安信策略精选灵活配置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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	安信灵活配置混合
交易代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 6 月 20 日
报告期末基金份额总额	100,018,346.76 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	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的模式,在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上,以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总指数收益率
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司

§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	7,264,372.41
2.本期利润	10,953,358.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.1079
4.期末基金资产净值	115,352,029.16
5.期末基金份额净值	1.153

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;

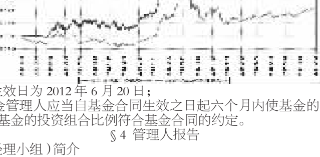
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	10.23%	0.91%	2.61%	0.35%	7.62%	0.56%

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 2012 年 6 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。

§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		
占冠良	本基金的基金经理、研究部总经理	2015年 12 月 1 日	-	16	占冠良先生,管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员,大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理,南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现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。

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,A 股市场整体表现为稳步上行,期间略有震荡,季度末市场相对平稳。大环境上,金融监管缓和,利率水平平稳,提供市场上行的支撑,而以钢铁行业为代表的周期行业业绩集中爆发,以及业绩爆发下的低估值,则为市场提供最强的上行动力。周期性行业的业绩爆发,得益于供给侧改革坚决贯彻执行下的供给收缩,而需求相对平稳,最终周期品价格上行。市场风格也由此出现较大变化,二季度表现超强的金融、消费等行业龙头公司在三季度相对走软,而周期行业涨幅表现极其抢眼。周期行业领涨,加上十九大之前的维稳预期,市场情绪面转好,投资者风险偏好提升,前期跌幅较大的中小创资产也有较好表现。在 9 月份,由于宏观数据的略微低预期,周期、成长与金融、消费资产的股价表现的此消彼长,市场风格分化有所缓和,消费类资产逐步企稳走好。

在本基金的投资运作上,三季度的组合策略较为积极,钢铁、有色、化工、造纸等周期性板块均有相当的投资参与,电子、通信、计算机等成长类资产也保持相当的比例配置,金融、食品饮料、建筑等稳定类资产则保留适当的投资比例。整体上,组合结构相对契合市场风格特征,组合收益表现尚可。

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 1.153 元;本报告期基金份额净值增长率为 10.23%,业绩比较基准收益率为 2.61%。

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	90,934,778.98	78.05
	其中:股票	90,934,778.98	78.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,182,855.90	7.88
	其中:债券	9,182,855.90	7.88
	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	7,800,000.00	6.70
	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	7,752,751.47	6.65
8	其他资产	832,272.08	0.71
9	合计	116,502,658.43	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	1,315,220.40	1.14
B	采矿业	4,802,660.75	4.16
C	制造业	61,139,322.88	53.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,000,841.51	4.34
F	批发和零售业	4,087,200.00	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	170,249.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,691,915.44	6.67
J	金融业	4,008,536.00	3.48
K	房地产业	1,762,227.00	1.53
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	205,884.00	0.18
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	750,722.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	90,934,778.98	78.83

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	300115	长盈精密	143,682	4,967,086.74	4.31
2	600487	亨通光电	125,936	4,332,198.40	3.76
3	600581	八一钢铁	285,000	4,158,150.00	3.60
4	002024	苏宁云商	312,000	4,087,200.00	3.54
5	002008	大族激光	90,400	3,941,440.00	3.42
6	000488	晨鸣纸业	172,351	3,379,803.11	2.93
7	002530	金财互联	103,000	3,218,750.00	2.79
8	300296	利亚德	128,663	2,592,559.45	2.25
9	300145	中金环境	150,169	2,540,859.48	2.20
10	002128	露天煤业	190,900	2,506,517.00	2.17

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	9,182,855.90	7.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,182,855.90	7.96

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	132001	14宝钢 EB	37,950	5,274,670.50	4.57
2	110034	九州转债	11,420	1,408,999.60	1.22
3	113013	国君转债	9,140	1,144,693.60	0.99
4	113011	光大转债	10,150	1,130,913.00	0.98
5	113009	广汽转债	1,760	223,009.60	0.19

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	44,004.94
2	应收证券清算款	739,986.07
3	应收股利	-
4	应收利息	42,792.96
5	应收申购款	5,488.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	832,272.08

5.11.4 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	110034	九州转债	1,408,999.60	1.22
2	113011	光大转债	1,130,913.00	0.98
3	113009	广汽转债	223,009.60	0.19

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	600581	八一钢铁	4,158,150.00	3.60	重大事项
2	300145	中金环境	2,540,859.48	2.20	重大事项

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	103,875,096.57
报告期期间基金总申购份额	1,271,179.66
减:报告期期间基金总赎回份额	5,127,929.47
报告期期末基金份额总额	100,018,346.76

§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

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	20170701-20170930	66,049,537.65	-	-	66,049,537.65	66.04%
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策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信策略精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

本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

安信动态策略灵活配置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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	安信动态策略混合	
交易代码	001185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年 4 月 15 日	
报告期末基金份额总额	250,868,486.84 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较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。	
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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C
下属分级基金的交易代码	001185	002029
报告期末下属分级基金的份额总额	250,320,876.29 份	547,610.55 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(2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 30 日)	
	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C
1.本期已实现收益	21,514,686.60	359,139.11
2.本期利润	14,424,116.46	187,879.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0525	0.0510
4.期末基金资产净值	306,971,536.78	668,375.71
5.期末基金份额净值	1.2263	1.2205

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

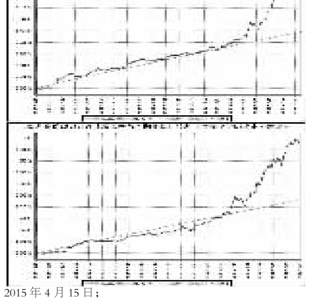
安信动态策略混合 A

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	4.33%	0.23%	1.13%	0.01%	3.20%	0.22%

安信动态策略混合 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	4.16%	0.23%	1.13%	0.01%	3.03%	0.22%

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 2015 年 4 月 15 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、本基金自 2015 年 11 月 17 日增加 C 类份额。

§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	2015年 4 月 15 日	-	11	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,现任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的基金经理助理、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;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、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、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

进入 2017 年三季度,由于 7、8 月份经济数据好于市场预期,强周期品种涨幅居前;进入 9 月份以后,在韧性较强的经济基本面支撑下,市场资金更愿意往中小创板块集中,以规避国家队在二级市场上对蓝筹股直接干预带来的不利影响,通信、电子元器件等行业涨幅后来居上,同时业绩预期较好的食品饮料、家电、汽车等行业取得较好的区间涨幅。

期间,安信动态策略基金坚持遵循绝对收益原则,主要持有业绩稳健、估值较低的金融、地产蓝筹股为主,同时增加医药、通信等趋势改善的行业配置,积极参与低风险新股投资,配置高等级优质债券,缩短组合久期,取得了较好的投资业绩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,安信动态策略 A 类份额净值为 1.2263 元,本报告期份额净值增长率为 4.33%;安信动态策略 C 类份额净值为 1.2205 元,本报告期份额净值增长率为 4.16%;同期业绩比较基准增长率为 1.13%。

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	121,846,487.05	39.34
	其中:股票	121,846,487.05	39.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	136,073,000.00	43.94
	其中:债券	136,073,000.00	43.94
	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	30,000,000.00	9.69
	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	17,990,341.43	5.81
8	其他资产	3,781,831.88	1.22
9	合计	309,691,660.36	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	1,464,831.00	0.48
B	采矿业	2,474,723.60	0.80
C	制造业	63,655,233.07	20.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,887,943.44	1.59
E	建筑业	28,821,566.72	9.37
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,133,388.03	0.37
J	金融业	11,207,693.34	3.64
K	房地产业	7,989,850.00	2.60
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	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	121,846,487.05	39.61

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	600068	葛洲坝	1,082,100	11,232,198.00	3.65
2	000423	东阿阿胶	104,745	6,801,092.85	2.21
3	601288	农业银行	1,749,937	6,684,759.34	2.17
4	000027	深圳能源	753,000	4,856,850.00	1.58
5	601766	中国中车	492,600	4,792,998.00	1.56
6	000063	中兴通讯	164,302	4,649,746.60	1.51
7	000776	广发证券	238,300	4,522,934.00	1.47
8	601800	中国交建	293,800	4,498,078.00	1.46
9	600019	宝钢股份	608,140	4,494,154.60	1.46
10	600048	保利地产	426,500	4,435,600.00	1.44

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	39,148,000.00	12.73
	其中:政策性金融债	39,148,000.00	12.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	96,925,000.00	31.51
9	其他	-	-
10	合计	136,073,000.00	44.23

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	111610569	16兴业 CD569	500,000	48,500,000.00	15.77
2	111617287	16光大 CD287	500,000	48,425,000.00	15.74
3	150212	15国开 12	200,000	19,948,000.00	6.48
4	160206	16国开 06	200,000	19,200,000.00	6.24

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

本基金在进行股指期货投资时,以风险对冲、套期保值为主要目的,将选择流动性好、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现货资产进行严格匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,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

本基金投资的前十名证券的发行主体除广发证券(000776),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 2016 年 11 月 28 日广发证券股份有限公司(下称广发证券,股票代码:000776)《关于收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》的公告》,2016 年 11 月 26 日,广发证券收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]128 号),依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,证监会决定:对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得 6,805,135.75 元,并处以 20,415,407.25 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	77,798.94
2	应收证券清算款	284,973.05
3	应收股利	-
4	应收利息	3,325,147.66
5	应收申购款	93,912.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,781,831.88

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

项目	安信动态策略混合 A	安信动态策略混合 C
报告期期初基金份额总额	347,128,538.12	9,824,290.93
报告期期间基金总申购份额	3,446,936.35	1,007,124.66
减:报告期期间基金总赎回份额	100,254,598.18	10,283,805.04
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	250,320,876.29	547,610.55

§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,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	20170701-20170930	140,976,503.76	-	-	140,976,503.76	56.20%
	2	20170701-20170721	93,544,434.05	-	93,544,434.05	0.00	0.00%
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动态策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信动态策略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

本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

安信合作创新主题沪港深灵活配置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	安信合作创新混合
交易代码	004393
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	245,016,789.52 份
投资目标	在深入的基本面研究的基础上,在本基金关注的领域内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	资产配置上,本基金以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,结合定量分析的方法,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。股票投资上,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活投资于具有合作创新(Public-Private-Partnership,简称 PPP)主题相关领域的上市公司证券,通过合作创新(PPP)主题股票池的构建和个股精选,谋求基金资产的长期稳定增长。债券投资上,以企业债、公司债和可转债为主,并根据流动性管理的需要配置国债和货币市场工具。此外,本基金将投资于股指期货、权证、资产支持证券等,实现基金资产保值增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×40% +恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%
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	中国银行股份有限公司

§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	16,772,352.05
2.本期利润	19,856,993.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0736
4.期末基金资产净值	281,974,476.59
5.期末基金份额净值	1.1508

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;

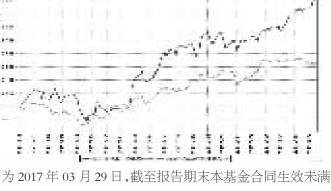
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	6.98%	0.56%	3.44%	0.37%	3.54%	0.19%

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 2017 年 03 月 29 日,截至报告期末本基金合同生效未满一年;

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		
陈一峰	本基金的基金经理、公司总经理助理兼权益投资部总经理	2017年 3 月 29 日	-	9	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、权益投资部基金经理,现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。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;现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张明	本基金的基金经理	2017年 5 月 5 日	-	6	张明先生,管理学硕士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组任研究部研究员,2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、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权益投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,安信中国制造 2025 港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深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、安信鑫安得利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

报告期内,我们继续坚持自下而上的投资选股思路,在充分研究公司商业模式、竞争优势,公司成长空间行业竞争格局的背景下,结合估值水平,注重安全边际,选择低估值的价值股和合理估值的成长股,总结成一句话就是:"好公司,好价格,买入并持有,赚钱是大概率事件"。

从市场角度来看,三季度市场保持一个震荡略微上行的态势,沪深 300 指数上涨 4.6%,中证 500 指数上证 7.6%,创业板指上涨 2.7%,三季度我们的产品也取得了一定涨幅,截止三季度末单位净值 1.1508,三季度上涨 6.98%,成立以来上涨了 15.09%。结构方面,虽然有一些题材类股票估值仍然偏高,但市场估值分化依然较大,可选的优秀公司估值水平都还在相对合理的位置。

对未来的展望方面,我们认为短期市场还将维持震荡的格局,大盘股估值还处于历史平均位置,创业板指估值已经跌到历史后 1/4 的水平,但绝对估值水平仍然偏高,我们继续坚持以精选个股为主要投资策略,股票仓位控制在 70-80%,选择买入价值存在低估的优秀公司以期望为投资者获取长期回报。

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 1.1508 元;本报告期基金份额净值增长率为 6.98%,业绩比较基准收益率为 3.44%。

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	207,856,970.08	72.51
	其中:股票	207,856,970.08	72.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	384,697.47	0.13
	其中:债券	384,697.47	0.13
	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	50,000,000.00	17.44
	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	27,730,293.22	9.67
8	其他资产	696,061.19	0.24
9	合计	286,668,021.96	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	370,700.00	0.13
B	采矿业	12,140,132.58	4.31
C	制造业	140,887,081.34	49.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	26,033,486.84	9.23
F	批发和零售业	7,741,778.11	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	1,824,073.91	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,455,757.03	1.93
J	金融业	9,620,551.46	3.41
K	房地产业	1,040,000.00	0.37
L	租赁和商务服务业	1,931,700.45	0.69
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	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	207,204,431.20	73.48

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	652,538.88	0.23
合计	652,538.88	0.23

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	600487	亨通光电	313,882	10,797,540.80	3.83
2	000488	晨鸣纸业	511,818	10,036,750.98	3.56
3	601088	中国神华	475,467	9,956,278.98	3.53
4	600309	万华化学	230,060	9,697,029.00	3.44
5	000651	格力电器	243,903	9,243,923.70	3.28
6	601799	星宇股份	169,597	8,451,018.51	3.00
7	000786	北新建材	489,100	8,407,629.00	2.98
8	600068	葛洲坝	754,395	7,830,620.10	2.78
9	601012	隆基股份	242,181	7,137,074.07	2.53
10	002271	东方雨虹	184,421	7,113,117.97	2.52

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	384,697.47	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	384,697.47	0.14

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	128016	雨虹转债	3,847	384,697.47	0.14

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

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	190,066.05
2	应收证券清算款	557,281.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-51,286.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	696,061.19

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	308,167,247.11
报告期期间基金总申购份额	106,011,499.53
减:报告期期间基金总赎回份额	169,161,957.12
报告期期末基金份额总额	245,016,789.52

§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,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合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信合作创新主题沪港深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

本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