安信消费医药主题股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信消费医药股票
交易代码	000974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月19日
报告期末基金份额总额	276,314,040.15份
投资目标	在深入的基本面研究的基础上,精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资,注重安全边际,为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,重点关注包括GDP增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标,同时结合定量分析的方法,对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金的股票资产主要投资于价值型股票,坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上,分析基础利率的走势,研究利率期限结构和中长期收益率走势,在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金,属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-28,658,862.65
2.本期利润	9,421,268.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0331
4.期末基金资产净值	275,096,513.80
5.期末基金份额净值	0.996

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认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。

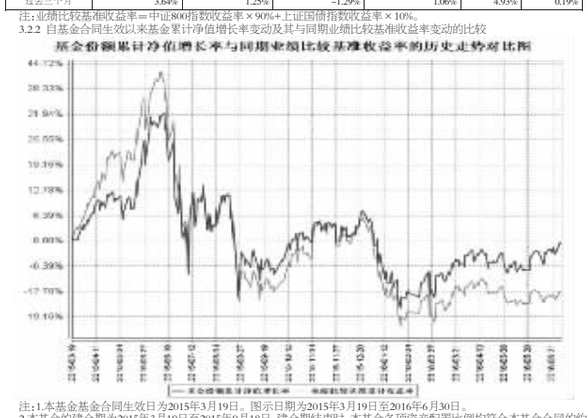
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	3.64%	1.25%	-1.29%	1.06%	4.93%	0.19%

注:业绩比较基准收益率=中证800指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

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



注:1.本基金基金合同生效日为2015年3月19日。图示日期为2015年3月19日至2016年6月30日。
2.本基金的建仓期为2015年3月19日至2015年9月18日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
娄诚	本基金的基金经理	2015年3月19日	2016年4月7日	10	娄诚先生,经济学硕士,历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理,安信基金管理有限责任公司研究部总经理兼基金投资部总经理。
陈一峰	本基金的基金经理	2016年3月14日	-	8	陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理。

注:1.此处的"任职日期"、"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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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。

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年二季度,A股市场整体表现平稳,但结构上出现了剧烈分化。由于经济数据不断走弱,市场监管也趋于严格,权威人士讲话扭转了之前市场对经济复苏的乐观预期,加上外围市场的各种风险因素暴露,使得市场充斥着较强的避险情绪。一季度先后表现抗跌的强周期股与网络科技股在二季度均出现了较大的调整,与此同时,具备天然避险属性的黄金股、低估值且成长稳健的蓝筹股以及受强劲基本面拉动的新能源汽车相关个股的表现抢眼。

一季度末至二季度初,本基金管理人意识到了周期股与科技股可能面临的上述风险,并及时降低了相应的持仓比例。进一步,我们判断房地产整体向下趋势不变,为了稳定经济表现,由国家主导的基础设施建设强度会维持较高增长,因此在新一轮的布局中,我们运用了较高的仓位集中配置在基建与环保方向。然而,尽管基础设施建设如我们预期的表现相对强劲,在整个固定资产投资中一枝独秀,但市场并没有给这类传统行业足够的重视,甚至在市场大幅调整的过程中,我们的大部分持仓没有表现出我们预期中的抗跌能力,因此本基金在四月份表现较差。进入五月份之后,我们开始重新梳理市场的成长股逻辑,并开始将一部分质地相对较差的基建股转向计算机与电子行业的一些新兴子板块,并取得了较好的收益,弥补了4月份的损失,使得本基金最终在二季度取得了相对良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为0.996元,本报告期份额净值增长率为3.64%,同期业绩比较基准增长率为-1.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	252,612,885.20	91.28
	其中:股票	252,612,885.20	91.28
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	23,862,637.09	8.62
8	其他资产	255,674.42	0.09
9	合计	276,731,196.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	210,625,515.41	76.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,450,524.20	1.25
E	建筑业	12,013,328.26	4.37
F	批发和零售业	3,753,769.00	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	6,750,358.00	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	911,369.45	0.33
J	金融业	5,910,837.00	2.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	438,340.86	0.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,600,847.02	2.04
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	3,157,996.00	1.15
S	综合	-	-
	合计	252,612,885.20	91.83

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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。

5.3 报告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

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	000895	双汇发展	959,669	20,037,888.72	7.28
2	600196	复星医药	898,966	17,098,333.32	6.22
3	600276	恒瑞医药	330,544	13,258,119.84	4.82
4	002563	森马服饰	809,013	8,761,610.79	3.18
5	600519	贵州茅台	26,507	7,737,923.44	2.81
6	002081	金螳螂	755,133	7,566,432.66	2.75
7	600566	济川药业	292,400	7,526,376.00	2.74
8	000957	中通客车	164,586	7,472,204.40	2.72
9	601012	隆基股份	445,700	5,816,385.00	2.11
10	300070	碧水源	360,763	5,368,153.44	1.95

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合相关法律法规和监管要求的变化。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	66,119.75
2	应收证券清算款	172,078.65
3	应收股利	-
4	应收利息	4,949.09
5	应收申购款	12,526.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	255,674.42

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	298,010,876.03
报告期期间基金总申购份额	4,832,379.82
减:报告期期间基金总赎回份额	26,529,215.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	276,314,040.15

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额

本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2016年4月12日发布公告,自2016年4月11日起聘任陈振宇为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信消费医药主题股票型证券投资基金募集的文件;
2、《安信消费医药主题股票型证券投资基金基金合同》;
3、《安信消费医药主题股票型证券投资基金托管协议》;
4、《安信消费医药主题股票型证券投资基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国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

9.3 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
2016年7月20日

安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信新常态股票
交易代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月7日
报告期末基金份额总额	32,596,879.84份
投资目标	灵活运用多种投资策略,深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果,力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在经济"新常态"的背景下,动态运用多种策略,实现基金资产长期稳定增值。资产配置上,基于宏观、政策及市场分析,将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间。股票投资方面,客观分析在"新常态"背景下行业景气度和发展前景,行业竞争结构和盈利模式,充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会;债券投资方面,利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合,并注重信用风险的控制;此外,本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	475,596.12
2.本期利润	1,168,534.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0299
4.期末基金资产净值	33,434,960.98
5.期末基金份额净值	1.026

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	2.50%	1.91%	-0.70%	0.83%	3.20%	1.08%

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。

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

注:1.本基金基金合同生效日为2015年8月7日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年8月7日至2016年6月30日。
2.本基金的建仓期为2015年8月7日至2016年2月6日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蓝蕙书	本基金的基金经理	2015年11月2日	-	9	蓝蕙书先生,理学硕士,历任桂林理工大学(原桂林工学院)理学院教师、华西证券有限责任公司证券研究所研究员、安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部,曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理;现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金;安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理	2016年4月11日	-	6	袁玮先生,理学博士,历任安信基金管理有限责任公司研究部研究员、基金投资部基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理。现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理

注:1.此处的"任职日期"、"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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年二季度,A股市场整体表现平稳,但结构上出现了剧烈分化。由于经济数据不断走弱,市场监管也趋于严格,权威人士讲话扭转了之前市场对经济复苏的乐观预期,加上外围市场的各种风险因素暴露,使得市场充斥着较强的避险情绪。一季度先后表现抗跌的强周期股与网络科技股在二季度均出现了较大的调整,与此同时,具备天然避险属性的黄金股、低估值且成长稳健的蓝筹股以及受强劲基本面拉动的新能源汽车相关个股的表现抢眼。

一季度末至二季度初,本基金管理人意识到了周期股与科技股可能面临的上述风险,并及时降低了相应的持仓比例。进一步,我们判断房地产整体向下趋势不变,为了稳定经济表现,由国家主导的基础设施建设强度会维持较高增长,因此在新一轮的布局中,我们运用了较高的仓位集中配置在基建与环保方向。然而,尽管基础设施建设如我们预期的表现相对强劲,在整个固定资产投资中一枝独秀,但市场并没有给这类传统行业足够的重视,甚至在市场大幅调整的过程中,我们的大部分持仓没有表现出我们预期中的抗跌能力,因此本基金在四月份表现较差。进入五月份之后,我们开始重新梳理市场的成长股逻辑,并开始将一部分质地相对较差的基建股转向计算机与电子行业的一些新兴子板块,并取得了较好的收益,弥补了4月份的损失,使得本基金最终在二季度取得了相对良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为1.026元,本报告期份额净值增长率为2.50%,同期业绩比较基准增长率为-0.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现了基金资产净值低于5000万元人民币的情形,时间范围为2016年4月1日至2016年4月26日、2016年5月9日至2016年6月30日。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	30,331,667.42	85.19
	其中:股票	30,331,667.42	85.19
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	5,202,737.18	14.61
8	其他资产	68,436.18	0.19
9	合计	35,602,840.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,002,135.30	3.00
B	采矿业	1,659,651.15	4.96
C	制造业	15,954,600.52	47.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,064,981.56	3.19
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	4,365,440.65	13.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,606,175.00	4.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,014,880.42	9.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,663,802.82	4.98
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	30,331,667.42	90.72

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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。

5.3 报告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

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	300284	苏交科	127,641	3,014,880.42	9.02
2	002230	科大讯飞	82,577	2,712,654.45	8.11
3	002318	久立特材	147,100	1,701,947.00	5.09
4	300190	维尔利	95,786	1,663,802.82	4.98
5	600570	恒生电子	24,610	1,643,209.70	4.91
6	300367	东方网力	64,893	1,611,293.19	4.82
7	600773	西藏城投	102,500	1,606,175.00	4.80
8	300337	银邦股份	202,617	1,594,595.79	4.77
9	300078	思创医惠	47,533	1,589,503.52	4.75
10	300463	迈克生物	50,778	1,374,560.46	4.11

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,578.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	857.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,436.18

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300284	苏交科	3,014,880.42	9.02	重大事项
2	600773	西藏城投	1,606,175.00	4.80	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	31,854,078.78
报告期期间基金总申购份额	23,446,718.23
减:报告期期间基金总赎回份额	22,703,917.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	32,596,879.84

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2016年4月12日发布公告,自2016年4月11日起聘任陈振宇为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金募集的文件;
2、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金托管协议》;
4、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国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

9.3 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
2016年7月20日

安信新动力灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信新动力混合
交易代码	001686
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月24日
报告期末基金份额总额	120,814,184.76份
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超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置上,以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,同时结合定量分析的方法,对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估;固定收益投资上,但上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用品种配置、久期配置、信用配置、利率和回购等投资策略;股票投资方面,本基金秉承价值投资理念,深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司,资产支持证券方面,对部分高质量的资产支持证券采用买入并持有到期策略,实现基金资产增益增厚;此外,本基金还会合理运用股指期货、权证、国债期货等衍生工具,并在投资的各个环节持续监测、控制和管理风险。
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。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	安信新动力混合A / 安信新动力混合C
下属分级基金的交易代码	001686 / 001687
报告期末下属分级基金的份额总额	447,726.31份 / 120,366,458.45份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民