

# 安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告

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：招商证券股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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	17
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	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
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 .....	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	65
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 .....	65
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 .....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信优势增长混合	
基金主代码	001287	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 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	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	41,474,729.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C
下属分级基金的交易代码	001287	002036
报告期末下属分级基金的份额总额	38,762,260.60 份	2,712,468.58 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严谨细致的逻辑和基本面分析为基础，通过自上而下和自下而上结合，把握经济转型发展期具有较高增长潜力的上市公司的投资机会，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	资产配置方面，通过对基本面数据的分析和逻辑梳理，分析比较大类资产的风险收益比，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例；股票投资方面，主要从行业配置和个股精选两个层面进行投资；固定收益类投资方面，根据宏观数据和市场交易情况，合理判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势，构建固定收益类债券投资组合；此外，本基金还采用股指期货投资策略、权证投资策略、低风险套利型投资策略等衍生品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×50%+中证综合债券指数收益率×50%。
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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	郭杰
	联系电话	0755-82509999	0755-82943666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95565
传真		0755-82799292	0755-82960794
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
邮政编码		518026	518035
法定代表人		刘入领	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	安信优势增长 混合 A	安信优势增长 混合 C	安信优势增长 混合 A	安信优势增 长混合 C	安信优势增长混 合 A	安信优势增长 混合 C
本期 已实 现收 益	2,292,336.87	111,081.29	3,609,054.19	30,927,961.62	234,744,378.92	4,790,858.34
本期 利润	3,969,811.71	1,026,131.33	2,515,054.73	27,504,920.40	235,269,826.43	8,712,048.96
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.2981	0.1239	0.0329	0.0370	0.0511	0.0038
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	23.01%	10.88%	3.10%	3.48%	5.11%	0.36%
本 期	40.58%	40.30%	3.04%	2.95%	5.20%	0.38%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末 可供 分配 利润	13,436,907.63	727,628.40	1,132,401.74	151.64	8,504,884.83	107,795,738.48
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.3466	0.2683	0.0837	0.0833	0.0364	0.0502
期末 基金 资产 净值	59,068,398.23	4,121,671.21	14,667,616.59	1,971.48	245,709,066.36	2,260,444,048.96
期末 基金 份额 净值	1.5239	1.5195	1.084	1.083	1.052	1.052
3.1. 3 累	2017 年末		2016 年末		2015 年末	

计期末指标						
基金份额累计净值增长率	52.39%	44.99%	8.40%	3.34%	5.20%	0.38%

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。

4、根据我公司 2015 年 11 月 17 日《关于安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 17 日起，本基金增加 C 类份额。C 类份额自 2015 年 11 月 18 日起有份额。

### 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

安信优势增长混合 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	14.15%	1.20%	2.31%	0.41%	11.84%	0.79%
过去六个月	31.29%	0.98%	5.01%	0.35%	26.28%	0.63%
过去一年	40.58%	0.81%	10.65%	0.32%	29.93%	0.49%
自基金合同生效起至今	52.39%	0.52%	-2.11%	0.83%	54.50%	-0.31%

安信优势增长混合 C

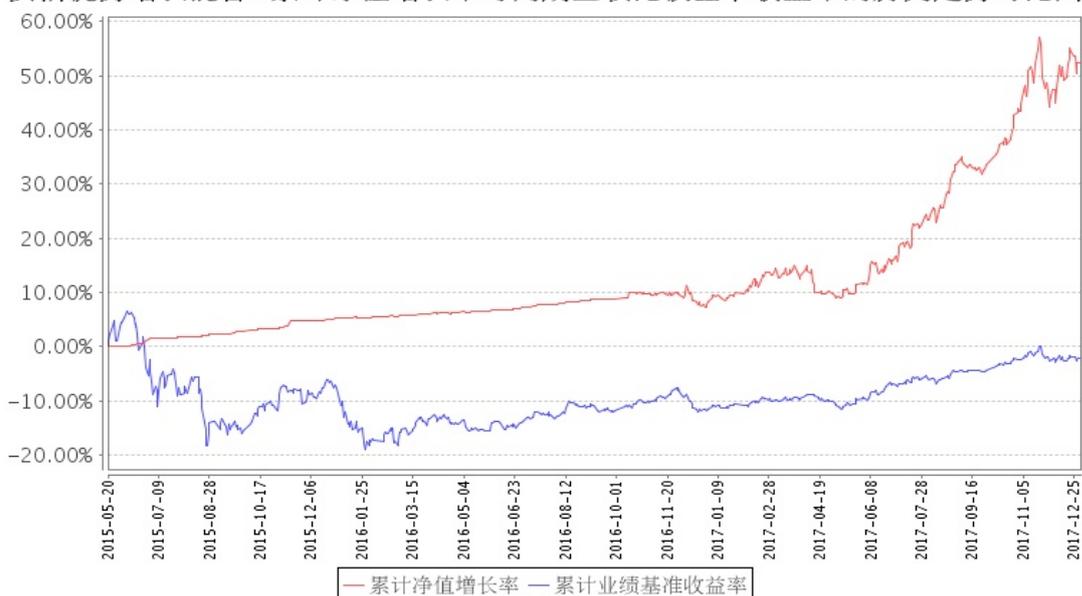
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.09%	1.20%	2.31%	0.41%	11.78%	0.79%
过去六个月	31.12%	0.98%	5.01%	0.35%	26.11%	0.63%
过去一年	40.30%	0.81%	10.65%	0.32%	29.65%	0.49%
自基金合同生效起至今	44.99%	0.58%	6.55%	0.57%	38.44%	0.01%

注：根据《安信优势增长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：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。其中沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 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

安信优势增长混合A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



安信优势增长混合C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



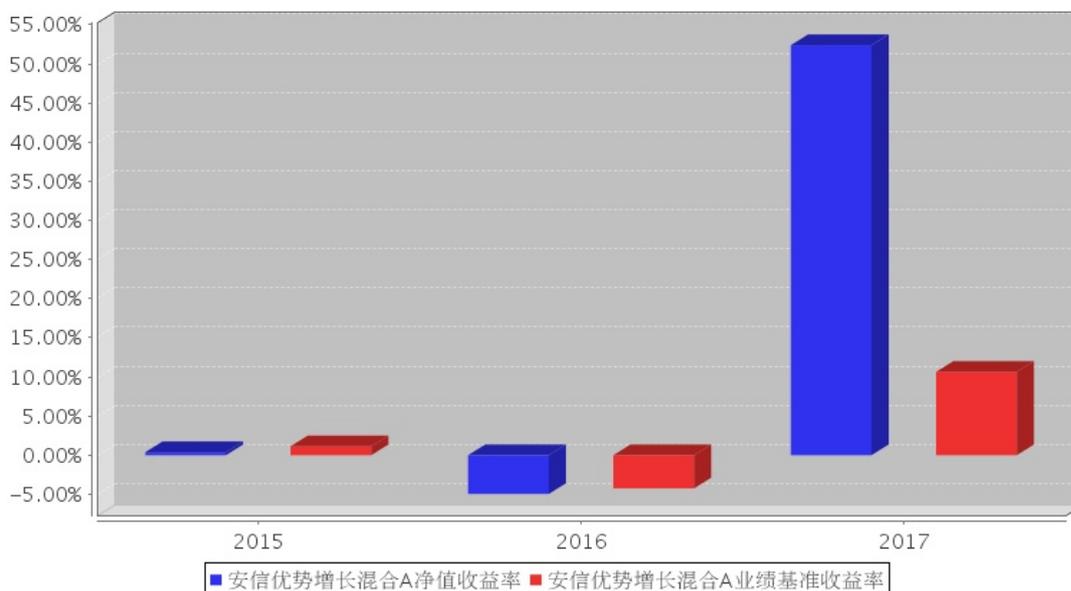
注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 20 日。

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。

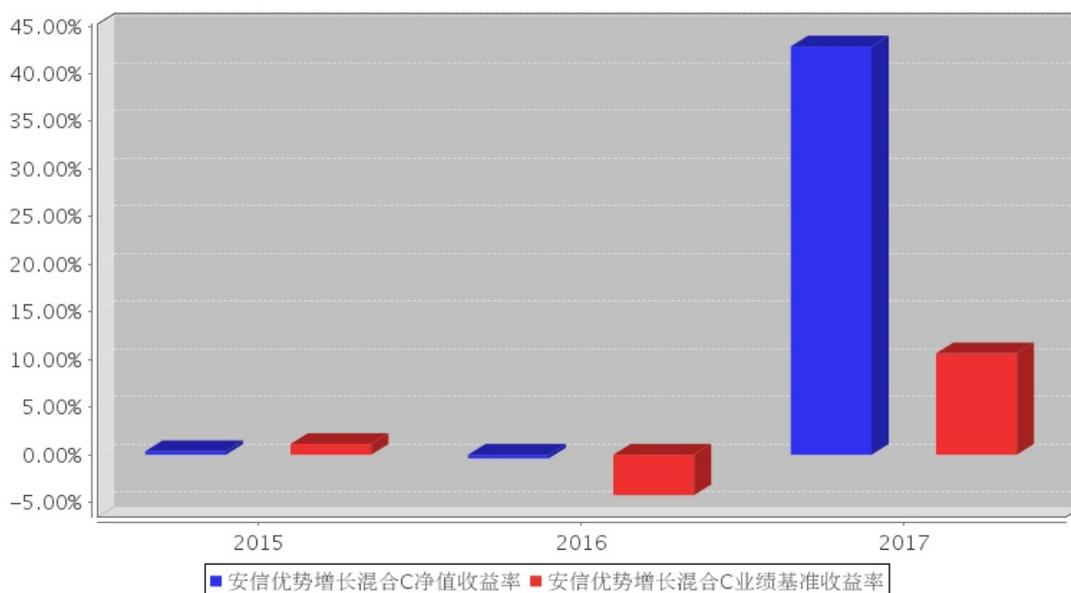
3、根据我公司 2015 年 11 月 17 日《关于安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 17 日起，本基金增加 C 类份额。C 类份额自 2015 年 11 月 18 日起有份额。

### 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

安信优势增长混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信优势增长混合C基金每年净值增长率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

本基金于 2015 年 5 月 20 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 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		
聂世林	本基金的基金经理	2016 年 2 月 18 日	-	9.0 年	聂世林先生，经济学硕士。历任安信证券股份有限公司资产管理部研究员、证券投资部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部、权益投资部基金经理助理，现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金的基金经理助理，现任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合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遵规守信情况的说明

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

从 2017 年全年来看，市场经历了供给侧改革、十九大维稳以及金融降杠杆的影响，板块之间的风格严重分化。市场一致看多消费白马，中小创和次新股等高风险偏好类的板块由于业绩大面积下滑，加速赶底。

本基金在全年主要以持有消费和高端制造为主。4 月初以及 11 月两次调整未能及时回避，主要是对存量资金格局下，主题、周期的边际变化有所误判。站在当前时点，我们认为消费、医药等板块的业绩大概率将保持高增长，板块估值依然合理，但是周期的性价比在凸显，周期行业的盈利可能会好于市场预期。一方面是地产投资在 2018 年可能会高于之前悲观预期，另一方面是产能的扩张依然受限，周期盈利将继续维持高位。此外 5G、半导体、创新药、高端制造等新兴产业也在孕育大量的投资机会，我们对此长期看好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信优势增长混合 A 基金份额净值为 1.5239 元,本报告期基金份额净值增长率为 40.58%;截至本报告期末安信优势增长混合 C 基金份额净值为 1.5195 元,本报告期基金份额净值增长率为 40.30%;同期业绩比较基准收益率为 10.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面,基建和地产投资可能会继续保持相对平稳略有下降趋势;消费出现一定的复苏迹象;出口受人民币升值影响,可能面临一定压力。总体而言,经济基本面会维持相对平稳的格局。金融降杠杆持续影响资金面,2018 年的宏观政策依然以降杠杆为主基调,利率大概率维持相对高位,流动性中偏紧,因此权益市场增量资金可能依然有限。

白马龙头的业绩增长依然维持高于行业水平,经过 2017 年的上涨,从相对低估进入到合理区间,但 2018 年不排除会出现估值溢价。中小成长类股票由于业绩大面积低于预期,导致风险偏好继续下降。市场的主要机会可能来自低估值的大盘蓝筹:一方面是其盈利稳定,大盘白马类公司业绩增速确定性高,风险较小,流动性好;另一方面绝对估值低,以银行地产为例,绝对估值处于历史中枢的下限,博弈格局相对较好。龙头公司受政策调整影响小,市占率反而提升。周期性行业受益于供给侧改革,全年盈利有望维持高位,存在阶段性机会。

展望 2018 年全年,我们继续坚持看好消费类白马龙头,银行和地产的龙头公司出现边际上的改善,有较大机会。如果通胀预期上升,大众消费品也将受益。中小盘的成长股,可能依然需要 2-3 个季度的业绩确认,再看右侧的机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。时间范围为 2017 年 2 月 3 日至 2017 年 4 月 21 日，2017 年 5 月 24 日至 2017 年 8 月 16 日，2017 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 22 日。

本报告期内，本基金基金资产净值出现了连续 60 个工作日低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。截止报告期末本基金基金资产净值已不低于五千万元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、2017 年度所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，</p>

	<p>我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	<p>无。</p>
其他事项	<p>无。</p>
其他信息	<p>安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认</p>

	<p>为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>昌华</p>	<p>高鹤</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层</p>	

审计报告日期	2018 年 3 月 28 日
--------	-----------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信优势增长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	附注号	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	7.4.7.1	4,398,981.18	3,383,245.82
结算备付金		514,288.85	553,607.98
存出保证金		61,204.66	65,103.98
交易性金融资产	7.4.7.2	58,496,589.94	9,250,929.89
其中：股票投资		58,496,589.94	9,250,929.89
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,823,093.99
应收利息	7.4.7.5	2,347.17	2,790.99
应收股利		-	-
应收申购款		316,605.79	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		63,790,017.59	15,078,772.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2017年12月31日</b>	<b>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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		170,963.87	-
应付赎回款		225,550.47	4,339.65
应付管理人报酬		49,648.02	12,958.95
应付托管费		9,929.60	2,591.77
应付销售服务费		730.61	0.31
应付交易费用	7.4.7.7	112,898.33	39,293.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	30,227.25	350,000.00
负债合计		599,948.15	409,184.58
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	41,474,729.18	13,537,034.69
未分配利润	7.4.7.10	21,715,340.26	1,132,553.38
所有者权益合计		63,190,069.44	14,669,588.07
负债和所有者权益总计		63,790,017.59	15,078,772.65

注：截至本报告期末，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.5239 元，C 类基金份额净值人民币 1.5195 元；基金份额总额 41,474,729.18 份，其中 A 类基金份额 38,762,260.60 份，C 类基金份额 2,712,468.58 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信优势增长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	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		6,144,310.80	44,595,401.82
1. 利息收入		204,171.59	26,827,950.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	88,553.75	1,978,387.99
债券利息收入		-	20,567,612.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		115,617.84	4,281,950.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,951,335.13	22,024,681.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,800,187.45	17,832,177.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	3,775,692.19
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	151,147.68	416,811.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,592,524.88	-4,517,040.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	396,279.20	259,810.18
<b>减：二、费用</b>		1,148,367.76	14,575,426.69

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	268,162.49	8,873,636.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	53,632.50	1,775,052.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	19,664.88	1,608,634.46
4. 交易费用	7.4.7.19	740,007.89	260,200.48
5. 利息支出		-	1,667,503.63
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,667,503.63
6. 其他费用	7.4.7.20	66,900.00	390,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,995,943.04	30,019,975.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,995,943.04	30,019,975.13

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信优势增长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）	13,537,034.69	1,132,553.38	14,669,588.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,995,943.04	4,995,943.04
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）	27,937,694.49	15,586,843.84	43,524,538.33
其中：1. 基金申购款	164,148,372.75	37,618,103.66	201,766,476.41
2. 基金赎回款	-136,210,678.26	-22,031,259.82	-158,241,938.08
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）	-	-	-



本基金募集期间为 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 15 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\_H42 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 4,558,883,275.97 元。经向中国证监会备案，《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 20 日正式生效。截至 2015 年 5 月 20 日止，安信优势增长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 4,558,883,275.97 元，折合 4,558,883,275.97 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 275,616.80 元，折合 275,616.80 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 4,559,158,892.77 元，折合 4,559,158,892.77 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同，经基金管理人安信基金管理有限责任公司与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，自 2015 年 11 月 17 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。原有的基金份额全部自动转为安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 A 类份额。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金各类资产投资比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债券指数收益率\*50%。

#### 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。

#### 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费用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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,398,981.18	3,383,245.82
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	4,398,981.18	3,383,245.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		55,974,467.61	58,496,589.94	2,522,122.33
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		55,974,467.61	58,496,589.94	2,522,122.33
项目		上年度末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,321,332.44	9,250,929.89	-70,402.55
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		9,321,332.44	9,250,929.89	-70,402.55

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	2,062.27	2,484.75
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	254.65	274.01
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	30.25	32.23
合计	2,347.17	2,790.99

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	112,898.33	37,818.90
银行间市场应付交易费用	-	1,475.00
合计	112,898.33	39,293.90

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	227.25	-
审计费	30,000.00	50,000.00
信息披露费	-	300,000.00
合计	30,227.25	350,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信优势增长混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,535,214.85	13,535,214.85
本期申购	41,565,477.14	41,565,477.14
本期赎回（以“-”号填列）	-16,338,431.39	-16,338,431.39
本期末	38,762,260.60	38,762,260.60

金额单位：人民币元

安信优势增长混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,819.84	1,819.84

本期申购	122,582,895.61	122,582,895.61
本期赎回（以“-”号填列）	-119,872,246.87	-119,872,246.87
本期末	2,712,468.58	2,712,468.58

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信优势增长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,255,227.27	-122,825.53	1,132,401.74
本期利润	2,292,336.87	1,677,474.84	3,969,811.71
本期基金份额交易产生的变动数	9,889,343.49	5,314,580.69	15,203,924.18
其中：基金申购款	14,046,247.79	6,253,629.68	20,299,877.47
基金赎回款	-4,156,904.30	-939,048.99	-5,095,953.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,436,907.63	6,869,230.00	20,306,137.63
安信优势增长混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	182.42	-30.78	151.64
本期利润	111,081.29	915,050.04	1,026,131.33
本期基金份额交易产生的变动数	616,364.69	-233,445.03	382,919.66
其中：基金申购款	16,597,479.61	720,746.58	17,318,226.19
基金赎回款	-15,981,114.92	-954,191.61	-16,935,306.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	727,628.40	681,574.23	1,409,202.63

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	75,290.58	745,901.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	1,191,935.56
结算备付金利息收入	9,907.86	39,001.38
其他	3,355.31	1,549.08
合计	88,553.75	1,978,387.99

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	271,060,839.09	100,648,326.74
减：卖出股票成本总额	268,260,651.64	82,816,149.55
买卖股票差价收入	2,800,187.45	17,832,177.19

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	3,699,800,309.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	3,662,709,387.00
减：应收利息总额	-	33,315,230.78
买卖债券差价收入	-	3,775,692.19

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	151,147.68	416,811.97
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	151,147.68	416,811.97

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	2,592,524.88	-4,517,040.68
股票投资	2,592,524.88	-3,951,770.68
债券投资	-	-565,270.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-

其他	-	-
合计	2,592,524.88	-4,517,040.68

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
基金赎回费收入	295,904.92	259,806.64
转换费收入	374.28	3.54
其他	100,000.00	-
合计	396,279.20	259,810.18

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
交易所市场交易费用	739,832.89	232,800.48
银行间市场交易费用	175.00	27,400.00
合计	740,007.89	260,200.48

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
审计费	30,000.00	50,000.00
信息披露费	-	300,000.00
账户维护费	36,900.00	40,400.00
其他	-	-

合计	66,900.00	390,400.00
----	-----------	------------

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除在 7.4.6.3 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

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

2、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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
安信证券	408,567,814.33	69.73	39,325,387.45	23.88

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
安信证券	753,600,000.00	87.78	126,700,000.00	2.46

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)

安信证券	290,615.23	69.73	112,898.33	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	27,972.79	23.84	27,972.79	73.97

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	268,162.49	8,873,636.10
其中：支付销售机构的客户维护费	37,301.09	37,205.56

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的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	53,632.50	1,775,052.02
----------------	-----------	--------------

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的基金资产净值的 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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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		
	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C	合计
安信基金	-	19,664.27	19,664.27
合计	-	19,664.27	19,664.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C	合计
安信基金	-	1,608,634.46	1,608,634.46
合计	-	1,608,634.46	1,608,634.46

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，安信优势增长混合 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 20 日）持有的基金份额	-	
期初持有的基金份额	-	
期间申购/买入总份额	-	2,390,819.25
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	-	2,390,819.25
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	5.76%
项目	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 20 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1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
招商证券	4,398,981.18	75,290.58	3,383,245.82	745,901.97

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项	6.67	2018年2月26日	7.28	46,100	336,479.88	307,487.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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，无抵押债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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，无抵押债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券资产（截至 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券资产）。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	4,398,981.18	-	-	-	4,398,981.18
结算备付金	514,288.85	-	-	-	514,288.85
存出保证金	61,204.66	-	-	-	61,204.66
交易性金融资产	-	-	-	58,496,589.94	58,496,589.94
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,347.17	2,347.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	316,605.79	316,605.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,974,474.69	-	-	58,815,542.90	63,790,017.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	225,550.47	225,550.47

应付管理人报酬	-	-	-	49,648.02	49,648.02
应付托管费	-	-	-	9,929.60	9,929.60
应付证券清算款	-	-	-	170,963.87	170,963.87
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	730.61	730.61
应付交易费用	-	-	-	112,898.33	112,898.33
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	30,227.25	30,227.25
负债总计	-	-	-	599,948.15	599,948.15
利率敏感度缺口	4,974,474.69	-	-	-58,215,594.75	63,190,069.44
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,383,245.82	-	-	-	3,383,245.82
结算备付金	553,607.98	-	-	-	553,607.98
存出保证金	65,103.98	-	-	-	65,103.98
交易性金融资产	-	-	-	9,250,929.89	9,250,929.89
应收证券清算款	-	-	-	1,823,093.99	1,823,093.99
应收利息	-	-	-	2,790.99	2,790.99
资产总计	4,001,957.78	-	-	-11,076,814.87	15,078,772.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,339.65	4,339.65
应付管理人报酬	-	-	-	12,958.95	12,958.95
应付托管费	-	-	-	2,591.77	2,591.77
应付销售服务费	-	-	-	0.31	0.31
应付交易费用	-	-	-	39,293.90	39,293.90
其他负债	-	-	-	350,000.00	350,000.00

负债总计	-	-	-	409,184.58	409,184.58
利率敏感度缺口	4,001,957.78	-	-	-10,667,630.29	14,669,588.07

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	58,496,589.94	92.57	9,250,929.89	63.06
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,496,589.94	92.57	9,250,929.89	63.06

#### 7.4.13.4.3.2 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		
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 12 月 31 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)	
分析	1、沪深 300 指数上升 5%	2,954,629.34	771,598.13
	2、沪深 300 指数下降 5%	-2,954,629.34	-771,598.13

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

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

###### 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 58,189,102.94 元, 划分为第二层级的余额为 307,487.00, 无划分为第三层级余额 (于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 9,250,929.89 元, 无划分为第二层级余额, 无划分为第三层级余额)。

### 公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

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

### 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,496,589.94	91.70
	其中：股票	58,496,589.94	91.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,913,270.03	7.70
8	其他各项资产	380,157.62	0.60
9	合计	63,790,017.59	100.00

## 8.2 报告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

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	4,686,987.56	7.42
B	采矿业	3,455,217.00	5.47
C	制造业	29,964,185.86	47.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	298,207.00	0.47
J	金融业	13,704,821.62	21.69
K	房地产业	3,180,670.90	5.03
L	租赁和商务服务业	2,583,680.00	4.09
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	622,820.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	58,496,589.94	92.57

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	60,647	4,244,077.06	6.72
2	000858	五粮液	47,100	3,762,348.00	5.95
3	600519	贵州茅台	5,300	3,696,697.00	5.85
4	600887	伊利股份	112,200	3,611,718.00	5.72
5	002008	大族激光	72,700	3,591,380.00	5.68
6	601601	中国太保	72,568	3,005,766.56	4.76
7	600741	华域汽车	93,200	2,767,108.00	4.38
8	000513	丽珠集团	38,900	2,584,905.00	4.09
9	600196	复星医药	57,500	2,558,750.00	4.05
10	600703	三安光电	95,274	2,419,006.86	3.83
11	000001	平安银行	179,100	2,382,030.00	3.77
12	002714	牧原股份	39,946	2,111,545.56	3.34
13	300498	温氏股份	82,900	1,981,310.00	3.14
14	002027	分众传媒	137,300	1,933,184.00	3.06
15	601699	潞安环能	167,900	1,910,702.00	3.02
16	601939	建设银行	248,600	1,909,248.00	3.02
17	000002	万科 A	60,765	1,887,360.90	2.99
18	601398	工商银行	296,900	1,840,780.00	2.91
19	601012	隆基股份	48,400	1,763,696.00	2.79
20	600048	保利地产	91,400	1,293,310.00	2.05
21	601666	平煤股份	147,700	930,510.00	1.47
22	300568	星源材质	29,700	792,396.00	1.25
23	600779	水井坊	14,700	687,960.00	1.09
24	000796	凯撒旅游	46,200	650,496.00	1.03

25	300251	光线传媒	59,600	622,820.00	0.99
26	601088	中国神华	26,500	614,005.00	0.97
27	000998	隆平高科	23,100	594,132.00	0.94
28	002709	天赐材料	12,800	588,672.00	0.93
29	000725	京东方 A	100,800	583,632.00	0.92
30	601336	新华保险	4,600	322,920.00	0.51
31	601600	中国铝业	46,100	307,487.00	0.49
32	002405	四维图新	11,300	298,207.00	0.47
33	300136	信维通信	4,900	248,430.00	0.39

#### 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	600028	中国石化	8,187,297.00	55.81
2	601318	中国平安	7,844,377.00	53.47
3	601398	工商银行	7,634,457.00	52.04
4	601939	建设银行	7,539,898.00	51.40
5	600519	贵州茅台	6,997,386.51	47.70
6	601601	中国太保	6,603,573.00	45.02
7	600703	三安光电	6,360,495.84	43.36
8	601336	新华保险	5,832,851.00	39.76
9	601988	中国银行	5,725,948.00	39.03
10	000858	五粮液	4,925,910.00	33.58
11	002714	牧原股份	4,758,595.00	32.44
12	601328	交通银行	4,688,881.00	31.96
13	601333	广深铁路	4,298,638.00	29.30
14	601985	中国核电	4,298,432.00	29.30
15	300498	温氏股份	4,295,882.12	29.28
16	600900	长江电力	4,279,852.00	29.17
17	002008	大族激光	4,099,283.97	27.94
18	600048	保利地产	3,929,204.00	26.78

19	300113	顺网科技	3,860,766.36	26.32
20	601688	华泰证券	3,754,005.00	25.59
21	600959	江苏有线	3,584,642.00	24.44
22	600887	伊利股份	3,534,189.00	24.09
23	000063	中兴通讯	3,387,076.00	23.09
24	002739	万达电影	3,289,293.00	22.42
25	601699	潞安环能	3,236,766.00	22.06
26	000002	万科A	3,110,699.45	21.21
27	601628	中国人寿	3,066,068.29	20.90
28	300033	同花顺	3,025,159.00	20.62
29	601088	中国神华	3,023,518.00	20.61
30	000001	平安银行	2,996,706.00	20.43
31	002230	科大讯飞	2,820,166.00	19.22
32	600741	华域汽车	2,789,189.02	19.01
33	000513	丽珠集团	2,674,722.11	18.23
34	002027	分众传媒	2,673,386.00	18.22
35	600196	复星医药	2,661,644.96	18.14
36	600085	同仁堂	2,641,924.69	18.01
37	600779	水井坊	2,605,301.00	17.76
38	600581	八一钢铁	2,432,185.00	16.58
39	002555	三七互娱	2,407,079.00	16.41
40	601998	中信银行	2,318,485.00	15.80
41	601186	中国铁建	2,273,617.30	15.50
42	600176	中国巨石	2,202,708.00	15.02
43	300433	蓝思科技	2,175,991.88	14.83
44	601899	紫金矿业	2,153,760.00	14.68
45	601012	隆基股份	2,088,467.00	14.24
46	600585	海螺水泥	2,068,899.28	14.10
47	002372	伟星新材	1,938,962.00	13.22
48	600873	梅花生物	1,893,228.00	12.91
49	000651	格力电器	1,819,348.00	12.40
50	601225	陕西煤业	1,809,622.00	12.34
51	300104	乐视网	1,779,952.15	12.13
52	300059	东方财富	1,767,243.80	12.05
53	002831	裕同科技	1,746,342.00	11.90
54	603993	洛阳钼业	1,729,514.00	11.79

55	002466	天齐锂业	1,683,930.43	11.48
56	600109	国金证券	1,677,005.00	11.43
57	600872	中炬高新	1,594,757.16	10.87
58	600195	中牧股份	1,523,281.00	10.38
59	600428	中远海特	1,512,174.00	10.31
60	300017	网宿科技	1,503,016.79	10.25
61	601666	平煤股份	1,487,500.00	10.14
62	000725	京东方 A	1,456,125.00	9.93
63	600372	中航电子	1,436,436.00	9.79
64	600037	歌华有线	1,434,880.00	9.78
65	601117	中国化学	1,433,745.00	9.77
66	600383	金地集团	1,384,899.00	9.44
67	002343	慈文传媒	1,384,478.00	9.44
68	002304	洋河股份	1,368,992.20	9.33
69	002475	立讯精密	1,366,013.00	9.31
70	600409	三友化工	1,353,160.00	9.22
71	600030	中信证券	1,301,888.00	8.87
72	000998	隆平高科	1,280,160.00	8.73
73	300251	光线传媒	1,266,255.80	8.63
74	600584	长电科技	1,261,416.00	8.60
75	600019	宝钢股份	1,258,289.00	8.58
76	000807	云铝股份	1,234,388.00	8.41
77	601600	中国铝业	1,180,424.00	8.05
78	601155	新城控股	1,160,766.00	7.91
79	000761	本钢板材	1,158,284.00	7.90
80	002497	雅化集团	1,150,705.00	7.84
81	300568	星源材质	1,142,635.80	7.79
82	000732	泰禾集团	1,096,529.00	7.47
83	300284	苏交科	1,058,014.00	7.21
84	000877	天山股份	1,056,687.00	7.20
85	000789	万年青	1,051,404.00	7.17
86	002340	格林美	1,008,039.00	6.87
87	300054	鼎龙股份	1,004,000.00	6.84
88	600570	恒生电子	993,724.00	6.77
89	002074	国轩高科	970,157.00	6.61
90	601668	中国建筑	951,738.00	6.49

91	002405	四维图新	949,207.00	6.47
92	300296	利亚德	929,609.00	6.34
93	600970	中材国际	928,246.00	6.33
94	000796	凯撒旅游	924,564.00	6.30
95	601375	中原证券	916,191.00	6.25
96	002192	融捷股份	914,029.00	6.23
97	002709	天赐材料	894,438.00	6.10
98	600909	华安证券	881,401.00	6.01
99	000776	广发证券	877,202.00	5.98
100	000717	韶钢松山	869,590.00	5.93
101	601965	中国汽研	860,086.00	5.86
102	600486	扬农化工	859,982.00	5.86
103	300327	中颖电子	858,667.00	5.85
104	600029	南方航空	839,876.06	5.73
105	601933	永辉超市	832,308.00	5.67
106	002019	亿帆医药	806,757.00	5.50
107	002078	太阳纸业	804,221.00	5.48
108	601288	农业银行	778,134.00	5.30
109	002037	久联发展	778,044.00	5.30
110	601008	连云港	742,377.00	5.06
111	600201	生物股份	740,077.00	5.04
112	002299	圣农发展	728,695.00	4.97
113	000026	飞亚达 A	717,024.00	4.89
114	600674	川投能源	716,680.00	4.89
115	600545	卓郎智能	715,351.00	4.88
116	300178	腾邦国际	703,815.00	4.80
117	002688	金河生物	697,881.00	4.76
118	002746	仙坛股份	692,711.00	4.72
119	600466	蓝光发展	685,222.00	4.67
120	000671	阳光城	681,456.00	4.65
121	002024	苏宁云商	674,657.00	4.60
122	000800	一汽轿车	674,492.00	4.60
123	000402	金融街	663,315.44	4.52
124	002815	崇达技术	655,384.00	4.47
125	600702	沱牌舍得	646,713.00	4.41
126	000488	晨鸣纸业	641,314.00	4.37

127	600438	通威股份	639,283.00	4.36
128	000983	西山煤电	629,662.00	4.29
129	601390	中国中铁	627,168.00	4.28
130	000537	广宇发展	618,361.00	4.22
131	300197	铁汉生态	617,260.00	4.21
132	002431	棕榈股份	617,098.00	4.21
133	002707	众信旅游	597,866.00	4.08
134	000906	浙商中拓	595,786.00	4.06
135	002302	西部建设	594,342.00	4.05
136	002460	赣锋锂业	581,721.00	3.97
137	000546	金圆股份	580,684.00	3.96
138	002713	东易日盛	576,029.00	3.93
139	002635	安洁科技	551,073.00	3.76
140	601881	中国银河	534,849.00	3.65
141	300070	碧水源	534,291.00	3.64
142	600031	三一重工	534,184.00	3.64
143	300136	信维通信	528,562.00	3.60
144	600522	中天科技	525,332.00	3.58
145	000656	金科股份	519,181.00	3.54
146	002458	益生股份	517,936.00	3.53
147	300426	唐德影视	513,628.00	3.50
148	300386	飞天诚信	503,831.00	3.43
149	600259	广晟有色	503,657.00	3.43
150	600502	安徽水利	502,813.00	3.43
151	600104	上汽集团	501,062.00	3.42
152	603808	歌力思	500,700.00	3.41
153	000933	神火股份	500,554.00	3.41
154	002246	北化股份	497,246.00	3.39
155	000514	渝开发	494,906.00	3.37
156	603609	禾丰牧业	491,188.00	3.35
157	300115	长盈精密	487,852.00	3.33
158	000728	国元证券	477,853.00	3.26
159	603833	欧派家居	469,484.00	3.20
160	002430	杭氧股份	463,637.00	3.16
161	601211	国泰君安	460,646.00	3.14
162	600497	驰宏锌锗	457,552.00	3.12

163	601099	太平洋	451,233.00	3.08
164	002508	老板电器	445,560.00	3.04
165	600006	东风汽车	441,045.00	3.01
166	300058	蓝色光标	440,943.00	3.01
167	600511	国药股份	437,414.72	2.98
168	002159	三特索道	436,962.00	2.98
169	300295	三六五网	436,537.00	2.98
170	000680	山推股份	432,960.00	2.95
171	000528	柳 工	432,894.00	2.95
172	600066	宇通客车	423,712.00	2.89
173	601166	兴业银行	406,894.00	2.77
174	002238	天威视讯	405,043.00	2.76
175	002234	民和股份	394,811.00	2.69
176	000980	众泰汽车	376,447.00	2.57
177	000978	桂林旅游	375,647.00	2.56
178	300036	超图软件	371,295.00	2.53
179	600874	创业环保	368,702.00	2.51
180	000630	铜陵有色	366,698.00	2.50
181	603000	人民网	362,941.00	2.47
182	000963	华东医药	350,682.00	2.39
183	002174	游族网络	349,356.00	2.38
184	002385	大北农	347,393.00	2.37
185	603816	顾家家居	343,578.00	2.34
186	001979	招商蛇口	327,592.00	2.23
187	600340	华夏幸福	317,295.00	2.16
188	601233	桐昆股份	312,146.00	2.13
189	601952	苏垦农发	305,778.00	2.08
190	000523	广州浪奇	305,397.00	2.08
191	600487	亨通光电	302,566.00	2.06
192	000596	古井贡酒	298,801.00	2.04
193	000997	新 大 陆	297,815.00	2.03
194	600958	东方证券	297,674.00	2.03
195	600885	宏发股份	296,961.00	2.02
196	600720	祁连山	293,700.00	2.00

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	600028	中国石化	8,252,369.57	56.25
2	601398	工商银行	6,040,116.24	41.17
3	601939	建设银行	5,954,593.26	40.59
4	601988	中国银行	5,779,520.02	39.40
5	601336	新华保险	5,753,369.25	39.22
6	600519	贵州茅台	4,927,256.95	33.59
7	601328	交通银行	4,680,038.00	31.90
8	601318	中国平安	4,458,907.66	30.40
9	600900	长江电力	4,433,929.68	30.23
10	600703	三安光电	4,303,925.48	29.34
11	601985	中国核电	4,292,247.55	29.26
12	300113	顺网科技	3,870,514.79	26.38
13	002714	牧原股份	3,818,571.77	26.03
14	601333	广深铁路	3,806,768.60	25.95
15	601688	华泰证券	3,771,179.00	25.71
16	000063	中兴通讯	3,755,083.00	25.60
17	600959	江苏有线	3,589,384.58	24.47
18	601601	中国太保	3,586,024.92	24.45
19	002739	万达电影	3,404,471.64	23.21
20	601998	中信银行	3,224,315.46	21.98
21	300033	同花顺	3,065,245.49	20.90
22	601628	中国人寿	3,044,279.00	20.75
23	002230	科大讯飞	2,900,144.85	19.77
24	300498	温氏股份	2,842,234.02	19.38
25	002466	天齐锂业	2,670,575.94	18.20
26	600048	保利地产	2,627,534.25	17.91
27	600085	同仁堂	2,590,486.00	17.66
28	600581	八一钢铁	2,565,923.40	17.49
29	002555	三七互娱	2,516,550.87	17.15
30	601088	中国神华	2,490,020.46	16.97
31	600195	中牧股份	2,357,354.00	16.07
32	600176	中国巨石	2,263,688.12	15.43
33	601186	中国铁建	2,180,758.00	14.87
34	002372	伟星新材	2,126,755.80	14.50

35	300433	蓝思科技	2,081,677.53	14.19
36	601899	紫金矿业	2,076,840.00	14.16
37	600779	水井坊	2,074,623.90	14.14
38	600585	海螺水泥	1,997,327.00	13.62
39	000651	格力电器	1,949,796.40	13.29
40	600019	宝钢股份	1,900,332.36	12.95
41	600873	梅花生物	1,831,231.00	12.48
42	601225	陕西煤业	1,798,275.03	12.26
43	300059	东方财富	1,760,119.82	12.00
44	002831	裕同科技	1,753,654.43	11.95
45	300104	乐视网	1,745,538.71	11.90
46	603993	洛阳钼业	1,719,402.30	11.72
47	300017	网宿科技	1,610,671.68	10.98
48	600109	国金证券	1,605,992.00	10.95
49	000858	五粮液	1,603,031.00	10.93
50	600872	中炬高新	1,573,474.00	10.73
51	002304	洋河股份	1,492,725.00	10.18
52	600428	中远海特	1,492,353.00	10.17
53	600409	三友化工	1,453,369.20	9.91
54	002475	立讯精密	1,414,153.30	9.64
55	601699	潞安环能	1,378,165.91	9.39
56	002343	慈文传媒	1,374,867.17	9.37
57	000998	隆平高科	1,370,827.74	9.34
58	600037	歌华有线	1,343,215.00	9.16
59	000002	万科A	1,315,672.00	8.97
60	600383	金地集团	1,314,094.04	8.96
61	601117	中国化学	1,306,158.00	8.90
62	600372	中航电子	1,283,970.00	8.75
63	600030	中信证券	1,280,009.00	8.73
64	601155	新城控股	1,271,338.24	8.67
65	000807	云铝股份	1,255,162.00	8.56
66	600584	长电科技	1,217,814.00	8.30
67	000761	本钢板材	1,172,047.00	7.99
68	000877	天山股份	1,151,981.62	7.85
69	300284	苏交科	1,093,963.00	7.46
70	000732	泰禾集团	1,072,159.00	7.31
71	300054	鼎龙股份	1,057,926.00	7.21
72	002027	分众传媒	1,043,831.37	7.12

73	002497	雅化集团	1,038,233.00	7.08
74	002340	格林美	999,628.72	6.81
75	000725	京东方 A	994,805.00	6.78
76	600570	恒生电子	993,115.20	6.77
77	601933	永辉超市	992,072.00	6.76
78	000789	万年青	977,708.00	6.66
79	002074	国轩高科	972,460.04	6.63
80	601668	中国建筑	949,835.80	6.47
81	300296	利亚德	922,248.00	6.29
82	600029	南方航空	901,137.68	6.14
83	601997	贵阳银行	886,244.10	6.04
84	000338	潍柴动力	883,176.30	6.02
85	601965	中国汽研	872,677.50	5.95
86	601375	中原证券	867,110.00	5.91
87	600909	华安证券	860,676.90	5.87
88	601600	中国铝业	860,123.46	5.86
89	000776	广发证券	852,149.00	5.81
90	002192	融捷股份	850,807.00	5.80
91	600970	中材国际	844,003.00	5.75
92	600486	扬农化工	837,658.00	5.71
93	600545	卓郎智能	814,188.00	5.55
94	300327	中颖电子	811,690.00	5.53
95	002078	太阳纸业	787,871.56	5.37
96	002019	亿帆医药	773,278.48	5.27
97	601288	农业银行	769,986.00	5.25
98	002037	久联发展	769,731.20	5.25
99	000717	韶钢松山	769,355.00	5.24
100	601666	平煤股份	724,741.49	4.94
101	600201	生物股份	723,698.00	4.93
102	000026	飞亚达 A	719,407.29	4.90
103	002299	圣农发展	716,418.31	4.88
104	600674	川投能源	713,339.04	4.86
105	601008	连云港	703,854.00	4.80
106	002460	赣锋锂业	703,398.80	4.79
107	002746	仙坛股份	696,230.60	4.75
108	002024	苏宁云商	696,062.00	4.74
109	000671	阳光城	693,922.40	4.73
110	600466	蓝光发展	691,525.00	4.71

111	300178	腾邦国际	690,042.80	4.70
112	000488	晨鸣纸业	677,357.00	4.62
113	000800	一汽轿车	666,596.00	4.54
114	000402	金融街	665,817.00	4.54
115	300251	光线传媒	656,841.66	4.48
116	300418	昆仑万维	655,559.90	4.47
117	600702	沱牌舍得	655,084.00	4.47
118	002405	四维图新	636,612.00	4.34
119	000001	平安银行	629,066.00	4.29
120	601390	中国中铁	627,072.32	4.27
121	002815	崇达技术	624,865.00	4.26
122	002688	金河生物	624,024.00	4.25
123	002707	众信旅游	617,757.68	4.21
124	000983	西山煤电	616,214.36	4.20
125	600438	通威股份	604,602.00	4.12
126	300197	铁汉生态	599,531.00	4.09
127	002302	西部建设	593,915.00	4.05
128	000546	金圆股份	586,778.32	4.00
129	000537	广宇发展	585,565.00	3.99
130	000906	浙商中拓	567,521.26	3.87
131	603609	禾丰牧业	559,193.00	3.81
132	002431	棕榈股份	557,804.00	3.80
133	601881	中国银河	554,087.66	3.78
134	002713	东易日盛	550,314.00	3.75
135	600522	中天科技	543,049.45	3.70
136	600031	三一重工	541,912.00	3.69
137	300426	唐德影视	537,668.40	3.67
138	600502	安徽水利	523,671.00	3.57
139	002635	安洁科技	518,795.00	3.54
140	300070	碧水源	517,849.81	3.53
141	603808	歌力思	507,990.00	3.46
142	000656	金科股份	507,940.00	3.46
143	300386	飞天诚信	506,240.00	3.45
144	000514	渝开发	497,024.00	3.39
145	002458	益生股份	495,715.00	3.38
146	002008	大族激光	495,341.00	3.38
147	600497	驰宏锌锗	495,095.80	3.37
148	603833	欧派家居	493,942.00	3.37

149	002246	北化股份	489,207.00	3.33
150	600104	上汽集团	485,095.00	3.31
151	000933	神火股份	467,838.00	3.19
152	601211	国泰君安	466,086.52	3.18
153	000728	国元证券	464,333.00	3.17
154	600259	广晟有色	459,064.00	3.13
155	601099	太平洋	455,913.00	3.11
156	603000	人民网	454,400.00	3.10
157	300115	长盈精密	447,419.00	3.05
158	002508	老板电器	443,427.50	3.02
159	600006	东风汽车	442,255.00	3.01
160	002430	杭氧股份	439,369.00	3.00
161	600511	国药股份	433,406.38	2.95
162	000680	山推股份	432,960.00	2.95
163	300058	蓝色光标	432,620.00	2.95
164	600196	复星医药	431,040.00	2.94
165	002159	三特索道	425,593.00	2.90
166	000528	柳工	425,040.00	2.90
167	000568	泸州老窖	421,075.80	2.87
168	600066	宇通客车	419,469.42	2.86
169	002311	海大集团	416,820.00	2.84
170	601166	兴业银行	410,400.00	2.80
171	002234	民和股份	407,482.00	2.78
172	000630	铜陵有色	384,416.00	2.62
173	300295	三六五网	381,603.00	2.60
174	002238	天威视讯	377,720.20	2.57
175	000978	桂林旅游	376,136.00	2.56
176	300036	超图软件	374,299.00	2.55
177	600874	创业环保	368,676.00	2.51
178	000963	华东医药	359,327.00	2.45
179	002385	大北农	357,400.00	2.44
180	603816	顾家家居	354,069.87	2.41
181	000980	众泰汽车	352,637.00	2.40
182	001979	招商蛇口	351,939.28	2.40
183	601233	桐昆股份	340,448.00	2.32
184	002709	天赐材料	336,128.00	2.29
185	000796	凯撒旅游	322,843.00	2.20
186	002174	游族网络	318,550.00	2.17

187	000523	广州浪奇	314,400.00	2.14
188	300603	立昂技术	312,403.07	2.13
189	600741	华域汽车	310,378.00	2.12
190	600340	华夏幸福	310,080.00	2.11
191	601012	隆基股份	306,168.72	2.09
192	600487	亨通光电	303,263.00	2.07
193	601952	苏垦农发	302,864.00	2.06
194	600885	宏发股份	298,504.00	2.03
195	601878	浙商证券	298,462.00	2.03
196	600877	*ST 嘉陵	298,410.00	2.03
197	300568	星源材质	297,014.70	2.02
198	600720	祁连山	296,542.32	2.02
199	600958	东方证券	295,001.00	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。

#### 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	314,913,786.81
卖出股票收入（成交）总额	271,060,839.09

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资，以风险对冲、套期保值为主要目的，以控制股票投资组合的系统性风险。套期保值主要选择流动性好、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股票现货资产进行匹配，在投资授权审批流程完成后进行股指期货套期保值投资，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

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，本基金暂不参与期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名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	61,204.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,347.17
5	应收申购款	316,605.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,157.62

#### 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

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信优势增长混合 A	2,881	13,454.45	588,697.85	1.52	38,173,562.75	98.48
安信优势增长混合 C	14	193,747.76	2,390,819.25	88.14	321,649.33	11.86

合计	2,895	14,326.33	2,979,517.10	7.18	38,495,212.08	92.82
----	-------	-----------	--------------	------	---------------	-------

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	安信优势增长混合 A	37,813.88	0.0976
	安信优势增长混合 C	-	-
	合计	37,813.88	0.0912

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信优势增长混合 A	0
	安信优势增长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信优势增长混合 A	0
	安信优势增长混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信优势增长混合 A	安信优势增长混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 20 日）基金份额总额	4,559,158,892.77	-
本报告期期初基金份额总额	13,535,214.85	1,819.84
本报告期基金总申购份额	41,565,477.14	122,582,895.61

减：本报告期基金总赎回份额	16,338,431.39	119,872,246.87
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	38,762,260.60	2,712,468.58

## § 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发生改变。

### 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 3 万元。

### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
安信证券	2	408,567,814.33	69.73	290,615.23	69.73	-
国信证券	2	177,391,251.57	30.27	126,178.34	30.27	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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。

本期退租交易单元：宏信证券。

### 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 (%)
安信证券	-	-	753,600,000.00	87.78	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	104,900,000.00	12.22	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于安信基金管理有限责任公司参加代销	上海证券报、中国	2017-01-13

	机构费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
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	2017-01-14
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	2017-01-17
4	安信优势增长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	2017-01-21
5	关于修改安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议的公告	上海证券报	2017-01-23
6	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	2017-01-25
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	2017-02-18
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	2017-03-07
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	2017-03-08
10	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	2017-03-15
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	2017-03-24
12	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告摘要	中国证券报、证券时报	2017-03-27
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	2017-03-30
14	安信基金管理有限责任公司关于临时暂停	上海证券报、中国	2017-04-13

	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	证券报、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	2017-04-18
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	2017-04-18
17	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2017-04-22
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	2017-04-28
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	2017-05-03
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	2017-05-18
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	2017-05-25
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	2017-06-02
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	2017-06-08
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	2017-06-08
25	关于安信基金管理有限责任公司新增开放	上海证券报、中国	2017-06-23

	式基金销售代理服务机构并参加费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
26	安信基金管理有限责任公司关于旗下中国神华估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-07-04
27	安信优势增长灵活配置混合型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	2017-07-04
28	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	2017-07-06
29	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报	2017-07-19
30	安信基金管理有限责任公司关于旗下八一钢铁估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-08-01
31	安信基金管理有限责任公司关于旗下尔康制药（300267）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-08-12
32	安信基金管理有限责任公司关于旗下中国重工（601989）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-08-18
33	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报	2017-08-24
34	关于安信基金管理有限责任公司参加中信建投证券股份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	2017-08-30
35	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-08-31
36	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	2017-09-15
37	安信基金管理有限责任公司关于旗下中国铝业（601600）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-10-18

38	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	2017-10-24
39	安信基金管理有限责任公司关于增加注册资本的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-10-26
40	安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报	2017-10-27
41	安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购（含定期定额申购）、赎回、转换和最低持有份额数额限制的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-11-09
42	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的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-11-13
43	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的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-11-27
44	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的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-12-06
45	安信基金管理有限责任公司关于旗下证券投资基金调整流通受限股票估值方法的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-12-23
46	安信基金管理有限责任公司关于公司旗下资管产品执行增值税政策的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-12-30
47	安信基金管理有限责任公司关于旗下 ST 保千里（600074）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017-12-30

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金
---	----------------	----------

资 者 类 别						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	20170104-20170206;	0	40,966,647.74	40,966,647.74	0	0
	2	20170821-20170831; 20170919-20171103;	0	2,390,819.25	0	2,390,819.25	5.76
	3	20170424-20170523;	0	27,347,310.85	27,347,310.85	0	0
	4	20170424-20170523;	0	27,347,310.85	27,347,310.85	0	0
	5	20170817-20170818;	0	15,938,795.03	15,938,795.03	0	0
个 人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p>							

(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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
- 2、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、《安信优势增长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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 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

2018年3月31日

