安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

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
本招募说明书(更新)摘要内容截止日:2018年10月15日

重要提示

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的募集申请于2015年3月25日经中国证监会证监许可[2015]442号文注册。本基金基金合同于2015年4月15日正式生效。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年10月15日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:刘入领
成立时间:2011年12月6日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可〔2011〕1895号
组织形式:有限责任公司
注册资本:50,625万元人民币
存续期间:永续经营
联系人:陈静满
联系电话:0755-82509999
公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
五矿资本控股有限公司	39.84%
安信证券股份有限公司	33.95%
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	20.28%
中广核财务有限责任公司	5.93%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

王连志先生,董事长,经济学硕士。历任长城证券有限公司投行部经理、中信证券股份公司投行部经理,第一证券有限责任公司副总经理、安信证券股份有限公司副总经理、安信基金管理有限责任公司总经理。现任安信证券股份有限公司董事、总经理、党委副书记。

刘入领先生,董事,经济学博士。历任国通证券股份有限公司(现招商证券股份有限公司)研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理;招商证券股份有限公司战略部副总经理(主持工作)、总裁办公室主任、理财客户部总经理;安信证券股份有限公司人力资源部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事长。

任珠峰先生,董事,经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理,英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理,五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理、总经理等职务。现任中国五矿集团有限公司总经理助理兼五矿资本股份有限公司董事长、总经理、党委书记,五矿资本控股有限公司董事长、总经理,五矿国际信托有限公司董事长,中国外贸金融租赁有限公司董事长,工银安盛人寿保险有限公司副董事长,五矿证券有限公司董事,绵阳市商业银行股份有限公司董事、党委书记。

王晓东先生,董事,经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员,日本五金矿产株式会社财务部科员,中国外贸金融租赁有限公司副总经理,中国五矿集团公司财务总部副总经理,五矿投资发展有限责任公司副总经理等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员,五矿资本控股有限公司副总经理兼资本运营部总经理,五矿经易期货有限公司董事长,五矿证券有限公司董事,五矿国际信托有限公司董事,绵阳市商业银行股份有限公司董事。

代永波先生,董事,管理学硕士。历任深圳市深国投房地产开发有限公司财务部会计、第一创业证券有限责任公司投资银行部业务经理、中信建投证券股份有限公司投资银行部副总裁、申银万国证券股份有限公司投资银行部执行总经理、广州市顺路工程顾问股份有限公司董事、总经理。现任深圳市帕拉丁股权投资有限公司总经理。

郭伟喜先生,董事,经济学学士。历任福云会计师事务所项目经理,上海中科合臣股份有限公司财务部经理,厦门天地安保险代理有限公司财务总监,高能资本有限公司投资银行业务董事等职。现任中广核财务有限责任公司投资银行部副总经理(主持工作)。

庞继英先生,独立董事,金融学博士,高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部,国家外汇管理局副处长、处长、副司长,中国外汇交易中心副总裁、总裁,中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员,中国再保险(集团)股份有限公司党委副书记、副董事长、国家开发银行股份有限公司董事。

魏华林先生,独立董事,1977年毕业于武汉大学政治经济学专业、1979年毕业于厦门大学政治经济学研究班。历任武汉大学经济系讲师,保险系副教授、副系主任、主任,保险经济研究所所长,兼任中国保监会咨询委员会委员、中国金融学会常务理事暨学术委员会委员、中国保险学会副会长、湖北省政府文史研究馆馆员等职。现任武汉大学风险研究中心主任、教授、博士生导师。

尹公辉先生,独立董事,法学硕士。历任四川建材工业学院辅导员、学办主任,中农信(香港)集团有限公司法务主管,广东信达律师事务所专职律师,广东华商律师事务所专职律师,广东行孚律师事务所合伙人。现任广东信达律师事务所合伙人。

2、基金管理人监事会成员

刘国威先生,监事会主席,工商管理硕士。历任五矿集团财务公司资金部科长、香港企荣财务有限公司资金部高级经理、五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、五矿投资发展有限责任公司规划发展部总经理、五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员、纪委委员,五矿资本控股有限公司副总经理,工银安盛人寿保险有限公司监事会主席,中国外贸金融租赁有限公司董事,五矿证券有限公司董事,五矿国际信托有限公司董事,五矿经易期货有限公司董事。

余斌先生,监事,经济学学士。历任深圳鸿华实业股份有限公司财务审计经理、南方证券股份有限公司稽核部副总经理、中科证券托管组副组长。现任安信证券股份有限公司计划财务部总经理。

蒋牧人先生,监事,法律硕士。历任北京金杜律师事务所实习律师、中信建投证券有限公司投资银行部高级经理、华林证券投资银行部高级业务总监。现任深圳市帕拉丁股权投资有限公司投资总监。

廖维坤先生,职工监事,理学学士。历任轻工业部南宁设计院电算站软件工程师,申银万国证券股份有限公司深圳营业部电脑主管,南方证券股份有限公司深圳管理总部电脑工程师、布吉营业部营业部副总经理、稽核总部高级经理、经纪业务总部高级经理,安信证券股份有限公司信息技术部经理。现任安信基金管理有限责任公司首席信息官,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司监事。

王卫峰先生,职工监事,工商管理硕士,注册会计师。历任吉林省国际信托公司财务人员,汉唐证券有限责任公司营业部财务经理,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管,浦银安盛基金管理有限公司监察部负责人。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼监察稽核部总经理兼风险管理部总经理。

张再新先生,职工监事,经济学硕士。历任安信证券股份有限公司计划财务部会计,安信基金管理有限责任公司财务部会计、工会财务委员。现任安信基金管理有限责任公司运营部总经理助理、交易主管。

3、基金管理人高级管理人员

王连志先生,董事长,经济学硕士。简历同上。

刘入领先生,董事,总经理,经济学博士。简历同上。

陈振宇先生,副总经理,经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理,招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理,安信证券股份有限公司资产管理部副总经理、证券投资部副总经理,安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理、东方基金管理有限责任公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

孙晓奇先生,副总经理,经济学硕士。历任上海石化股份有限公司董事会秘书室高级经理,上海证券交易所交易运行部襄理、市场发展部高级经理、债券基金部执行经理,南方证券行政接管组成员,安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长,安信基金管理有限责任公司督察长、副总经理兼安信乾盛财富管理(深圳)有限公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

李学明先生,副总经理,哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理,理财发展部高级经理;安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理,安信基金筹备组成员;安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。

乔江晖女士,督察长,文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、副处长,安信证券股份有限公司安信基金筹备组成员,安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

4、本基金基金经理

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,安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。2013年12月31日至今,任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年4月15日至今,任安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月20日至2016年7月12日,任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年11月2日至今,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;2017年7月20日至2018年8月9日,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;2018年3月22日至今,任安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

主任委员:

陈振宇先生,副总经理,经济学硕士。简历同上。

委员:

刘入领先生,董事,总经理,经济学博士。简历同上。

孙晓奇先生,副总经理,经济学硕士。简历同上。

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。

陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员,安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员,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。

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,安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司FOF投资部总经理。

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。

张竞先生,金融学硕士。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理、安信基金筹备组研究部研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。

陈鹏先生,工商管理硕士。历任联合证券有限责任公司行业研究员,鹏华基金管理有限公司基金经理,安信基金管理有限责任公司综合管理部首席招聘官。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:

名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
成立时间: 1992年10月19日
经营范围:经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准,公司主营业务主要包括:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务;离岸银行业务;证券投资基金托管业务;全国社会保障基金托管业务;经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。
组织形式:股份有限公司
注册资本: 293.52亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:胡波
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年更名为资产托管与养老金业务部,2016年进行组织架构优化调整,并更名为资产托管部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心(含合肥分中心)五个职能处室。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

2、主要人员情况

高国富,男,1956年出生,研究生学历,博士学位,高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发(控股)公司总经理;上海外高桥保税区管委会副主任;上海万国证券公司代总裁;上海久事公司总经理;上海市城市建设投资开发总公司总经理;中国太平洋保险(集团)股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员,中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员,上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义,男,1965年出生,硕士研究生,高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总裁,上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理,上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监,上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建,男,1968年出生,博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员,国际业务部、工商信贷处科长,资金营运处副处长,上海浦东发展银行济南分行信管处总经理,上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2018年9月30日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为3319.68亿元,比去年末增加17.82%。托管证券投资基金共一百三十四只,分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金(LOF)、华富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、博时安丰18个月基金(LOF)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰景益灵活配置混合基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫垚主题轮动混合基金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、中金价值轮动灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金基金、中银中债3-5年期农发行债券指数证券投资基金等。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:刘入领
电话:0755－82509820
传真:0755－82509920
联系人:陈思伶
客户服务电话:4008-088-088
公司网站:www.essencefund.com

2、其他销售机构

(1)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
客户服务电话:95528
网站:www.spdb.com.cn

(2)江苏张家港农村商业银行股份有限公司
住所:张家港市人民中路66号
法定代表人:季颖
客户服务电话:0512-96065
网站:www.zrcbank.com

(3)平安银行股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:谢永林
客户服务电话:95511-3
网站:www.bank.pingan.com

(4)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:王连志
客户服务电话:400-800-1001
网站:www.essence.com.cn

(5)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
客户服务电话:400-8888-666 / 95521
网站:www.gtja.com

(6)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:霍达
客户服务电话:95565
网站:www.newone.com.cn

(7)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:周杰
客户服务电话:95553
网站:www.htsec.com

(8)中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:张佑君
客户服务电话:95558
网站:www. citics.com

(9)中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:姜晓林
客户服务电话:96577
网站:www.zxwt.com.cn

(10)东海证券股份有限公司
住所:上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦5楼
法定代表人:赵俊
客户服务电话:4008-888-588
网站:www.longone.com.cn

(11)申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客户服务电话:95523或4008895523
网站:www.swhysc.com

(12)中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7、8层
法定代表人:黄扬录
客户服务电话:95329
网站:www.zszq.com.cn

(13)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门内大街188号鸿安国际大厦
法定代表人:王常青
客户服务电话:95587/4008-888-108
网站:www.csc108.com

(14)中信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
客户服务电话:400-9908-826
网站: www.citicsf.com

(15)中国国际金融股份有限公司
住所:中国北京建国门外大街1号国贸写字楼2座28层
法定代表人:丁学东
客户服务电话:400-910-1166
网站:www.cicc.com

(16)东海期货有限责任公司
住所:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
法定代表人:陈太康
客户服务电话:95531/400-8888588
网站:www.qh168.com.cn

(17)东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人:魏庆华
客户服务电话:4008888993
网站:www.dxzq.net

(18)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人:杨炯洋
客户服务电话:95584/4008-888-818
网站:www.hx168.com.cn

(19)东北证券股份有限公司
住所:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
客户服务电话:95360
网站:www.nesc.cn

(20)第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
客户服务电话:95358
网站:www.firstcapital.com.cn

(21)国金证券股份有限公司
住所:成都市青羊区东城根上街 95 号
法定代表人:冉云
客户服务电话:95310
网站:www.gjzq.com.cn

(22)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:陈共炎
客户服务电话:4008-888-8888
网站:www.chinastock.com.cn

(23)上海华信证券有限责任公司
住所:上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人:陈灿辉
客户服务电话:400-820-5999
网站:www.shhxzq.com

(24)中大期货有限公司
住所:浙江省杭州市中山北路310号3层、11层西、12层东,18层
法定代表人:周学韬
客户服务电话:400-8810-999 或者 0571-85801071
网站:www.zdqh.com

(25)宏信证券有限责任公司
住所:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
客户服务电话:4008-366-366
网站:www.hx818.com

(26)平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
法定代表人:何之江
客户服务电话:95511-8
网站:stock.pingan.com

(27)申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358 号大成国际大厦20 楼2005 室
法定代表人:李琦
客户服务电话:400-800-0562
网站: www.hysec.com

(28)世纪证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42 层
法定代表人:姜昧军
客户服务电话:4008323000
网站:http://www.csco.com.cn

(29)天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
客户服务电话: 95391/4008005000
网站: http://www.tfzq.com

(30)广州证券股份有限公司
住所:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:胡伏云
客户服务电话: 95396
网站:www.gzs.com.cn

(31)长城证券股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
法定代表人:丁益
客户服务电话:4006666888
网站:www.cgws.com/cczq

(32)开源证券股份有限公司
住所:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
客户服务电话:95325
网站:http://www.kysec.cn/

(33)西藏东方财富证券股份有限公司
住所:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
客户服务电话:95357
网站:http://www.xzsec.com

(34)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:祖国明
客户服务电话:4000-766-123
网站:www.fund123.cn

(35)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
客户服务电话:400-181-8188
网站:www.1234567.com.cn

(36)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢
法定代表人:张跃伟
客户服务电话:400-820-2899
网站:www.erichfund.com

(37)和讯信息科技有限公司
住所:上海市浦东新区东方路18号保利大厦E座18层
法定代表人:王莉
客户服务电话:400-920-0022
网站:licaike.hexun.com

(38)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
客户服务电话:400-001-8811
网站:www.zcvc.com.cn

(39)泰信财富基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国路甲92号世茂大厦C座12层
法定代表人:张虎
客户服务电话:400-004-8821
网站:http://www.hxlc.com

(40)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
客户服务电话:4008-773-772
网站:www.5ifund.com

(41)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
网站:www.ehowbuy.com

(42)北京加和基金销售有限公司
住所:北京市西城区金融大街11号703室
法定代表人:曲阳
客户服务电话:400-600-0030
网站: www.bzfunds.com

(43)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京海淀区丹棱街6号1幢9层1008室
法定代表人:赵荣春
客户服务电话:400-893-6885
网站:www.qianjing.com

(44)上海陆金所基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼
法定代表人:王之光
客户服务电话:4008219031
网站:www.lufunds.com

(45)深圳市金斧子基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层
法定代表人:赖任军
客户服务电话:400-930-0660
网站:www.jfzinv.com

(46)珠海盈米财富管理有限公司
住所:广州市珠海市琶洲大道东1号宝利国际广场南塔12楼B
法定代表人:肖雯
客户服务电话:020-89629066
网站:www.yingmi.cn

(47)北京晟视天下投资管理有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:400-818-8866
网站:www.shengshiview.com

(48)北京中天嘉华基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区京顺路5号曙光大厦C座一层
法定代表人:洪少猛
客户服务电话:4006509972
网站:www.5ilicai.cn

(49)浙江金观诚基金销售有限公司
住所:杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人:蒋雪琦
客户服务电话:400-068-0058
网站:www.jincheng-fund.com

(50)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人:王伟刚
客户服务电话:400-619-9059
网站:www.hcjijin.com

(51)大泰金石基金销售有限公司
住所:江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室
法定代表人:姚杨
客户服务电话:400-928-2266
网站:www.dtfunds.com

(52)乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
住所:北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人:董云巍
客户服务电话:400-088-8080
网站:www.qiandaojr.com

(53)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层
法定代表人:江卉
客户服务电话:400 098 8511
网站:fund.jd.com

(54)北京新浪仓石基金销售有限公司
住所:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
法定代表人:李昭琛
客户服务电话:010-62675369
网站:www.xincai.com

(55)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
客户服务电话:400-820-5369
网站:www.jiyufund.com.cn

(56)上海万得基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
客户服务电话:400-821-0203
网站:www.520fund.com.cn

(57)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人:汪静波
客户服务电话:400-821-5399
网站:www.noah-fund.com

(58)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
法定代表人:陶捷
客户服务电话:400-027-9899
网站: www.buyfunds.cn

(59)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
客户服务电话:400-116-1188
网站:8.jrj.com.cn

(60)南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客户服务电话:95177
网站:www.snjijin.com

(61)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区梨园路6号物资控股大厦8楼
法定代表人:薛峰
客户服务电话:400-678-8887
网站:www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

(62)北京格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
客户服务电话:400-066-8586
网站:www.igesafe.com

(63)一路财富(北京)基金销售股份有限公司
住所:北京市海淀区宝盛里宝盛南路1号院奥北科技园国泰大厦9层
法定代表人:吴雪秀
客户服务电话:400-001-1566
网站:http://www.yilucaifu.com

(64)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京阜通东大街望京SOHO T3 A座19层
法定代表人:钟斐斐
客户服务电话:400-061-8518
网站: https://danjuanapp.com/

(65)中民财富基金销售(上海)有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路100号17层
法定代表人:弭洪军
客户服务电话:400-876-5716
网站:https://www.cmiwm.com/

(66)天津万家财富资产管理有限公司
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
客户服务电话:010-59013895
网站:www.wanjiawealth.com

(67)通华财富(上海)基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼
法定代表人:马刚
客户服务电话:95156
网站:https://www.tonghuafund.com

(68)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区紫月路18 号院朝来高科技产业园18 号楼
法定代表人:张旭
客户服务电话: 400-810-5919
网站: www.fengfd.com

(69)上海华夏财富投资管理有限公司
住所:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层
法定代表人:毛淮平
客户服务电话: 400-817-5666
网站:www.amcfortune.com

(70)深圳市前海排排网基金销售有限责任公司
住所:深圳市福田区福强路4001 号深圳市世纪工艺品文化市场313 栋E-403
法定代表人:李春瑜
客户服务电话: 400-680-3928
网站: www.simuwang.com

(71)嘉实财富管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国路 91 号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
客户服务电话: 4400-021-8850
网站:www.harvestwm.cn

(72)北京创金启富基金销售有限公司
住所:北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室
法定代表人:梁蓉
客户服务电话:400-6262-1818 /010-66154828
网站:www.5irich.com

(73)上海挖财基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
客户服务电话: 021-50810673
网站: www.wacaijijin.com

(74)天津市凤凰财富基金销售有限公司
住所:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
法定代表人:王正宇
客户服务电话:4007-066-880
网站:http://www.phoenix-capital.com.cn

(75)奕丰基金销售有限公司
住所:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
客户服务电话: 400-684-0500
网站:www.ifastps.com.cn

(76)北京植信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
客户服务电话:4006-802-123
网站: www.zhixin-inv.com

(77)北京唐鼎耀华基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人:张冠宇
客户服务电话:400-819-9868
网站:http://www.tdyhfund.com/

(78)民商基金销售(上海)有限公司
住所:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贲惠琴
客户服务电话:021-50206003
网站:http://www.msftec.com/

(二)基金份额登记机构

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:刘入领
联系人:宋发根
电话:0755－82509865
传真:0755－82560289

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
法定代表人:毛鞍宁
电话:(010)58153000、(0755)25028288
传真:(010)85188298、(0755)25026188
签章注册会计师:昌华、高鹤
联系人:李妍明

四、基金名称

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

五、基金运作方式

契约型开放式

六、基金类型

混合型

七、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。

八、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 95%,持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

九、投资策略

本基金强调风险控制,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,审时度势动态运用多元化投资策略,力争实现基金资产的稳健增长。

1、资产配置策略

结合转型期中国经济增长趋势及特征,密切跟踪宏观、中观与微观各层面重要因素的变化,结合监管政策和市场行为分析,对各大类资产的风险收益特征做出系统性、前瞻性的评估,动态分配各大类资产配置比例,力争实现基金资产的稳健增长。

(1) 宏观因素

我们将密切跟踪诸如GDP、工业增加值、用电量、信贷额、社会融资总额等数量型指标,以及诸如CPI、PPI、利率、不动产价格等价格型指标,强调宏观数据之间的系统分析和逻辑关系梳理,检验我们过去对宏观经济运行特征的判断,并启发我们作出及时的观点调整与更新。

(2)中观、微观因素

结合中国经济转型期特征,重点关注有巨大改善或强劲增长潜力的行业,对行业格局的演变路径作出合理展望,对具备长期竞争优势的企业保持密切跟踪。

(3)自由市场与政策监管

关注市场预期以及政策监管导向之间的差异,着重分析商业周期与政策监管周期之间的互动过程,权衡市场风险与政策支撑以及市场机会与政策调控之间的矛盾,力争在大类资产的配置中能够抢得先机、回避风险。

2、股票投资策略

本基金将依据风险管控以及收益目标的要求,结合当时的市场背景,动态选择股票投资策略。

(1)价值型投资策略

未来随着A股注册制的推出,我国资本市场的直接融资比例将大幅提升,市场整体估值水平将逐步向欧美成熟资本市场看齐,企业自由现金流的贴现值将成为股票定价的核心依据,价值投资策略有望获得广泛认可。

坚持深入的基本面分析和坚守安全边际是该策略的两条基本原则。本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方法,综合公开信息(包括财务数据)、第三方研究报告和研究员实地调研的结果,对目标上市公司的经营管理与投资价值进行深入研究。定量分析公司的主营业务收入增速、毛利率、营业利润增速、资产周转率以及经营性现金流量等指标,使用DDM模型和DCF模型等绝对估值法估算上市公司股票的内在价值,挖掘出价值被严重低估的上市公司作为重点投资对象。

(2)周期型投资策略

该投资策略主要依据宏观经济周期的运行特点动态调整股票头寸。我们将密切跟踪政策周期、信贷周期、房地产周期、产能周期以及库存周期的运行状况,在周期景气度向上、运行状况良好、运行空间宽阔的行业或者领域中,适时参与周期性较强的个股投资。

(3)成长型投资策略

在宏观经济前景平稳、货币财政政策中性偏守的时期,那些依托于自身创新能力以及强大竞争优势依然能够实现快速成长的企业,将是我们重点关注的对象。在这一策略中,我们将重点考察三个方面的问题:1)行业总体是否存在较大的增长空间;2)行业格局是否会逐渐趋于稳定和集中;3)随着商业模式的不断演进,公司在行业中的地位是否能够不断增强。最终我们的目标是挖掘出成长空间大、成长逻辑严密、成长确定性高的个股进行长期投资。

(4)主题型投资策略

基于目前A股市场主题轮动明显的现状,通过对各个行业政策以及行业运行规律的把握,前瞻性地扑捉行业基本面中可能出现重大改善的主题性机会,进行阶段性的布局。

(5)低风险套利型投资策略

该投资策略主要是利用市场的短期非理性交易环境,以较低的风险把握市场定价偏差带来的短期机会,主要包括:新股/新可转换债券投资、增发套利、转债转股价套利、转债转股套利、股权激励套利、衍生品套利等。

(6)事件驱动型投资策略

本基金还将运用事件驱动策略进行投资。通过对影响上市公司当前或未来价值的重大事件性因素进行全面的数据统计分析,寻找那些价值未被市场充分认识的股票作为备选投资对象,结合市场热点和指数运行趋势,在事件被市场充分消化之前布局。这些事件主要包括:个股或股指非理性大幅下跌、潜在年报高送转、高管增持、指数成分股调整等。

3、固定收益类投资策略

本基金将根据宏观经济分析、政策分析、资金面动向分析和市场行为分析,判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,结合组合流动性管理的实际情况,从流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税率、含权等因素分析个券,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资,实现组合增值。

4、衍生品投资策略

(1)股指期货投资策略

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。

(2)权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,采用权证估值量化模型评估权证/期权的内在合理价值,谨慎参与权证投资。另外,本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在的风险对冲机会,获取相对稳定的投资收益。

5、风险管理策略

本基金的目标是追求相对稳定的绝对回报,科学的风险管理是实现本基金目标的重要保障。本基金将参照多因素风险预算模型技术,根据市场环境的变化,动态调整仓位和投资品种,锁定收益、减少损失,并在实际投资操作中严格执行有关投资流程和操作权限,在投资的各个环节持续监测、控制和管理风险。

6、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

十、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%

本基金的投资目标旨在为持有人提供高于定期存款的稳定增值回报,在未来利率市场化带来的资金成本上升中具有优势,而从过往历史数据看,"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%"绝大部分时间都能战胜通货膨胀,市场上同类基金也多采用类似的业绩比较基准。综合本基金的投资目标和市场情况,本基金的业绩比较基准定为"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%"。

如果未来利率市场化推进导致资金成本大幅超过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,或通货膨胀明显上行,或者相关数据编制单位停止编制、公布该基准利率,或有更具权威、更科学的适合用于本基金的业绩比较基准时,基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以变更本基金业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、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。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。

十二、基金投资组合报告

本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。

本基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日,来源于《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第3季度报告》。本报告中所列财务数据未经审计。

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	14,972,909.56	22.29
	其中:股票	14,972,909.56	22.29
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	20,048,000.00	29.85
	其中:债券	20,048,000.00	29.85
	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	22,000,000.00	32.76
	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	9,724,537.37	14.48
8	其他资产	416,403.60	0.62
9	合计	67,161,850.53	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	–	–
C	制造业	6,878,828.82	10.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,986,461.00	7.47
E	建筑业	2,445,144.15	3.66
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	662,355.00	0.99
J	金融业	120.59	0.00
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	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	14,972,909.56	22.43

(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。

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	153,621	3,456,472.50	5.18
2	601985	中国核电	574,100	3,450,341.00	5.17
3	600795	国电电力	602,400	1,536,120.00	2.30
4	601186	中国铁建	136,500	1,521,975.00	2.28
5	603156	养元饮品	26,401	1,322,426.09	1.98
6	000333	美的集团	24,300	979,290.00	1.47
7	600271	航天信息	34,400	957,352.00	1.43
8	600068	葛洲坝	126,635	923,169.15	1.38
9	002555	三七互娱	61,500	662,355.00	0.99
10	300713	英可瑞	6,307	163,288.23	0.24

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	20,048,000.00	30.04
	其中:政策性金融债	20,048,000.00	30.04
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	其他	–	–
10	合计	20,048,000.00	30.04

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	180207	18国开07	200,000	20,048,000.00	30.04

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体除葛洲坝(股票代码:600068),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。

中国葛洲坝集团股份有限公司于2018年1月22日收到深圳市水务局行政处罚决定书(深水政(支)罚字[2017]第11号),因在施工运营中未根据设计要求及水土保持相关规范规程采取有效水土保持措施,造成水土流失,违反了《深圳经济特区水土保持条例》第十九条第二款的规定,被处以35万元罚款。

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。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	72,132.79
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	342,300.95
5	应收申购款	1,969.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	416,403.60

(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)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	603156	养元饮品	1,322,426.09	1.98	新股锁定
2	000333	美的集团	979,290.00	1.47	重大事项
3	300713	英可瑞	163,288.23	0.24	新股锁定

(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。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金合同生效日为2015年4月15日,基金合同生效以来(截至2018年9月30日)的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

1、安信动态策略A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2015.4.15-2015.12.31	4.20%	0.10%	3.51%	0.01%	0.69%	0.09%
2016.1.1-2016.12.31	3.65%	0.08%	4.51%	0.01%	-0.86%	0.07%
2017.1.1-2017.12.31	16.86%	0.25%	4.50%	0.01%	12.36%	0.24%
2018.1.1-2018.9.30	-2.92%	0.46%	3.37%	0.01%	-6.29%	0.45%

2、安信动态策略C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2015.11.17-2015.12.31	0.39%	0.05%	0.53%	0.01%	-0.14%	0.04%
2016.1.1-2016.12.31	3.46%	0.08%	4.51%	0.01%	-1.05%	0.07
2017.1.1-2017.12.31	16.57%	0.25%	4.50%	0.01%	12.07%	0.24%
2018.1.1-2018.9.30	-3.00%	0.46%	3.37%	0.01%	-6.37%	0.45%

十四、基金的费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的账户开户费用、账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 1.00\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.20\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.20\% \div$ 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起3个工作日内向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金相关销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述"一、基金费用的种类中第4－10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率或C类基金份额销售服务费等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率或C类基金份额销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、对"重要提示"部分进行了更新。
2、"第三部分基金管理人"部分,更新基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、高级管理人员、本基金基金经理以及投资决策委员会成员信息,本基金基金经理未发生变更。
3、更新"第四部分基金托管人"部分的内容。
4、"第五部分相关服务机构"部分,更新其他销售机构的信息。
5、"第九部分基金的投资"部分,更新基金投资组合报告的内容。
6、更新"第十部分基金的业绩"部分的内容。
7、更新"第二十二部分其他应披露事项"部分的内容。

安信基金管理有限责任公司
2018年11月29日