安信消费医药主题股票型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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1月18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2015年10月1日起至12月31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	309,526,828.14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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,666,616.75
2.本期利润	37,999,692.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.1283
4.期末基金资产净值	323,492,681.64
5.期末基金份额净值	1.045

注:1.本基金基金合同生效日为2015年3月19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3月18日至2015年12月31日。

2.本基金的建仓期为2015年3月19日至2015年9月17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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
娄诚	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2015年3月19日	-	9	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。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理、现任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.此处的任职日期为本基金合同生效日。

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

本基金采取自下而上的投资策略,淡化市场择时和大类资产配置,以优选核心竞争力突出且估值合理的优质消费医药类股票为主要投资策略,并坚持仓位和价格负相关的动态管理原则。本基金持有品种以传统消费和医药板块的低估值龙头为主,坚持仓位和股价的负相关操作。在四季度市场快速上涨过程中,逐步将总仓位降低至合同约定下限。但报告期内高估值股票反弹更加猛烈,使得我们的产品在相对排名上有所下滑。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.045元,本报告期份额净值增长率为13.59%,同期业绩比较基准增长率为17.06%。

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	257,534,448.92	79.37
	其中:股票	257,534,448.92	79.37
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	27,371,872.58	8.44
8	其他资产	39,562,615.22	12.19
9	合计	324,468,936.72	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	220,880,920.02	68.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,704,260.00	3.00
F	批发和零售业	26,949,268.90	8.33
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	257,534,448.92	79.61

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	600196	复星医药	994,721	23,365,996.29	7.22
2	000895	双汇发展	1,121,854	22,897,040.14	7.08
3	600660	福耀玻璃	1,289,379	19,585,667.01	6.05
4	600585	海螺水泥	1,098,400	18,782,640.00	5.81
5	000423	东阿阿胶	356,344	18,636,791.20	5.76
6	002422	科伦药业	986,017	18,339,916.20	5.67
7	000501	鄂武商A	771,164	16,502,909.60	5.10
8	600315	上海家化	387,010	15,283,024.90	4.72
9	600276	恒瑞医药	305,353	14,998,939.36	4.64
10	000338	潍柴动力	1,469,542	14,195,775.72	4.39

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

本基金应套期保值为目的,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、流动性及风险特性特征,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

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除"科伦药业(002422)"和"上海家化(600315)"在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形外,其它没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据科伦药业2014年7月7日公告,该公司于2014年7月4日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(成稽调查通字147014号),通知书主要内容为,公司因涉嫌信息披露违法违规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,决定对公司予以立案调查。

根据公司15年4月23日公告,该公司于2015年4月22日,公司收到《中国证券监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书》([2015]9号)(以下简称"《行政处罚决定书》"),根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第一百九十三条的规定,四川证监局决定:

1.对科伦药业给予警告,并处60万元罚款;

2.对刘革新给予警告,并处30万元罚款;

3.对程志鹏、潘慧、刘思川、冯伟、熊鹰给予警告,并处20万元罚款;

4.对张强、刘洪给予警告,并处5万元罚款;

5.对赵力炎、高冬、罗孝银、于明德、武威给予警告,并处3万元罚款;

6.对张腾文给予警告。

根据上海家化于2015年6月12日公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《行政处罚决定书》(编号:沪[2015]4号),"依据《中华人民共和国证券法》(以下简称<证券法>)的有关规定,上海监管局对上海家化信息披露违法行为进行了立案调查、审理,应上海家化、葛文耀、吴英华、由建宁、童恺、周勤业、管一民的要求,上海监管局举行了听证会(吴英华因个人原因未参加),听取了上海家化及相关人员的陈述与申辩,同时宣平、丁逸菁等11名当事人向上海监管局提交了书面陈述申辩意见。本案现已调查、审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,根据《证券法》第一百九十三条第一款的规定,上海监管局决定:

对上海家化给予警告,并处以30万元罚款。

对葛文耀给予警告,并处以15万元罚款。

对宣平、由建宁、丁逸菁、吴英华分别给予警告,并处以10万元罚款。

对冯珺、管一民、张纯、朱炳江、刘鑫中、胡大辉、王芸、方弊、童恺、周勤业、苏勇、汪建宁分别给予警告,并处以3万元罚款。

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	256,420.80
2	应收证券清算款	30,005,608.33
3	应收股利	-
4	应收利息	9,241.10
5	应收申购款	9,291,344.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,562,615.22

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	307,997,700.69
报告期期间基金总申购份额	56,774,555.84
减:报告期期间基金总赎回份额	55,245,428.39
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	309,526,828.14

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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2015年12月31日发布公告,自2015年12月30日起,王连志先生任公司董事长,牛冠兴先生不再担任公司董事长。

§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1月20日

安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信鑫发优选混合
交易代码	000433
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月31日
报告期末基金份额总额	177,998,349.80份
投资目标	以风险管理为基础,通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上,结合政策因素、市场情绪与估值因素等,分析大类资产风险收益比,合理配置;在固定收益类的投资上,采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略,选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种;在股票投资上,秉承价值投资理念,灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略,把握市场定价偏差带来的投资机会;在衍生品投资上,合理利用权证等做套保或套利投资;在风险管理上,根据市场环境的变化,动态调整仓位和投资品种,并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	1年期人民币定期存款基准利率+3.00%
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	广发银行股份有限公司

§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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	7,998,811.84
2.本期利润	45,263,990.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.2934
4.期末基金资产净值	248,292,089.80
5.期末基金份额净值	1.395

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	46.53%	2.24%	1.05%	0.01%	45.48%	2.23%

注:业绩比较基准收益率=1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

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2013年12月31日。图示日期为2013年12月31日至2015年12月31日。

2、本基金的建仓期为2013年12月31日至2014年6月30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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蓝雁书	本基金的基金经理	2013年12月31日	-	8	蓝雁书先生,理学硕士。历任桂林理工大学(原桂林工学院)理学院教师、华西证券有限责任公司证券研究所研究员、安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部,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。

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

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

进入2015年4季度,前期市场大幅调整的诱发因素之一——人民币汇率重新走稳,加上市场对中央经济工作会议以及十三五规划的预期,A股市场在国庆节后迎来上涨,以互联网+、新能源汽车产业链等为代表的新经济涨幅居前,传统经济的钢铁、银行涨幅落后。安信鑫发优选基金国庆节后果断提高权益类资产配置,从风险收益比角度筛选优质成长股为底仓,包括新能源汽车产业链、核电产业链等,获得了较好的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.395元,本报告期份额净值增长率为46.53%,同期业绩比较基准增长率为1.05%。

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	222,246,700.97	87.46
	其中:股票	222,246,700.97	87.46
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	25,305,030.44	9.96
8	其他资产	6,557,920.75	2.58
9	合计	254,109,652.16	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

序号	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	14,260,532.00	5.74
C	制造业	146,119,833.16	58.85
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	10,146,400.00	4.09
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	34,332,714.81	13.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,714,620.00	1.50
L	租赁和商务服务业	13,672,601.00	5.51
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	222,246,700.97	89.51

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	002749	国光股份	643,999	64,528,699.80	25.99
2	002460	赣锋锂业	243,729	15,337,865.97	6.18
3	002466	天齐锂业	106,976	15,056,872.00	6.06
4	603308	应流股份	478,793	14,995,796.76	6.04
5	002070	众和股份	685,900	14,980,056.00	6.03
6	002230	科大讯飞	391,339	14,499,109.95	5.84
7	000697	炼石有色	512,600	14,260,532.00	5.74
8	000061	农产品	772,900	13,672,601.00	5.51
9	300394	天孚通信	99,337	11,473,423.50	4.62
10	600570	恒生电子	170,288	10,382,459.36	4.18

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

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

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	1,129,866.31
2	应收证券清算款	3,165,825.49
3	应收股利	-
4	应收利息	8,234.95
5	应收申购款	2,253,994.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,557,920.75

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	002749	国光股份	64,528,699.80	25.99	新股锁定
2	300394	天孚通信	11,473,423.50	4.62	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	82,542,759.88
报告期期间基金总申购份额	405,552,847.89
减:报告期期间基金总赎回份额	310,097,257.97
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	177,998,349.80

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	24,388,747.96
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	24,388,747.96
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	13.70

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2015年12月31日发布公告,自2015年12月30日起,王连志先生任公司董事长,牛冠兴先生不再担任公司董事长。

§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鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

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1月20日

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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1月18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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信永利信用债券
交易代码	000310
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2013年11月8日
报告期末基金份额总额	666,237,110.51份
投资目标	在严格控制信用风险的前提下,通过稳健的投资策略,为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	封闭期内,在久期配置上,预测利率和收益率的变动,合理匹配投资组合久期和封闭期;在品种配置上,基于宏观基本面研究,分析多种因素,合理配置不同债券的构成比例;在信用投资上,依据内外评级结果,建立信用债券的投资库,并进行动态调整和维护;在可转债投资上,合理估值,投资价值低估的可转债;在资产支持证券的投资上,重点关注基础资产的类型、发行条款、提前偿还率和市场流动性等因素,综合评估。开放期内,主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的流动性,减小净值的波动。
业绩比较基准	1.5×1年期银行定期存款基准利率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于中低风险收益水平的投资品种。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	安信永利信用债券A / 安信永利信用债券C
下属分级基金的交易代码	000310 / 000335
报告期末下属分级基金的份额总额	475,538,391.40份 / 190,698,719.11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:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)	
	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
1.本期已实现收益	7,336,979.00	2,950,362.27
2.本期利润	6,409,536.47	2,553,284.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0223	0.0216
4.期末基金资产净值	497,062,493.12	197,353,487.43
5.期末基金份额净值	1.045	1.035

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

安信永利信用债券A

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	2.56%	0.11%	0.55%	0.01%	2.01%	0.10%

安信永利信用债券C

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%	0.12%	0.55%	0.01%	1.95%	0.11%

注:业绩比较基准=1.5×1年期银行定期存款基准利率

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、本基金的建仓期为2013年11月8日至2014年5月7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。

2、本基金基金合同生效日为2013年11月8日。图示日期为2013年11月8日至2015年12月31日。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理	2013年11月8日	-	9	李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经