了。实际上降杠杆过程，也是蓝筹股价值重估的过程。

4、上市标的逐步增多，以及市场投资者机构化的趋势不断延续，导致大小盘股的流动性差异或将持续拉开，流动性溢价未来将很可能在股价上获得更充分的体现。

5、未来仍然是价值投资的好时代，但经过 1 年多的上涨，部分蓝筹股的价格已经不低，需要加强研究分析工作，不断寻找价格洼地，挖掘价值机会，适时切换标的。

债券方面展望 2018 年，我们的观点如下：

1、经济增速预期仍保持平稳向上，但预期不会有大的惊喜，对债市不构成大的风险。

2、通胀可能略有上行，不过考虑到货币增量持续下降，且去杠杆预期仍将持续，作为一个货币现象的通货膨胀，预期不会有显著的上行。

3、认为 2018 年最值得关注的仍然是去杠杆政策的节奏和进度。这个是整个债市的最大的基本面，我们认为政策的延续虽然毫无疑问，但随着去杠杆政策成效逐渐浮现，例如 M2 增速已经连续很多个月下降，在政策力度上或有别于 2017 年这种逐步加强的过程。

4、我们预期，去杠杆政策力度、实体经济承受力、债券收益率对资金的吸引力，在不是很远的未来，很可能将达到某个可持续的均衡。而当前的债市收益率已经相当可观。2017 年可以概括为“中高票息+负资本利得”时期，2018 年很可能是“高票息+低资本利得”的一年。债市的配置收益率具有相当的吸引力。

#### 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，保证基金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，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。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。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，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 36,487,540.00 元，其中本基金 A 类份额分配 35,893,966.35 元，C 类份额分配 593,573.65 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 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 个工作日基金持有人数不满 200 人的情形，时间范围为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 3 月 1 日，2017 年 3 月 28 日至 2017 年 6 月 5 日，2017 年 6 月 19 日至 2017 年 9 月 4 日，2017 年 9 月 26 日至 2017 年 12 月 7 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金实施利润分配的金额为 36,487,540.00 元，其中本基金 A 类共分配人民币 35,893,966.35 元，C 类共分配人民币 593,573.65 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	12,145,782.46	52,055,588.55
结算备付金	3,872,245.79	-
存出保证金	34,861.39	-
交易性金融资产	823,934,778.02	430,555,681.94
其中：股票投资	63,384,052.62	33,170,148.74
基金投资	-	-
债券投资	760,550,725.40	397,385,533.20
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	601,275.62	-
应收利息	11,036,555.05	8,807,029.62
应收股利	-	-
应收申购款	220.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	851,625,718.33	491,418,300.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	221,449,459.72	46,000,000.00
应付证券清算款	6,757,308.85	44,953,163.87
应付赎回款	-	1,982.19
应付管理人报酬	341,435.13	121,241.68
应付托管费	113,811.70	40,413.89
应付销售服务费	6,073.08	24,014.64
应付交易费用	47,665.79	32,043.79
应交税费	-	-

应付利息	238,070.76	1,270.15
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	270,000.00	-
负债合计	229,223,825.03	91,174,130.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	614,204,499.59	401,075,321.53
未分配利润	8,197,393.71	-831,151.63
所有者权益合计	622,401,893.30	400,244,169.90
负债和所有者权益总计	851,625,718.33	491,418,300.11

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.013 元，C 类基金份额净值人民币 1.012 元。基金份额总额 614,204,499.59 份，其中 A 类基金份额 604,144,027.88 份，C 类基金份额 10,060,471.71 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信新趋势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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 9 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	62,277,165.27	262,629.96
1. 利息收入	36,686,700.51	655,862.92
其中：存款利息收入	135,494.85	37,042.34
债券利息收入	36,339,741.07	346,222.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	211,464.59	272,597.70
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,927,428.23	18,509.34
其中：股票投资收益	18,511,464.48	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,408,379.69	18,509.34
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,824,343.44	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8,658,373.96	-412,610.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	4,662.57	868.04
<b>减：二、费用</b>	<b>12,817,219.35</b>	<b>291,057.87</b>
1. 管理人报酬	4,090,957.90	121,241.68
2. 托管费	1,363,652.66	40,413.89
3. 销售服务费	255,103.95	24,014.64
4. 交易费用	287,770.59	35,099.18
5. 利息支出	6,414,766.20	69,843.48
其中：卖出回购金融资产支出	6,414,766.20	69,843.48
6. 其他费用	404,968.05	445.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>49,459,945.92</b>	<b>-28,427.91</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>49,459,945.92</b>	<b>-28,427.91</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新趋势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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	401,075,321.53	-831,151.63	400,244,169.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,459,945.92	49,459,945.92
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）	213,129,178.06	-3,943,860.58	209,185,317.48
其中：1. 基金申购款	404,227,166.25	2,682,032.45	406,909,198.70
2. 基金赎回款	-191,097,988.19	-6,625,893.03	-197,723,881.22
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）	-	-36,487,540.00	-36,487,540.00
五、期末所有者权益	614,204,499.59	8,197,393.71	622,401,893.30

项目	上年度可比期间		
	2016 年 12 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	200,408,124.74	-	200,408,124.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-28,427.91	-28,427.91
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)	200,667,196.79	-802,723.72	199,864,473.07
其中：1. 基金申购款	200,841,326.19	-803,326.19	200,038,000.00
2. 基金赎回款	-174,129.40	602.47	-173,526.93
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)	401,075,321.53	-831,151.63	400,244,169.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2015 年 7 月 7 日下发的证监许可[2015]1548 号文注册，并根据 2016 年 11 月 8 日机构部函[2016]2713 号文“关于核准安信新趋势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《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，

存续期限不定。

本基金募集期间为2016年11月23日至2016年12月5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(2016)验字60962175\_H70号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,288,079.57元。经向中国证监会备案，《安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月9日正式生效。截至2016年12月7日止，安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币200,288,079.57元，折合200,288,079.57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120,045.17元，折合120,045.17份基金份额。其中A类基金份额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8,928.57元，折合8,928.57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2.40元，折合2.40份基金份额。C类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币200,279,151.00元，折合200,279,151.00份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币120,042.77元，折合120,042.77份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币200,408,124.74元，折合200,408,124.74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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、资产支持证券、银行存款、回购、其他货币市场工具等固定收益类品种，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）、权证等权益类品种，国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金各类资产投资比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除国债期货和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：50%\*沪深300指数收益率+50%\*中债总指数（全价）收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同



时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟上年度会计期间为自 2016 年 12 月 9 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止会计期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：交易性金融资产和应收款项。

本基金目前持有的交易性金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应

付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为交易性金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

交易性金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将交易性金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

（9）公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（10）其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计

量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

### 7.4.6.2 企业所得税

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。

### 7.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

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

中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
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) 根据本基金管理人子公司安信乾盛股东会的有关决议，安信乾盛将其持有 100% 股权子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司进行解散并清算注销，上述注销登记手续已于 2017 年 11 月 30 日在深圳市场监督管理局办理完毕。

3) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 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 12 月 31 日	2016 年 12 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,090,957.90	121,241.68
其中：支付销售机构的客户维护费	136.94	18.02

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 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2016 年 12 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,363,652.66	40,413.89

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费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 为前一日的基金资产净值

### 7.4.8.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C	合计
安信基金	-	254,943.21	254,943.21
安信证券	-	99.44	99.44
合计	-	255,042.65	255,042.65
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		



名称	2016 年 12 月 09 日（基金合同生效日） 至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C	合计
安信基金	-	23,988.24	23,988.24
安信证券	-	25.11	25.11
合计	-	24,013.35	24,013.35

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 12 月 9 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	12,145,782.46	67,687.51	52,055,588.55	37,042.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 146,849,459.72 元，是以如下债券作为质押：

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101575014	15 长经联 MTN001	2018 年 1 月 3 日	99.27	200,000	19,854,000.00
101762019	17 沧州建投 MTN001	2018 年 1 月 3 日	98.68	200,000	19,736,000.00
111780359	17 贵州银行 CD034	2018 年 1 月 3 日	95.05	200,000	19,010,000.00
111771632	17 广州银行 CD106	2018 年 1 月 3 日	94.91	300,000	28,473,000.00
111799837	17 深圳前海微众银行 CD028	2018 年 1 月 3 日	99.24	120,000	11,908,800.00
111781044	17 杭州银行 CD137	2018 年 1 月 5 日	99.59	550,000	54,774,500.00
合计				1,570,000	153,756,300.00

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 74,600,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,384,052.62	7.44
	其中：股票	63,384,052.62	7.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	760,550,725.40	89.31
	其中：债券	760,550,725.40	89.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,018,028.25	1.88
8	其他各项资产	11,672,912.06	1.37
9	合计	851,625,718.33	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,196,452.62	5.17
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	4,790,400.00	0.77
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	12,138,800.00	1.95

K	房地产业	14,258,400.00	2.29
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	63,384,052.62	10.18

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600741	华域汽车	360,041	10,689,617.29	1.72
2	600019	宝钢股份	1,000,028	8,640,241.92	1.39
3	600048	保利地产	606,000	8,574,900.00	1.38
4	601988	中国银行	2,000,000	7,940,000.00	1.28
5	600383	金地集团	450,000	5,683,500.00	0.91
6	600566	济川药业	140,000	5,341,000.00	0.86
7	600104	上汽集团	160,000	5,126,400.00	0.82
8	601318	中国平安	60,000	4,198,800.00	0.67
9	600004	白云机场	280,000	4,116,000.00	0.66
10	600660	福耀玻璃	80,062	2,321,798.00	0.37

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	600019	宝钢股份	8,350,817.22	2.09
2	601398	工商银行	7,593,600.00	1.90
3	600048	保利地产	7,392,848.12	1.85
4	600004	白云机场	6,234,578.32	1.56
5	601318	中国平安	5,996,133.00	1.50
6	600383	金地集团	5,299,381.00	1.32
7	600741	华域汽车	5,290,857.24	1.32
8	600660	福耀玻璃	4,828,983.68	1.21
9	600566	济川药业	4,649,954.00	1.16
10	600887	伊利股份	4,322,227.00	1.08
11	600104	上汽集团	4,162,916.00	1.04
12	601288	农业银行	2,835,000.00	0.71
13	601988	中国银行	2,750,800.00	0.69
14	601390	中国中铁	2,616,856.00	0.65
15	600900	长江电力	2,609,732.00	0.65
16	600066	宇通客车	2,274,493.00	0.57
17	600009	上海机场	2,256,482.32	0.56
18	600018	上港集团	2,148,000.00	0.54
19	601633	长城汽车	1,917,866.00	0.48
20	601012	隆基股份	1,748,094.00	0.44

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601988	中国银行	11,373,300.00	2.84
2	601398	工商银行	10,851,840.00	2.71
3	600066	宇通客车	8,400,295.29	2.10
4	601318	中国平安	5,852,094.92	1.46
5	601288	农业银行	5,090,367.00	1.27
6	600887	伊利股份	5,025,954.00	1.26
7	601633	长城汽车	4,093,027.00	1.02
8	600660	福耀玻璃	3,608,865.00	0.90

9	600004	白云机场	3,438,823.50	0.86
10	600900	长江电力	3,254,153.00	0.81
11	600009	上海机场	3,076,790.42	0.77
12	600018	上港集团	3,066,181.00	0.77
13	600741	华域汽车	2,748,957.76	0.69
14	601390	中国中铁	2,484,284.00	0.62
15	603589	口子窖	2,116,912.00	0.53
16	601012	隆基股份	1,758,175.74	0.44
17	601799	星宇股份	1,663,094.00	0.42
18	600048	保利地产	1,412,719.00	0.35
19	600835	上海机电	992,814.65	0.25
20	600196	复星医药	985,310.90	0.25

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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,921,253.58
卖出股票收入（成交）总额	95,602,767.86

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,165,324.40	25.57
	其中：政策性金融债	159,165,324.40	25.57
4	企业债券	48,976,401.00	7.87
5	企业短期融资券	10,000,000.00	1.61
6	中期票据	123,054,000.00	19.77
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	419,355,000.00	67.38
9	其他	-	-
10	合计	760,550,725.40	122.20

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	1,170,000	115,701,300.00	18.59
2	111781044	17 杭州银行 CD137	1,000,000	99,590,000.00	16.00
3	111717284	17 光大银行 CD284	1,000,000	97,530,000.00	15.67
4	111713153	17 浙商银行 CD153	500,000	48,740,000.00	7.83
5	111771106	17 徽商银行 CD229	500,000	48,720,000.00	7.83

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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



## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,861.39
2	应收证券清算款	601,275.62
3	应收股利	-
4	应收利息	11,036,555.05
5	应收申购款	220.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,672,912.06

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信新趋势混合 A	117	5,163,624.17	604,135,078.34	100.00	8,949.54	0.00
安信新趋势混合 C	28	359,302.56	10,000,000.00	99.40	60,471.71	0.60
合计	145	4,235,893.10	614,135,078.34	99.99	69,421.25	0.01

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)。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信新趋势混合 A	992.11	0.0002
	安信新趋势混合 C	-	-
	合计	992.11	0.0002

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	安信新趋势混合 A	0
	安信新趋势混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信新趋势混合 A	0
	安信新趋势混合 C	0
	合计	0



### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信新趋势混合 A	安信新趋势混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日） 基金份额总额	8,930.97	200,399,193.77
本报告期期初基金份额总额	200,811,139.81	200,264,181.72
本报告期基金总申购份额	403,360,787.50	866,378.75
减：本报告期基金总赎回份额	27,899.43	191,070,088.76
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	604,144,027.88	10,060,471.71

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 70,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	4	187,691,045.57	100.00%	160,262.20	100.00%	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	388,142,210.37	100.00%	8,262,600,000.00	100.00%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20170101-20170605	200,120,000.00	-	190,120,000.00	10,000,000.00	1.63
	2	20170101-20171231	200,802,208.84	99,799,401.20	-	300,601,610.04	48.94
	3	20170328-20171231	-	197,822,947.58	-	197,822,947.58	32.21
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日