安信安盈保本混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信安盈保本混合
交易代码	002308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月9日
报告期末基金份额总额	1,246,017,053.37份
投资目标	在保证投资者本金的基础上,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面,本基金运用恒定比例组合保险(CPPI)原理,动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例,通过对固定收益类资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对权益类资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。固定收益投资方面,本基金通过对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测,综合考虑各种市场因素,在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上,构造债券组合。权益资产投资方面,本基金在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上,通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资。
业绩比较基准	两年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金保证人	中合中小企业融资担保股份有限公司

§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(2017年7月1日 — 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	20,342,147.27
2.本期利润	13,913,892.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107
4.期末基金资产净值	1,327,231,248.49
5.期末基金份额净值	1.065

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;

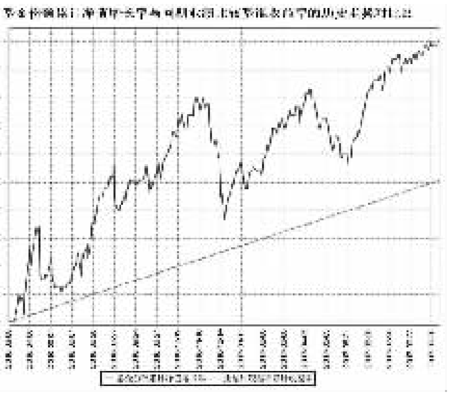
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.04%	0.10%	0.53%	0.00%	0.51%	0.10%

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



注:1、本基金合同生效日为2016年3月9日,截至报告期末本基金合同生效已满一年;

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。

§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		
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016年3月10日	–	11	杨凯玮先生,台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员,台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员,台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员,台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长,华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理,安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理	2016年3月9日	2017年7月5日	13	庄园女士,经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员,工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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助理,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理,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)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合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

三季度宏观基本面基本稳定、景气度维持高位,工业生产增速、投融资增速等方面稳中向好;外围环境较好,出口增速不俗;监管趋缓,shibor未出现大幅上行。股市和债市均有良好的外部环境,股市持续小幅上升,债市情绪面稳定,利率水平稳定,偶有波动。

固定收益方面,产品在监管转缓后适当拉长了久期,以博取更多收益。整体来看,操作稳健,对产品收益做出稳定贡献。

按照我们的模型,主要选取了较大市值类型股票,并定期根据模型选股调整持仓,整体来看,获得较好收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0650元;本报告期基金份额净值增长率为1.04%,业绩比较基准收益率为0.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	116,626,909.52	6.41
	其中:股票	116,626,909.52	6.41
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,653,259,936.37	90.83
	其中:债券	1,653,259,936.37	90.83
	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	26,787,940.94	1.47
8	其他资产	23,501,446.91	1.29
9	合计	1,820,176,233.74	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	4,737,766.60	0.36
C	制造业	65,811,000.98	4.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,377,060.00	0.10
E	建筑业	1,750,583.00	0.13
F	批发和零售业	3,148,904.45	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	3,612,712.71	0.27
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,289,096.03	0.55
J	金融业	23,889,202.08	1.80
K	房地产业	1,743,159.42	0.13
L	租赁和商务服务业	1,505,089.72	0.11
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,647,034.54	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	116,626,909.52	8.79

5.2.2 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。

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	601398	工商银行	355,200	2,131,200.00	0.16
2	601288	农业银行	528,600	2,019,252.00	0.15
3	600309	万华化学	45,600	1,922,040.00	0.14
4	601939	建设银行	256,100	1,785,017.00	0.13
5	601328	交通银行	271,451	1,715,570.32	0.13
6	600176	中国巨石	144,340	1,654,136.40	0.12
7	601818	光大银行	396,500	1,605,825.00	0.12
8	601166	兴业银行	92,824	1,604,926.96	0.12
9	000985	大庆华科	63,200	1,595,168.00	0.12
10	600000	浦发银行	123,800	1,593,306.00	0.12

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	139,052,000.00	10.48
	其中:政策性金融债	89,832,000.00	6.77
4	企业债券	428,827,936.37	32.31
5	企业短期融资券	10,057,000.00	0.76
6	中期票据	38,604,000.00	2.91
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	1,036,719,000.00	78.11
9	其他	–	–
10	合计	1,653,259,936.37	124.56

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	111717191	17光大银行CD191	1,000,000	98,890,000.00	7.45
2	111719271	17恒丰银行CD271	1,000,000	98,880,000.00	7.45
2	111719276	17恒丰银行CD276	1,000,000	98,880,000.00	7.45
3	111717195	17光大银行CD195	800,000	79,112,000.00	5.96
4	170204	17国开04	700,000	69,860,000.00	5.26
5	111798461	17江苏紫金农商行CD062	600,000	58,560,000.00	4.41

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

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金以套期保值为目的,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组合的风险收益特征。

本基金通过对宏观经济和股票市场走势的分析与判断,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的股指期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除万华化学(600309),本期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2017年7月6日万华化学集团股份有限公司(下称万华化学,股票代码:600309)《万华化学集团股份有限公司关于2016年9月20日安全事故调查结果的公告》,根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园"9.20"较大爆炸事故调查报告》的建议,公司对9名相关责任人给予相应责任追究,包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分;烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入40%的罚款,对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	91,252.57
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	23,409,205.02
5	应收申购款	989.32
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,501,446.91

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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,349,608,659.49
报告期期间基金总申购份额	505,742.22
减:报告期期间基金总赎回份额	104,097,348.34
报告期期末基金份额总额	1,246,017,053.37

§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,本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

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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安盈保本混合型证券投资基金募集的文件;
2、《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《安信安盈保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、《安信安盈保本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

基金管理人和基金托管人的住所。

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
2017年10月27日

安信宝利债券型证券投资基金(LOF)

2017 第三季度 报告

2017年9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:2017年10月27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2017年10月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信宝利债券
场内简称	安信宝利(LOF)
交易代码	167501
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年7月24日
报告期末基金份额总额	538,645,959.99份
投资目标	在适度承担信用风险的情况下,力争实现基金财产当期稳定的超越基准的投资收益。
投资策略	本基金的债券投资主要将采用信用策略,同时辅以利率策略、收益率策略、回购策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、新股投资策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过信用分析和对信用利差趋势的判断,为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本产品属于中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险水平和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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(2017年7月1日 — 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	15,032,335.31
2.本期利润	8,760,526.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132
4.期末基金资产净值	599,001,978.72
5.期末基金份额净值	1.112

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;

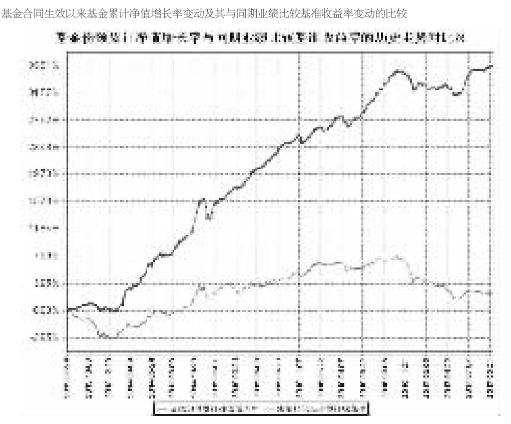
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.18%	0.06%	-0.15%	0.03%	1.33%	0.03%

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、本基金合同生效日为2013年7月24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。

§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		
庄园	本基金的基金经理	2013年7月24日	–	13	庄园女士,经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员,工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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助理,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理,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)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合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

利率债方面,整个三季度,10年国债收益率一直维持在一个狭小的区间内振荡。资金面较为紧张,R007一直处于相对高位,三季度R007均值录得3.45%,高于前值3.35%。期限利差走扩,三季度10年国债和1年国债利差均值录得0.20%,高于前0.17%;信用利差收窄,三季度5年AA中票和5年国债利差均值录得1.69%,低于前值1.91%。

信用债方面,年初至今,中票短融收益率走势震荡向上。中票短融收益率在1至5月走高,在5月达到高点后开始走低,分时段来看,收益率在4、5月份的上行幅度要明显比一季度陡峭,但随着6月份资金面的转松,收益率震荡下行,最终回落到四月中旬的水平,但在8月有略微回升。从数据来看,目前中票短融收益率处于历史的平均水平,与13年二季度、14年底的收益率水平相当。

三季度安信宝利债券型证券投资基金(LOF)根据申购赎回情况基本维持一定杠杆比例和久期,看好中短期品种的确定性机会,净值平稳上升。

展望后市,9月末央行的定向降准和10月召开的十九大会议是全月重要的影响因素,市场波动可能会有所加大。未来资金面仍然以稳为主,流动性会有所改善、经济边际下行、监管冲击弱化利好债市。在目前稳中求进的大环境中,市场仍由存量资金主导,震荡格局可能继续延续。我们将继续保持谨慎的态度,在控制组合久期和杠杆的同时,选择合适的时机适当介入。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1120元;本报告期基金份额净值增长率为1.18%,业绩比较基准收益率为-0.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	700,060,818.07	92.84
	其中:债券	700,060,818.07	92.84
	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	17,410,268.20	2.31
8	其他资产	36,607,599.04	4.85
9	合计	754,078,685.31	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。

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	9,995,000.00	1.67
2	央行票据	–	–
3	金融债券	29,946,000.00	5.00
	其中:政策性金融债	29,946,000.00	5.00
4	企业债券	502,450,702.70	83.88
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	148,769,000.00	24.84
7	可转债(可交换债)	8,900,115.37	1.49
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	700,060,818.07	116.87

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	124395	13堰城投	500,000	41,190,000.00	6.88
2	136321	16金泰债	400,000	39,036,000.00	6.52
3	124396	13娄发展	604,000	37,381,560.00	6.24
4	1280350	12兴化债	630,000	32,199,300.00	5.38
5	1280405	12豫铁投债	300,000	31,788,000.00	5.31

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库,本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,888.29
2	应收证券清算款	9,550,980.86
3	应收股利	–
4	应收利息	19,983,698.90
5	应收申购款	116,490.00
6	其他应收款	6,923,540.99
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	36,607,599.04

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	8,899,115.40	1.49

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	759,421,766.62
报告期期间基金总申购份额	289,830,954.32
减:报告期期间基金总赎回份额	510,606,760.95
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	538,645,959.99

§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

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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宝利分级债券型证券投资基金募集的文件;
2、《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》;
3、《安信宝利分级债券型证券投资基金托管协议》;
4、《安信宝利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

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
2017年10月27日

安信保证金交易型货币市场基金

2017 第三季度 报告

2017年9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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27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2017年10月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信货币
场内简称	安信货币
交易代码	511680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月9日
报告期末基金份额总额	552,230.29份
投资目标	在力争保持基金资产相对低风险和相对高流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	久期配置上,本基金根据对未来利率变动的合理预判,结合基金未来现金流的综合预期,动态决定和调整投资组合平均剩余期限。类属配置上,通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断,来确定并动态调整投资组合国债、央行票据、债券回购、非金融企业债务融资工具及现金等各类属品种的配置比例。个券选择上,优先选择高信用等级的流动性好的债券品种,并对低估值品种进行重点关注。此外,本基金还会采用套利策略、回购策略、流动性管理策略,在保持高流动性的基础上,把握无风险套利机会,获取安全的超额收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§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(2017年7月1日 — 2017年9月30日)
1. 本期已实现收益	864,043.62
2. 本期利润	864,043.62
3. 期末基金资产净值	55,223,020.76

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

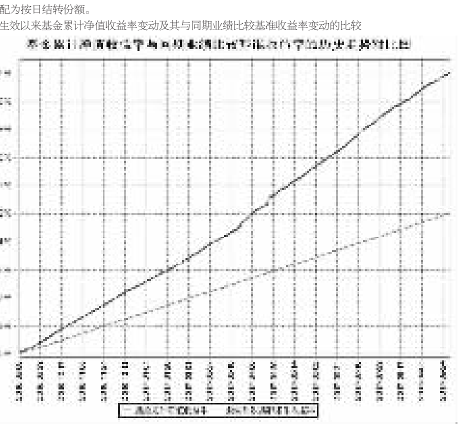
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6983%	0.0029%	0.3403%	0.0000%	0.3580%	0.0029%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

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



注:1、本基金合同生效日为2016年9月9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。

§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		
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016年9月9日	–	11	杨凯玮先生,台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员,台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员,台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员,台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长,华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理,安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	–	6	肖芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理,现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理助理,现任安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,现任安信保证金交易型货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金的基金经理。

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

三季度,经济景气度持续高位,投资增速、信贷增速基本保持稳定;监管态度温和,银行去杠杆进程加速,M2持续回落;超储率持续低位,shibor先下后上;我们根据对资金情况的预判进行了波段操作,并在季末月增配了大量优质资产,获取较高收益外,为四季度投资打好了基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.6983%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	固定收益投资	35,983,898.59	64.69
	其中:债券	35,983,898.59	64.69
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	19,470,711.00	35.00
4	其他资产	168,388.35	0.30
5	合计	55,622,997.94	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.87	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期末出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	53.34	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)-60天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	36.42	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-120天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)-397天(含)	10.68	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	100.43	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期末出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,895,966.62	10.68
2	央行票据	–	–
3	金融债券	20,110,490.62	36.42
	其中:政策性金融债	20,110,490.62	36.42
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	9,977,441.35	18.07
8	其他	–	–
9	合计	35,983,898.59	65.16
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130242	13国开42	200,000	20,110,490.62	36.42
2	111609420	16浦发CD420	100,000	9,977,441.35	18.07
3	019557	17国债03	59,000	5,895,966.62	10.68

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1071%
报告期内偏离度的最低值	-0.0172%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0352%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期末出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期末出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在100.00元

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,627.81
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	160,760.54
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	168,388.35

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,334,500.43
报告期期间基金总申购份额	38,650.45
报告期期间基金总赎回份额	1,820,920.59
报告期期末基金份额总额	552,230.29

注:本基金面值为100元。

§7 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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170717-20170930	363,620.00	2,329.00	226,297.00	139,652.00	25.30%
	2	20170918-20170930	152,386.00	1,056.00	–	153,442.00	27.79%
	3	20170719/20170915	181,072.00	2,585,360.00	2,761,070.00	5,362.00	0.97%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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保证金交易型货币市场基金募集的文件;
2、《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》;
3、《安信保证金交易型货币市场基金托管协议》;
4、《安信保证金交易型货币市场基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

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
2017年10月27日