

# 安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中信建投证券股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人中信建投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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中信建投证券股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人中信建投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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

**2.1 基金基本情况**

基金名称	安信比较优势混合
基金代码	006567
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年03月21日
报告期末基金份额总额	2,047,366,836.06份

**投资目标**

本基金通过资产配置,精选个股,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金基于"价值投资"理念,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**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	1,749,077,038.62	82.94
2	基金投资	1,749,077,038.62	82.94
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	未确认损益	-	-
9	合计	1,749,077,038.62	82.94

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期末2018年09月30日	2018年09月30日
1.本期已实现收益	-36,806,170.16	-
2.本期利润	-66,301,824.13	-
3.加权平均基金份额本期收益	-0.0323	-
4.期末基金资产净值	1,676,682,439.17	-
5.期末基金份额净值	0.8161	-

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	87,269,138.30	3.06
C	制造业	697,433,766.41	27.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	107,816,081.73	4.14
F	批发和零售业	96,136,064.38	4.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,658,281.20	3.69
J	金融业	67,752,063.89	3.91
K	房地产业	397,433,766.41	27.96
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,619,164.00	1.29
N	卫生和社会工作	69,597,418.89	3.19
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	1,749,077,038.62	82.94

# 安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中信建投证券股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人中信建投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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中信建投证券股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人中信建投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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

**2.1 基金基本情况**

基金名称	安信平稳增长混合发起
基金代码	750006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月18日
报告期末基金份额总额	360,501,197.23份

**投资目标**

通过资产配置,精选个股,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金基于"价值投资"理念,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**4.5 报告期末基金资产组合情况**

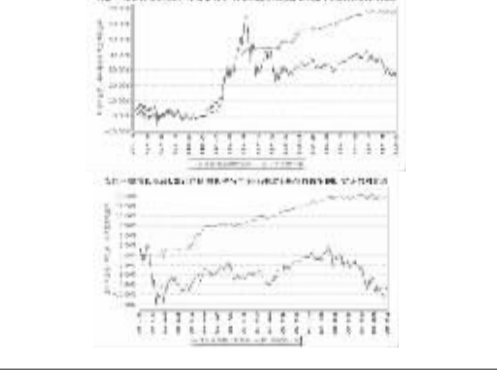
序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	64,156,274.15	15.52
2	基金投资	64,156,274.15	15.52
3	固定收益投资	301,759,600.00	72.99
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	34,000,000.00	8.22
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	未确认损益	-	-
9	合计	413,428,211.88	100.00

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期末2018年09月30日	2018年09月30日
1.本期已实现收益	813,364.57	-
2.本期利润	498,793.07	2,322,079.26
3.加权平均基金份额本期收益	0.0002	0.0009
4.期末基金资产净值	96,006,941.00	316,586,678.69
5.期末基金份额净值	1.1781	1.1783

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	7,026,300.00	1.70
C	制造业	38,053,486.00	9.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,323.00	0.02
E	建筑业	2,854,800.00	0.69
F	批发和零售业	1,463,200.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,146,700.00	2.29
J	金融业	3,651,000.00	0.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	1,956,536.46	0.47
Q	其他	-	-
R	合计	64,156,274.15	15.52



# 安信新回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:宁波银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人宁波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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:宁波银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**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。

基金托管人宁波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。

本报告所载数据截止日为2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

**2.1 基金基本情况**

基金名称	安信新回报混合
基金代码	002770
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月04日
报告期末基金份额总额	3,174,470.07份

**投资目标**

本基金通过资产配置,精选个股,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**投资策略**

本基金基于"价值投资"理念,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定增值,谋求基金资产的长期增值。

**4.4 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	153,450,000.00	3.26
2	基金投资	153,450,000.00	3.26
3	固定收益投资	603,000,000.00	14.76
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	1,100,000,000.00	23.38
7	其他负债	-	-
8	未确认损益	-	-
9	合计	4,704,500,000.00	100.00

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期末2018年09月30日	2018年09月30日
1.本期已实现收益	-18,140.11	-
2.本期利润	-11,218.88	-7,222.62
3.加权平均基金份额本期收益	-0.0061	-0.0066
4.期末基金资产净值	2,314,029.49	1,062,190.92
5.期末基金份额净值	1.0794	1.0603

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	101,060.00	2.19
C	制造业	51,360,000.00	11.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	153,450,000.00	3.26

基金管理人:安信基金管理有限责任公司  
基金托管人:宁波银行股份有限公司  
报告送出日期: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:宁波银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月25日

**8.1.1.1 其他资产构成**

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	969,261.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,417.17
5	应收申购款	433,906.38
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	1,421,174.14

**8.1.1.2 其他负债构成**

序号	名称	金额(人民币元)
1	应付保证金	-
2	应付证券清算款	-
3	应付股利	-
4	应付利息	-
5	应付申购款	-
6	其他应付款	-
7	预收款项	-
8	其他	-
9	合计	-

**8.1.1.3 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细**

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	160008B	3,270,279	11,191,430.53	5.98
2	000932	9,989,410	83,881,149.90	4.47
3	000069	13,042,474	82,167,586.20	4.38
4	000002	3,049,256	74,066,920.88	3.56
5	670752	2,328,417	72,770,990.33	3.88
6	600309	1,026,486	69,076,817.96	3.88
7	000498	6,682,064	68,078,889.88	3.67
8	022220	2,403,150	68,684,281.20	3.66
9	601608	12,077,746	66,300,620.16	3.54
10	000961	6,539,392	62,902,643.18	3.39

**8.1.1.4 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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	90,790,000.00	22.01
4	企业债	36,979,600.00	8.96
5	同业拆借	-	-
6	其他	-	-
7	合计	301,759,600.00	72.99

**8.1.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细**

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	IC1803	400,000	40,216,000.00	11.66
2	IF1803	200,000	20,000,000.00	5.84
3	IF1804	200,000	20,000,000.00	4.87
4	IF1805	200,000	20,000,000.00	4.87
5	IF1806	200,000	20,000,000.00	4.87
6	IF1807	200,000	20,000,000.00	4.87
7	IF1808	200,000	20,000,000.00	4.87
8	IF1809	200,000	20,000,000.00	4.87
9	IF1810	200,000	20,000,000.00	4.87
10	IF1811	200,000	20,000,000.00	4.87

**8.1.1.6 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国债期货投资明细**

序号	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	TS1809	500,000	48,226,000.00	11.89
2	TF1809	500,000	48,226,000.00	11.89
3	TF1810	400,000	41,838,000.00	10.14
4	TF1811	200,000	20,919,000.00	5.04
5	TF1812	200,000	20,919,000.00	4.87
6	TF1901	200,000	20,919,000.00	4.87
7	TF1902	200,000	20,919,000.00	4.87
8	TF1903	200,000	20,919,000.00	4.87
9	TF1904	200,000	20,919,000.00	4.87
10	TF1905	200,000	20,919,000.00	4.87

**8.1.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细**

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	161103W09	500,000	48,226,000.00	11.89
2	161111W09	500,000	48,226,000.00	11.89
3	180205	400,000	41,838,000.00	10.14
4	180310	200,000	20,919,000.00	5.04
5	180404	200,000	20,919,000.00	4.87
6	180504	200,000	20,919,000.00	4.87
7	180604	200,000	20,919,000.00	4.87
8	180704	200,000	20,919,000.00	4.87
9	180804	200,000	20,919,000.00	4.87
10	180904	200,000	20,919,000.00	4.87

**8.1.1.8 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**

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	161103W09	500,000	48,226,000.00	11.89
2	161111W09	500,000	48,226,000.00	11.89
3	180205	400,000	41,838,000.00	10.14
4	180310	200,000	20,919,000.00	5.04
5	180404	200,000	20,919,000.00	4.87
6	180504	200,000	20,919,000.00	4.87
7	180604	200,000	20,919,000.00	4.87
8	180704	200,000	20,919,000.00	4.87
9	180804	200,000	20,919,000.00	4.87
10	180904	200,000	20,919,000.00	4.87

**8.1.1.9 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贵金属投资明细**

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	161103W09	500,000	48,226,000.00	11.89
2	161111W09	500,000	48,226,000.00	11.89
3	180205	400,000	41,838,000.00	10.14
4	180310	200,000	20,919,000.00	5.04
5	180404	200,000	20,919,000.00	4.87
6	180504	200,000	20,919,000.00	4.87
7	180604	200,000	20,919,000.00	4.87
8	180704	200,000	20,919,000.00	4.87
9	180804	200,000	20,919,000.00	4.87