# 安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月20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1月1日起至3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 | 136,603,906.24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(2016年1月1日 — 2016年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 11,259,277.28 |
| 2.本期利润 | −44,669,738.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | −0.2838 |
| 4.期末基金资产净值 | 156,516,847.32 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.146 |

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。

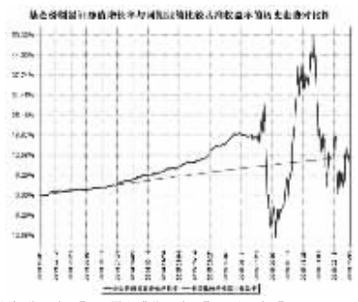
3.2 基金净值表现

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 | −17.85% | 3.15% | 1.01% | 0.02% | −18.86% | 3.13% |

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2016年3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 | | |
| 蓝雕书 | 本基金的基金经理 | 2013年12月31日 | − | 9 | 蓝雕书先生,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、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”、“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年伊始,再度大幅贬值的人民币汇率引起投资者不安,加上不合理的交易制度安排,造成1月份A股踩踏式下跌,高估值的计算机、电子、传媒板块跌幅居前,银行、家电、食品饮料等跌幅相对较小。进入2月份,经历大幅调整后的A股估值优势开始显现,同时经济基本面也开始有企稳迹象,加上美联储加息预期延后,A股市场迎来难得的反弹,其中涨价因素以及稳增长受益的养殖、建筑建材等涨幅较大。期间,安信鑫发优选基金在减持被动超标投资标的后,适时调整持股结构,配置行业板块包括新能源汽车产业链、核电产业链、教育医疗以及养殖等,取得了较好的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.146元,本报告期份额净值增长率为−17.85%,同期业绩比较基准增长率为1.01%。

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 | 133,709,511.94 | 81.11 |
| | 其中:股票 | 133,709,511.94 | 81.11 |
| 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 | 28,791,436.52 | 17.47 |
| 8 | 其他资产 | 2,348,570.24 | 1.42 |
| 9 | 合计 | 164,849,518.70 | 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 | 7,147,838.00 | 4.57 |
| C | 制造业 | 87,636,294.56 | 55.99 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | − | − |
| E | 建筑业 | 6,413,368.48 | 4.10 |
| F | 批发和零售业 | 5,002,576.00 | 3.20 |
| 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 | 14,605,179.02 | 9.33 |
| 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 | 12,904,255.88 | 8.24 |
| 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 | 133,709,511.94 | 85.43 |

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 | 002070 | 众和股份 | 545,900 | 11,059,934.00 | 7.07 |
| 2 | 002230 | 科大讯飞 | 286,981 | 9,303,924.02 | 5.94 |
| 3 | 300284 | 苏交科 | 445,987 | 8,580,789.88 | 5.48 |
| 4 | 000513 | 丽珠集团 | 162,300 | 7,295,385.00 | 4.66 |
| 5 | 000697 | 炼石有色 | 274,600 | 7,147,838.00 | 4.57 |
| 6 | 603308 | 应流股份 | 262,239 | 6,461,568.96 | 4.13 |
| 7 | 000990 | 天健集团 | 452,600 | 6,377,134.00 | 4.07 |
| 8 | 300145 | 南方泵业 | 159,688 | 6,267,754.00 | 4.00 |
| 9 | 002117 | 东港股份 | 188,100 | 6,032,367.00 | 3.85 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 359,600 | 5,847,096.00 | 3.74 |

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。

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 | 463,966.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | − |
| 3 | 应收股利 | − |
| 4 | 应收利息 | 6,891.79 |
| 5 | 应收申购款 | 1,877,712.02 |
| 6 | 其他应收款 | − |
| 7 | 待摊费用 | − |
| 8 | 其他 | − |
| 9 | 合计 | 2,348,570.24 |

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 | 002070 | 众和股份 | 11,059,934.00 | 7.07 | 重大事项 |
| 2 | 002230 | 科大讯飞 | 9,303,924.02 | 5.94 | 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 | 177,998,349.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 47,629,212.75 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 89,023,656.31 |
| 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 | 136,603,906.24 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 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(%) | 17.85 |

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 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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

8.3 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4月22日

# 安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月20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1月1日起至3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种类比例;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。 | |
| 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(2016年1月1日 — 2016年3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 | 688,881.72 | 76,248.92 |
| 2. 本期利润 | 3,898,686.16 | 1,350,232.41 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0082 | 0.0071 |
| 4. 期末基金资产净值 | 500,961,179.28 | 198,703,719.84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.053 | 1.042 |

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

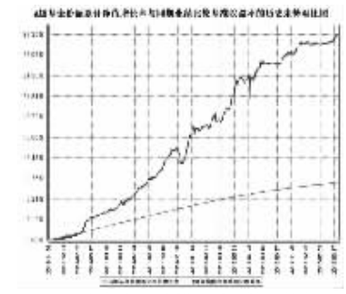
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①−③ | ②−④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.77% | 0.08% | 0.52% | 0.01% | 0.25% | 0.07% |

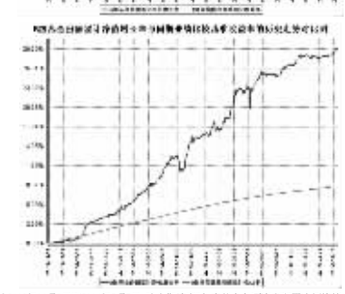
安信永利信用债券C

| 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 | 0.68% | 0.06% | 0.52% | 0.01% | 0.16% | 0.05% |

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2016年3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 | | |
| 张翼飞 | 本基金的基金经理 | 2016年3月14日 | − | 5.5 | 张翼飞先生,经济学硕士,历任摩根轧机(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员,泰岳岳麓高科天业有限公司财务总监,日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信现金管理货币市场基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理;现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 李勇 | 本基金的基金经理 | 2013年11月8日 | 2016年3月14日 | 10 | 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,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。 |

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年一季度,基于年初“震荡慢牛”的预判,我们配置了一定仓位的中等久期债券(以刚好越过期限利差陡峭上行区间为限),以获取一定的期限利差和期限下滑收益。另外根据最新监管规定限制,我们在监管许可范围内充分采用了合适的杠杆运作空间。信用债方面,严控信用风险,预留信用安全边际,避开危险区雾霾区,结合信用资质,控制好单只债券仓位;利率债方面,利用好中长久期利率债工具,从事波段操作和流动性管理。总的来说本季度做到了一级市场全覆盖,二级市场大范围监测,不断发现合适的交易性机会,动态优化持仓结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金A类份额净值为1.053元,本基金C类份额净值为1.042元。本报告期本基金A类份额净值增长率为0.77%,本基金C类份额净值增长率为0.68%,同期业绩比较基准增长率为0.52%。

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 | − | − |
| | 其中:股票 | − | − |
| 2 | 基金投资 | − | − |
| 3 | 固定收益投资 | 1,009,013,346.50 | 96.87 |
| | 其中:债券 | 1,009,013,346.50 | 96.87 |
| | 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 | 14,017,181.43 | 1.35 |
| 8 | 其他资产 | 18,601,535.44 | 1.79 |
| 9 | 合计 | 1,041,632,063.37 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 73,554,000.00 | 10.51 |
| | 其中:政策性金融债 | 73,554,000.00 | 10.51 |
| 4 | 企业债券 | 225,437,346.50 | 32.22 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,032,000.00 | 1.43 |
| 6 | 中期票据 | 699,990,000.00 | 100.05 |
| 7 | 可转债(可交换债) | − | − |
| 8 | 同业存单 | − | − |
| 9 | 其他 | − | − |
| 10 | 合计 | 1,009,013,346.50 | 144.21 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 101553046 | 15苏交通MTN002 | 900,000 | 91,620,000.00 | 13.09 |
| 2 | 101552045 | 15珠海华发MTN003 | 600,000 | 61,692,000.00 | 8.82 |
| 3 | 101554097 | 15北部湾MTN003 | 600,000 | 61,368,000.00 | 8.77 |
| 4 | 101562050 | 15建发集MTN003 | 600,000 | 61,350,000.00 | 8.77 |
| 5 | 101554099 | 15泰达投资MTN001 | 600,000 | 60,858,000.00 | 8.70 |

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。

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 | 130,872.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | − |
| 3 | 应收股利 | − |
| 4 | 应收利息 | 7,472,856.96 |
| 5 | 应收申购款 | − |
| 6 | 其他应收款 | − |
| 7 | 待摊费用 | − |
| 8 | 其他 | − |
| 9 | 合计 | 7,603,729.37 |

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

| 项目 | 安信永利信用债券A | 安信永利信用债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 475,538,391.40 | 190,698,719.11 |
| 报告期期间基金总申购份额 | − | − |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | − | − |
| 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 | 475,538,391.40 | 190,698,719.11 |

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永利信用定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
4、《安信永利信用定期开放债券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。

8.2 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

8.3 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4月22日

# 安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3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
报告送出日期:2016年4月22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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 安信优势增长混合 | |
| 交易代码 | 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 892,503,347.52份 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信优势增长A | 安信优势增长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 | 129,144,568.89份 | 763,358,778.63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(2016年1月1日 — 2016年3月31日) | |
|---|---|---|
| | 安信优势增长A | 安信优势增长C |
| 1. 本期已实现收益 | 2,344,928.69 | 15,834,042.18 |
| 2. 本期利润 | 1,601,427.64 | 9,275,991.09 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0079 | 0.0066 |
| 4. 期末基金资产净值 | 137,014,644.15 | 808,516,101.30 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.061 | 1.059 |

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

安信优势增长A

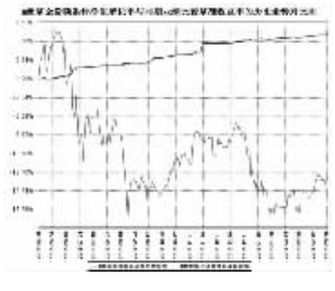
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①−③ | ②−④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.86% | 0.05% | −6.17% | 1.22% | 7.03% | −1.17% |

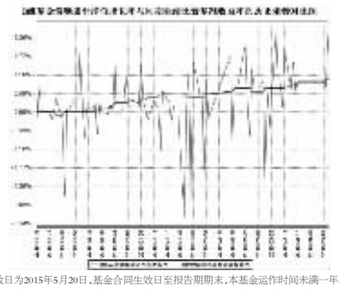
安信优势增长C

| 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 | 0.67% | 0.04% | 1.61% | 1.94% | −3.79% | −1.89% |

注:1、业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。
2、本基金自2015年11月17日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月17日至2016年3月31日。

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5月20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。
2、本基金的建仓期为2015年5月20日至2015年11月19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。
3、本基金自2015年11月18日起增加C类份额,A类份额图示日期为2016年1月4日至2016年3月31日,C类份额图示日期为2016年1月4日至2016年3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 | | |
| 蓝雕书 | 本基金的基金经理 | 2015年5月20日 | − | 9 | 蓝雕书先生,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。 |
| 聂世林 | 本基金的基金经理 | 2016年2月18日 | − | 8 | 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、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。曾任安信策略精选灵活配置混合型证