安信目标收益债券型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	安信目标收益债券	
交易代码	750002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月25日	
报告期末基金份额总额	191,156,942.88份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,以3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)为收益跟踪目标,并力争实现超越目标基准的投资回报。	
投资策略	基于货币政策研究、利率研究等宏观基本面研究,根据风险收益特征对普通债券、浮动利息债券、可转换债券和资产支持证券等大类资产进行配置比例。通过研究基准利率类型、利差水平、发行主体等因素,并结合市场预期分析和对市场基准利率走势的判断,制定浮息债的投资策略。密切跟踪债券发行市场的供应状况,深入研究利差变动,在重点研究发行人特征及其信用水平、债券类型、担保情况、发行利率和承销商构成的基础上积极参与债券一级市场投资。可转债的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法,利用期权定价模型等数量化方法对可转换债券的价值进行估算,选择价值低估的可转换债券进行投资。同时,持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,对普通的和创新的资产支持证券品种进行深入分析,制定周密资产支持证券投资策略。普通债券投资策略包括品种配置策略、收益率曲线配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购策略等。	
业绩比较基准	3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市场基金,属于中低风险和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	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
下属分级基金的交易代码	750002	750003
报告期末下属分级基金的份额总额	43,582,387.85份	147,574,555.03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)	
	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
1.本期已实现收益	184,572.61	325,592.41
2.本期利润	616,383.42	2,152,664.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139	0.0132
4.期末基金资产净值	50,869,718.75	168,234,489.46
5.期末基金份额净值	1.167	1.140

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

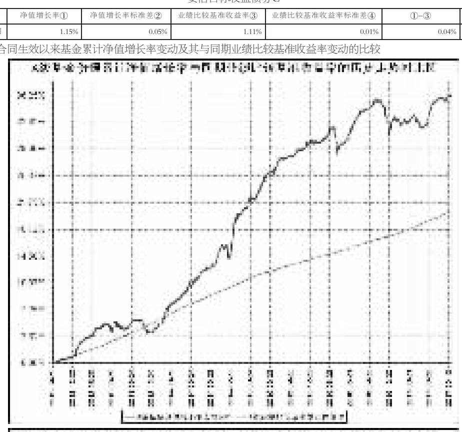
安信目标收益债券A

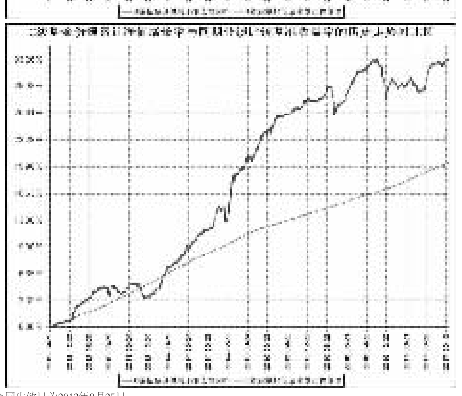
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	0.05%	1.11%	0.01%	0.10%	0.04%

安信目标收益债券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	1.15%	0.05%	1.11%	0.01%	0.04%	0.04%

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2012年9月25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		
张翼飞	本基金的基金经理	2016年3月14日	-	6.5	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,秦皇岛嘉隆高科实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。现任安信基金管理有限责任公司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、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信新起点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

本报告期内,货币市场处于紧平衡的状态,资金利率阶段性处于高位,债券市场仍处于降杠杆过程中。期间,我们适当缩短了久期,适当降低了仓位,始终坚持中高评级的信用策略。比较好的适应了当前的市场环境。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信目标收益债券A基金份额净值为1.1670元,本报告期基金份额净值增长率为1.21%;截至本报告期末安信目标收益债券C基金份额净值为1.1400元,本报告期基金份额净值增长率为1.15%;同期业绩比较基准收益率为1.11%。

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	258,992,530.80	96.61
	其中:债券	258,992,530.80	96.61
	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	3,771,633.75	1.41
8	其他资产	5,329,408.25	1.99
9	合计	268,093,572.80	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	7,567,594.20	3.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,802,696.40	3.56
	其中:政策性金融债	7,802,696.40	3.56
4	企业债券	38,702,890.20	17.66
5	企业短期融资券	65,280,500.00	29.79
6	中期票据	121,586,100.00	55.49
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	18,052,750.00	8.24
9	其他	-	-
10	合计	258,992,530.80	118.21

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	041762004	17长白山CP001	200,000	20,084,000.00	9.17
2	041751010	17浪奇CP001	200,000	20,058,000.00	9.15
3	101562024	15甬保投MTN001	200,000	20,034,000.00	9.14
4	101759022	17九江置地MTN001	200,000	20,012,000.00	9.13
5	101669002	16飞乐音响MTN001	200,000	19,790,000.00	9.03

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	3,351.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,324,856.98
5	应收申购款	1,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,329,408.25

5.10.4 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。

5.10.5 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

项目	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
报告期期初基金份额总额	44,506,846.42	184,952,798.88
报告期期间基金总申购份额	1,342,399.73	6,801,039.14
减:报告期期间基金总赎回份额	2,266,858.30	44,179,282.99
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	43,582,387.85	147,574,555.03

§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	87,719,670.10	-	40,000,000.00	47,719,670.10	24.96%
	2	20170701-20170930	58,953,262.89	-	-	58,953,262.89	30.84%
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目标收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《安信目标收益债券型证券投资基金托管协议》;

4、《安信目标收益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。

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

安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

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	安信平稳增长混合发起	
交易代码	750005	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2012年12月18日	
报告期末基金份额总额	655,773,835.37份	
投资目标	通过稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,并通过积极主动的股票投资和债券投资,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。	
投资策略	1、资产配置策略:研究与跟踪宏观经济运行状况和市场变动特征,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。 2、上市公司研究方法:以深入细致的公司研究推动股票的精选与投资。在对上市公司的研究中,采用安信基金三因素分析法,即重点分析上市公司的盈利模式、竞争优势和其所处行业的发展环境。 3、股票投资策略:坚持价值投资理念,以PE/PB等估值指标入手对价值型公司进行评估,在扎实深入的公司研究基础上,重点发掘出价值低估的股票。 4、债券投资策略:采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会。	
业绩比较基准	50%×中证800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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信平稳增长混合A	安信平稳增长混合C
下属分级基金的交易代码	750005	002035
报告期末下属分级基金的份额总额	268,384,897.09份	387,388,938.28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)	
	安信平稳增长混合A	安信平稳增长混合C
1.本期已实现收益	3,055,182.34	4,583,604.09
2.本期利润	4,863,579.59	7,282,099.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0178	0.0172
4.期末基金资产净值	308,237,727.68	444,399,759.79
5.期末基金份额净值	1.1485	1.1472

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

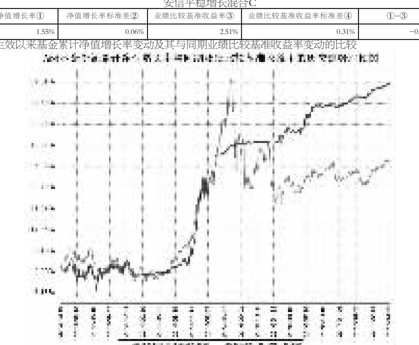
安信平稳增长混合A

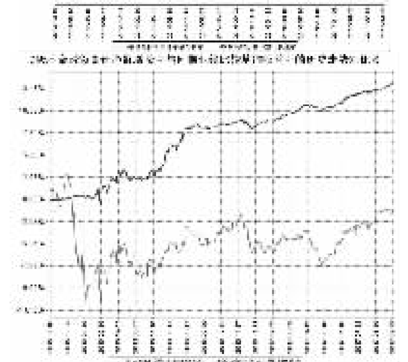
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.57%	0.06%	2.51%	0.31%	-0.94%	-0.25%

安信平稳增长混合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	1.55%	0.06%	2.51%	0.31%	-0.96%	-0.25%

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2012年12月18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	2016年9月12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。
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

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。

本基金精选个股,并通过控制组合股票仓位较好地控制了净值波动,取得了较高的风险报酬比。三季度债券部分主要进行了短久期债券的操作,增加了资本利得。

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

截至本报告期末安信平稳增长混合A基金份额净值为1.1485元,本报告期基金份额净值增长率为1.57%;截至本报告期末安信平稳增长混合C基金份额净值为1.1472元,本报告期基金份额净值增长率为1.55%;同期业绩比较基准收益率为2.51%。

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	64,714,274.71	8.56
	其中:股票	64,714,274.71	8.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	630,366,253.28	83.36
	其中:债券	610,305,234.10	80.71
	资产支持证券	20,061,019.18	2.65
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	30,022,245.03	3.97
	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	19,760,409.71	2.61
8	其他资产	11,329,426.15	1.50
9	合计	756,192,608.88	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	7,765,699.60	1.03
C	制造业	38,592,761.78	5.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,038,422.60	0.40
F	批发和零售业	1,122,285.45	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	9,888,325.90	1.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,114,560.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	2,655.00	0.00
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	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.00
S	综合	-	-
	合计	64,714,274.71	8.60

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	600487	亨通光电	160,000	5,504,000.00	0.73
2	600887	伊利股份	200,000	5,500,000.00	0.73
3	600036	招商银行	180,500	4,611,775.00	0.61
4	601799	星宇股份	85,000	4,235,550.00	0.56
5	601088	中国神华	199,900	4,185,906.00	0.56
6	600138	中青旅	192,000	4,114,560.00	0.55
7	600519	贵州茅台	7,000	3,623,480.00	0.48
8	600028	中国石化	600,000	3,540,000.00	0.47
9	601012	隆基股份	110,000	3,241,700.00	0.43
10	600066	宇通客车	97,600	2,400,960.00	0.32

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	29,985,000.00	3.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	117,109,500.00	15.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,606,000.00	5.40
7	可转债(可交换债)	12,337,734.10	1.64
8	同业存单	410,267,000.00	54.51
9	其他	-	-
10	合计	610,305,234.10	81.09

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	111780862	17南京银行CD131	1,000,000	96,620,000.00	12.84
2	111709292	17浦发银行CD292	500,000	49,455,000.00	6.57
2	111710387	17兴业银行CD387	500,000	49,455,000.00	6.57
3	111710342	17兴业银行CD342	500,000	48,915,000.00	6.50
4	111698790	16西安银行CD036	500,000	48,445,000.00	6.44
5	111680815	16包商银行CD074	400,000	38,584,000.00	5.13

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142628	花呗分期02A1	200,000	20,061,019.18	2.67

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	20,119.08
2	应收证券清算款	101,349.85
3	应收股利	-
4	应收利息	11,203,015.11
5	应收申购款	4,942.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,329,426.15

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	113011	光大转债	12,249,514.80	1.63

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	安信平稳增长混合A	安信平稳增长混合C
报告期期初基金份额总额	275,219,562.61	445,307,735.06
报告期期间基金总申购份额	1,278,351.57	17.56
减:报告期期间基金总赎回份额	8,113,017.09	57,918,814.34
报告期期末基金份额总额	268,384,897.09	387,388,938.28

§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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	9,999,000.00	1.52	9,999,000.00	1.52	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,000.00	1.52	9,999,000.00	1.52	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	364,947,142.06	-	-	364,947,142.06	55.65%
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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信平稳增长混合型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金托管协议》;

4、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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

安信稳健增值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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	安信稳健增值混合	
交易代码	001316	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月25日	
报告期末基金份额总额	428,154,709.11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	资产配置方面,通过宏观基本面定性和定量研究,结合政策因素、市场情绪与估值因素等对比分析大类资产风险收益比,合理分配各大类资产配置比例;固定收益类投资方面,在自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略;股票投资上,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;此外,本基金会利用股指期货、国债期货、权证等衍生工具做套保或套利投资,对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略,实现基金资产增值增厚。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的金融机构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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
下属分级基金的交易代码	001316	001338
报告期末下属分级基金的份额总额	107,551,914.90份	320,602,794.21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)	
	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
1.本期已实现收益	3,828,859.61	7,047,348.69
2.本期利润	3,655,507.12	5,986,053.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0244	0.0169
4.期末基金资产净值	124,669,405.47	378,223,000.19
5.期末基金份额净值	1.1592	1.1797

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

安信稳健增值混合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	1.99%	0.07%	1.03%	0.01%	0.96%	0.06%

安信稳健增值混合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	1.51%	0.07%	1.03%	0.01%	0.48%	0.06%

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25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		
张翼飞	本基金的基金经理	2015年5月25日	-	6.5	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,秦皇岛嘉隆高科实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。现任安信基金管理有限责任公司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、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信新起点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

本报告期内,货币市场处于紧平衡的状态,资金利率阶段性处于高位,债券市场仍处于降杠杆过程中。股票市场整体还处于温和的结构性牛市进程中。

固定收益方面,我们适当缩短了久期,适当降低了仓位,始终坚持中高评级的信用策略。比较好的适应了当前的市场环境。

权益方面,我们始终坚持价值投资,优选成长确定并可持续、估值合理的大盘蓝筹股。重点配置了汽车、保险、家电、机场、电力等行业。在此轮温和的结构性牛市行情中,获得了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信稳健增值混合A基金份额净值为1.1592元,本报告期基金份额净值增长率为1.99%;截至本报告期末安信稳健增值混合C基金份额净值为1.1797元,本报告期基金份额净值增长率为1.51%;同期业绩比较基准收益率为1.03%。

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	62,560,179.82	9.83
	其中:股票	62,560,179.82	9.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	561,195,130.40	88.21
	其中:债券	561,195,130.40	88.21
	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	2,981,986.57	0.47
8	其他资产	9,442,492.67	1.48
9	合计	636,179,789.46	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	39,793.60	0.01
C	制造业	31,186,439.36	6.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,014,000.00	0.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,009,038.94	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	11,516,880.00	2.29
K	房地产业	10,603,650.00	2.11
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	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	62,560,179.82	12.44

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	600741	华域汽车	430,022	9,696,996.10	1.93
2	601988	中国银行	1,770,000	7,292,400.00	1.45
3	600048	保利地产	606,000	6,302,400.00	1.25
4	600660	福耀玻璃	210,000	5,352,900.00	1.06
5	600104	上汽集团	163,400	4,933,046.00	0.98
6	600566	济川药业	120,022	4,424,010.92	0.88
7	600383	金地集团	375,000	4,301,250.00	0.86
8	601318	中国平安	78,000	4,224,480.00	0.84
9	600004	白云机场	317,067	4,150,407.03	0.83
10	600900	长江电力	200,000	3,014,000.00	0.60

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	34,685,188.50	6.90
	其中:政策性金融债	34,685,188.50	6.90
4	企业债券	91,036,691.90	18.10
5	企业短期融资券	90,412,000.00	17.98
6	中期票据	157,525,000.00	31.32
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	187,536,250.00	37.29
9	其他	-	-
10	合计	561,195,130.40	111.59

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	111714181	17江苏银行CD181	1,000,000	97,690,000.00	19.43
2	111717178	17光大银行CD178	500,000	49,450,000.00	9.83
3	041658058	16营口港CP003	400,000	40,236,000.00	8.00
4	101656038	16新投MTN001	400,000	39,004,000.00	7.76
5	101760049	17昆明经开MTN001	300,000	30,201,000.00	6.01

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

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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	33,812.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,407,690.16
5	应收申购款	990.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,442,492.67

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	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
报告期期初基金份额总额	346,241,831.97	366,534,850.34
报告期期间基金总申购份额	840,066.27	1,073,581.68
减:报告期期间基金总赎回份额	239,529,983.34	47,005,637.81
报告期期末基金份额总额	107,551,914.90	320,602,794.21

§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	222,528,172.43	-	-	222,528,172.43	51.97%
	2	20170905-20170930	89,365,504.92	-	-	89,365,504.92	20.87%
	3	20170701-20170717	181,092,901.10	-	181,092,901.10	-	-
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稳健增值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信稳健增值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