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:2018年10月25日

安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

§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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信中国制造混合
基金主代码	004249
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月16日
报告期末基金份额总额	82,420,051.09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,灵活投资于具有中国制造2025相关领域的上市公司证券,通过中国制造2025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	沪深300指数收益率×50%+中债总指数收益率×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	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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	576,056.25
2.本期利润	-5,966,884.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0717
4.期末基金资产净值	85,760,464.35
5.期末基金份额净值	1.041

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	-6.38%	1.26%	-0.80%	0.67%	-5.58%	0.59%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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3月16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		
谭珏娜	本基金的基金经理	2017年12月6日	-	12年	谭珏娜女士,经济学学士。历任招商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员,2013年4月加入安信基金管理有限责任公司,历任运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理、研究部研究员,现任权益投资部基金经理。曾任安信工业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助理;现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理,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、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。
张明	本基金的基金经理	2017年5月5日	-	7年	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、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
陈一峰	本基金的基金经理,总经理助理兼研究总监	2017年3月16日	-	10年	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、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。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。

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

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品一直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"。

今年三季度市场延续上半年的下跌走势,上证指数下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,中证500指数下跌7.99%,创业板指数下跌12.16%,今年以来沪深300指数下跌14.69%,中证500指数下跌23.2%。分行业来看,今年以来休闲服务、银行、食品饮料等行业跌幅较少,电子、传媒、有色等行业跌幅较大。截至2018年三季度末,本基金单位净值为1.041,本季度收益率-6.38%,今年以来产品收益率-13.9%,今年以来总体比市场指数表现略好。

今年以来股票市场的下跌可能主要由两个因素导致,一是以中美贸易战的爆发为标志,国内外经济形势发生了一些变化,导致市场对我们未来宏观经济出现下滑的担忧,二是上半年实体经济与金融行业去杠杆政策的执行导致资金面出现一定程度的紧张,部分上市公司股权质押出现问题,市场成交量持续低迷,我们认为随着市场指数的大幅下跌,目前风险已经释放了许多,一方面市场陆续认识到寄希望于中美贸易纠纷能够短期解决已经不太可能,另一方面,国家也陆续出台了各种减税降费等稳增长的政策,我们认为对中国经济的长期前景不必过分担忧,市场层面来看,无论是从各大指数的估值角度,还是上市公司破净股的个数等方面,都可以看出市场指数已经处于历史偏低估的状态。

本基金三季度运作总体与前述投资思路保持一致,始终在符合中国制造2025主题范围的公司中,按照前述选股标准,筛选出便宜的好公司,我们相信长期投资这些优秀公司会给基金带来不错的收益。

我们认为今年以来中美贸易战问题持续发酵,引起大家对中国制造业崛起的担心,但我们认为改革开放40年以来,中国在许多制造业领域,例如汽车、家电、机械、化工、纺织等,我们国家的产销规模均成为了世界第一的水平,但整体技术难度,高附加值的产品还相对较少,我们认为未来10-20年,随着我国工程师红利的不断体现,中国的制造业水平仍将继续提高,从制造大国向制造强国转变,我们会继续加强研究,从中筛选出长期竞争力突出的优秀制造业公司。

未来如果市场继续下跌,我们会适时将股票仓位提高,目前看好的公司继续集中在家电、建筑建材、食品饮料、轻工、新能源发电等细分行业的优秀公司。

4.4.2 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1.041元;本报告期基金份额净值增长率为-6.38%,业绩比较基准收益率为-0.80%。

4.5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,772,681.50	80.79
	其中:股票	69,772,681.50	80.79
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	16,150,110.01	18.70
8	其他资产	442,693.04	0.51
9	合计	86,365,484.55	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	4,116,800.00	4.80
C	制造业	52,863,573.64	61.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,745,000.00	3.20
F	批发和零售业	2,020,369.47	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	908,000.00	1.06
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	4,519,088.39	5.27
K	房地产业	1,277,850.00	1.49
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	1,322,000.00	1.54
S	综合	-	-
	合计	69,772,681.50	81.36

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	000651	格力电器	113,000	4,542,600.00	5.30
2	000786	北新建材	250,000	4,147,500.00	4.84
3	600519	贵州茅台	5,500	4,015,000.00	4.68
4	601088	中国神华	160,000	3,262,400.00	3.80
5	600487	亨通光电	130,000	3,105,700.00	3.62
6	600104	上汽集团	90,000	2,995,200.00	3.49
7	600352	浙江龙盛	289,907	2,829,492.32	3.30
8	002508	老板电器	120,046	2,811,477.32	3.28
9	601668	中国建筑	500,000	2,745,000.00	3.20
10	601799	星宇股份	50,700	2,654,652.00	3.10

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。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,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

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(人民币元)
1	存出保证金	9,293.53
2	应收证券清算款	430,031.31
3	应收股利	-
4	应收利息	3,368.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,693.04

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	84,453,689.44
报告期期间基金总申购份额	1,453,703.92
减:报告期期间基金总赎回份额	3,487,342.27
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	82,420,051.09

§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	8,277,317.88
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	8,277,317.88
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	10.04

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

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	20180701-20180930	20,000,111.11	-	-	20,000,111.11	24.27
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中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信中国制造2025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

2018年10月25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:2018年10月25日

安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金

2018年第三季度报告

§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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信复兴100指数	
交易代码	005807	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年06月21日	
报告期末基金份额总额	129,145,763.85份	
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证复兴发展100主题指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。	
业绩比较基准	中证复兴发展100主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为股票型,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	
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	安信复兴100指数A	安信复兴100指数C
下属分级基金的交易代码	005807	005808
报告期末下属分级基金的份额总额	127,066,185.57份	2,079,578.28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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	安信复兴100指数A	安信复兴100指数C
1.本期已实现收益	-3,330,881.22	-62,938.34
2.本期利润	-3,191,146.52	-657,500.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0202	-0.0403
4.期末基金资产净值	124,302,612.70	2,031,890.21
5.期末基金份额净值	0.9783	0.9771

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

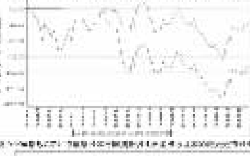
安信复兴100指数A

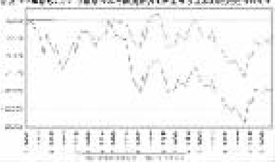
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.22%	1.03%	-7.01%	1.38%	4.79%	-0.35%

安信复兴100指数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	-2.34%	1.03%	-7.01%	1.38%	4.67%	-0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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2018年6月21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。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。

§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		
龙川	本基金的基金经理,量化投资部总经理	2018年6月21日	-	16年	龙川先生,统计学博士。历任Susquehanna International Group(美国)量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信基金稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金、安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式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

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场回顾:今年三季度市场延续上半年的下跌走势,上证指数下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,中证500指数下跌7.99%,创业板指数下跌12.16%,今年以来沪深300指数下跌14.69%,中证500指数下跌23.2%。我们对未来市场相对比较谨慎,主要原因在于不确定性显著加强:首先全球贸易角度看,贸易保护主义抬头,贸易摩擦加剧加之地缘政治问题凸显,不仅是中美贸易摩擦有不断加剧的趋势,其长期的不确定性对全球经济可能会产生较大冲击;其次是国内不确定性也在增加,在金融去杠杆的政策背景下,信贷资金难以与信托等非标资金衔接,部分实体融资难的问题难以解决。国内无风险利率即使出现一定的下行,也难以达到普惠的作用。未来不确定性远超过往,预期收益率大概率显著低于过往几年。市场也存在一些积极的因素:(1)减税预期增强,这对于促进消费,降低企业成本起到重要推力;(2)贸易战具有长期性,但对市场冲击最严重的时间窗口可能已经过去;(3)信用风险和质押爆仓的风险在边际好转,中小企业的融资环境正在改善;(4)整体估值处于历史低位,产业资本回购、增持等积极信号在增加。

投资策略:目前本基金仍处于建仓期,报告期内仓位逐渐增加。今后本基金将秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,跟踪指数收益,力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金A类基金份额净值为0.9783元,本报告期基金份额净值增长率为-2.22%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为0.9771元,本报告期基金份额净值增长率为-2.34%;同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

4.5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	117,633,208.86	92.58
	其中:股票	117,633,208.86	92.58
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	9,173,150.85	7.22
8	其他资产	259,420.32	0.20
9	合计	127,065,780.03	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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	4,314,536.00	3.42
C	制造业	79,301,959.33	62.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	440,863.00	0.35
E	建筑业	6,069,812.00	4.80
F	批发和零售业	6,770,846.03	5.36
G	交通运输、仓储和邮政业	3,105,885.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,373,744.00	1.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,014,572.76	7.93
L	租赁和商务服务业	1,580,528.74	1.25
M	科学研究和技术服务业	143,408.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	674,240.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,460,064.00	1.16
R	文化、体育和娱乐业	1,382,750.00	1.09
S	综合	-	-
	合计	117,633,208.86	93.11

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

指数投资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	600104	上汽集团	193,800	6,449,664.00	5.11
2	000002	万 科A	247,740	6,020,082.00	4.77
3	601012	隆基股份	347,100	4,928,820.00	3.90
4	600028	中国石化	579,900	4,128,888.00	3.27
5	600585	海螺水泥	110,300	4,057,937.00	3.21
6	600309	万华化学	90,666	3,850,585.02	3.05
7	600332	白云山	100,100	3,663,660.00	2.90
8	601186	中国铁建	253,200	2,823,180.00	2.23
9	600482	中国动力	120,100	2,782,717.00	2.20
10	601006	大秦铁路	328,800	2,706,024.00	2.14

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行国债期货投资,将构建量化分析体系,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管理利率波动风险,实现基金资产保值增值。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除白云山(股票代码:600332)、中国动力(股票代码:600482),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。

广州白云山医药集团股份有限公司白云山何公制药厂于2017年12月26日收到由广州市食品药品监督管理局发出的食品药品行政执法文书《行政处罚决定书》(穗)食药监药罚【2017】155号("处罚决定书"),明确何济公药厂于2016年12月至2017年2月期间生产药品曲咪新乳膏(批号:A1089),经菏泽市食品药品检验检测研究院检验"装量"检验项的检验结果不符合规定,予以以下处罚:1、没收本批次产品销售所得166,565.21元;2、罚款183,221.73元。

中国船舶重工集团动力股份有限公司(下称中国动力)因未按要求及时披露2016年年度业绩预告、未按要求及时披露大额政府补助信息等行为,违反了《上海证券交易所股票上市规则》,于2018年1月18日受到上海证券交易所如下纪律处分决定:对中国船舶重工集团动力股份有限公司和时任财务总监韩军、时任董事会秘书王彬予以通报批评。

基金管理人对上述证券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(人民币元)
1	存出保证金	37,513.90
2	应收证券清算款	215,619.46
3	应收股利	-
4	应收利息	2,031.32
5	应收申购款	4,255.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,420.32

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

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

期末积极投资前五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积极投资股票。

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	安信复兴100指数A	安信复兴100指数C
报告期期初基金份额总额	297,585,490.89	35,097,805.58
报告期期间基金总申购份额	620,757.13	288,360.53
减:报告期期间基金总赎回份额	171,140,062.45	33,306,587.83
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	127,066,185.57	2,079,578.28

§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

本报告期末本基金管理人未持有本基金。

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

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中证复兴发展100主题指数型证券投资基金募集的文件;

2、《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金基金合同》;

3、《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金托管协议》;

4、《安信中证复兴发展100主题指数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

2018年10月25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:2018年10月25日

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

§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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信一带一路分级		
场内简称	一带分级		
交易代码	167503		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2015年05月14日		
报告期末基金份额总额	198,121,335.41份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	股票投资上,本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整;债券投资上,本基金将以宏观形势及利率分析为基础,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价;权证投资上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价,谨慎进行权证投资;资产支持证券投资方面,综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。		
业绩比较基准	中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
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	一带分级	一带一A	一带一B
下属分级基金的交易代码	167503	150275	150276
报告期末下属分级基金的份额总额	95,925,731.41份	51,097,802.00份	51,097,802.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时,本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	安信一带一路A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	安信一带一路B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

§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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-30,264,404.69
2.本期利润	10,662,358.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0485
4.期末基金资产净值	207,607,039.56
5.期末基金份额净值	1.048

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;

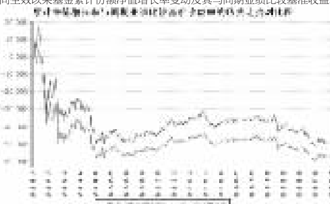
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	5.54%	1.32%	3.77%	1.27%	1.77%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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14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		
龙川	本基金的基金经理,量化投资部总经理	2015年5月14日	-	16年	龙川先生,统计学博士。历任Susquehanna International Group(美国)量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信基金稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金、安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式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

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场回顾:今年三季度市场延续上半年的下跌走势,上证指数下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,中证500指数下跌7.99%,创业板指数下跌12.16%,今年以来沪深300指数下跌14.69%,中证500指数下跌23.2%。我们对未来市场相对比较谨慎,主要原因在于不确定性显著加强:首先全球贸易角度看,贸易保护主义抬头,贸易摩擦加剧加之地缘政治问题凸显,不仅是中美贸易摩擦有不断加剧的趋势,其长期的不确定性对全球经济可能会产生较大冲击;其次是国内不确定性也在增加,在金融去杠杆的政策背景下,信贷资金难以与信托等非标资金衔接,部分实体融资难的问题难以解决。国内无风险利率即使出现一定的下行,也难以达到普惠的作用。未来不确定性远超过往,预期收益率大概率显著低于过往几年。市场也存在一些积极的因素:(1)减税预期增强,这对于促进消费,降低企业成本起到重要推力;(2)贸易战具有长期性,但对市场冲击最严重的时间窗口可能已经过去;(3)信用风险和质押爆仓的风险在边际好转,中小企业的融资环境正在改善;(4)整体估值处于历史低位,产业资本回购、增持等积极信号在增加。

投资策略:本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,跟踪指数收益,力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.4.2 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1.048元;本报告期基金份额净值增长率为5.54%,业绩比较基准收益率为3.77%。

4.5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	191,243,059.36	91.60
	其中:股票	191,243,059.36	91.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,208,168.50	2.02
	其中:债券	4,208,168.50	2.02
	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	12,810,873.71	6.14
8	其他资产	513,737.88	0.25
9	合计	208,775,839.45	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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	21,043,129.66	10.14
C	制造业	93,823,580.88	45.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,576,640.00	0.76
E	建筑业	40,798,688.40	19.65
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	21,772,618.40	10.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,769,537.90	2.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,223,830.00	3.00
M	科学研究和技术服务业	235,034.12	0.11
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	191,243,059.36	92.12

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

指数投资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	601186	中国铁建	570,007	6,355,578.05	3.06
2	601888	中国国旅	91,500	6,223,830.00	3.00
3	000338	潍柴动力	720,194	6,157,658.70	2.97
4	601766	中国中车	709,309	6,128,429.76	2.95
5	601989	中国重工	1,415,151	6,014,391.75	2.90
6	000063	中兴通讯	322,203	5,896,314.90	2.84
7	600585	海螺水泥	159,700	5,875,363.00	2.83
8	600406	国电南瑞	326,886	5,769,537.90	2.78
9	601668	中国建筑	1,050,559	5,767,568.91	2.78
10	601390	中国中铁	741,931	5,764,803.87	2.78

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	3,202,168.50	1.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,006,000.00	0.48
	其中:政策性金融债	1,006,000.00	0.48
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	-	-
9	合计	4,208,168.50	2.03

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	019585	18国债03	31,910	3,202,168.50	1.54
2	018005	国开1701	10,000	1,006,000.00	0.48

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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(人民币元)
1	存出保证金	149,137.40
2	应收证券清算款	229,931.69
3	应收股利	-
4	应收利息	95,843.49
5	应收申购款	38,825.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	513,737.88

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

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五名中不存在流通受限情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名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	一带分级	一带一A	一带一B
报告期期初基金份额总额	156,245,169.84	57,312,877.00	57,312,877.00
报告期期间基金总申购份额	3,263,167.75	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	76,012,756.18	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	12,430,150.00	-6,215,075.00	-6,215,075.00
报告期期末基金份额总额	95,925,731.41	51,097,802.00	51,097,802.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

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

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中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件;

2、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》;

4、《安信中证一带一路主题指数分级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

2018年10月25日