安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月19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2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信比较优势混合
基金主代码	006587
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	1,960,314,782.36份
投资目标	本基金通过科学、灵活的行业(板块)配置,在严格控制风险并保证充足流动性的前提下,充分挖掘和利用在中国经济转型调整过程中具有明显比较优势的权益类投资标的,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金基于前瞻性的宏观经济研究,遵循国家政策的阶段性思路,根据利率水平、通胀水平、风险偏好等市场敏感因素的变化趋势,利用主动式、科学的资产配置模型进行大类资产配置,在基金合同约定的范围内适时动态调整股票、债券和现金的投资比例。同时,本基金采用股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略以及资产支持证券投资策略进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中债总指数(全价)收益率*30%
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10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-126,839,960.85
2.本期利润	-207,140,051.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1036
4.期末基金资产净值	1,595,283,128.22
5.期末基金份额净值	0.8138

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	-11.17%	1.73%	-7.93%	1.14%	-3.24%	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2018年3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。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		
陈振宇	本基金的基金经理,副总经理	2018年3月21日	-	24年	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。现任安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理	2018年3月21日	-	8年	袁玮先生,理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾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,安信新起点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的基金经理助理。安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信比较优势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

2018年四季度A股市场集体大跌,前期表现相对强势的大盘股、周期股也出现了集体补跌,尤其是钢铁、化工、医药、食品饮料等行业跌幅巨大,仅有农林牧渔、通信、电力设备、建筑、房地产等经济下行周期中的逆周期防御性板块表现相对抗跌。

本基金的管理思路依然是以自下而上地选择风险报酬率最优的股票为根本。期间由于钢铁行业四季度环保限产严重低于预期,导致我们重仓的钢铁股出现了巨大的下跌,并对基金净值造成了较大的负面影响。另一方面,在经济数据快速走低的背景下,国家出台了一系列提振基建的举措以及在不同地区适度放松了对房地产行业的限制,因此我们重仓的房地产、基建行业股票表现相对抗跌。另外,正如上一季度季报中我们披露的情况,对于医药股的估值泡沫我们是有充分准备,因此当季我们几乎没有受到医药股大跌的影响。

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0.8138元,本报告期基金份额净值增长率为-11.17%,同期业绩比较基准收益率为-7.93%。

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	1,489,180,071.76	91.49
	其中:股票	1,489,180,071.76	91.49
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	137,833,840.27	8.47
8	其他资产	711,456.03	0.04
9	合计	1,627,725,368.06	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	35,443,587.12	2.22
C	制造业	795,063,804.80	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	168,903,186.94	10.59
F	批发和零售业	57,427,014.96	3.60
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	80,156,802.88	5.02
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	317,362,200.99	19.89
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	34,773,328.27	2.18
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,489,180,071.76	93.35

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	600383	金地集团	10,372,303	99,781,554.86	6.25
2	000932	华菱钢铁	15,506,443	93,969,044.58	5.89
3	600782	新钢股份	18,384,916	93,579,222.44	5.87
4	000069	华侨城A	14,246,243	90,463,643.05	5.67
5	002230	科大讯飞	3,253,117	80,156,802.88	5.02
6	002051	中工国际	5,852,206	64,842,442.48	4.06
7	000002	万科A	2,688,536	64,040,927.52	4.01
8	600048	保利地产	5,349,964	63,076,075.56	3.95
9	000501	鄂武商A	6,057,702	57,427,014.96	3.60
10	002078	太阳纸业	9,682,288	55,189,041.60	3.46

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

本基金投资股指期货将以对冲投资组合的系统性风险为目的,优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置,在系统性风险积累较大时,通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险,力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

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	610,818.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,353.65
5	应收申购款	72,284.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	711,456.03

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	2,047,356,836.05
报告期期间基金总申购份额	18,676,812.43
减:报告期期间基金总赎回份额	105,718,866.13
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	1,960,314,782.36

§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比较优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信比较优势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
2019年01月19日

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

2018年第四季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月19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2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信工业4.0混合
基金主代码	004621
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月20日
报告期末基金份额总额	38,163,196.12份
投资目标	本基金主要通过聚焦与工业4.0高度相关的优质标的,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金净资产的长期稳健增长。
投资策略	本基金所称的工业4.0主题投资涉及的企业类型包括但不限于以下四类:人工智能算法与数据供应商、硬件设备供应商、系统集成商和智慧工厂运营商等。 本基金通过综合考虑国内宏观经济趋势、利率变化趋势、国内股票市场估值水平、海外主要经济体经济和资本市场运行状况等因素,合理比较各大类资产风险收益比,确定或调整股票投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他投资品种的投资比例。本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,结合收益率曲线变化、合理配置长、中、短期债券比例。本基金衍生品投资策略以风险控制为主。在资产支持证券投资策略上,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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*40%+恒生AH股H指数收益率*20%+中债全价指数收益率*40%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股通标的股票,从而面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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	安信工业4.0混合A	安信工业4.0混合C
下属分级基金的交易代码	004521	004522
报告期末下属分级基金的份额总额	24,546,172.89份	13,617,022.23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10月01日 - 2018年12月31日)	
	安信工业4.0混合A	安信工业4.0混合C
1.本期已实现收益	-2,835,196.92	-1,548,315.15
2.本期利润	-2,471,457.20	-1,335,674.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0991	-0.0981
4.期末基金资产净值	18,014,586.25	9,974,833.43
5.期末基金份额净值	0.7339	0.7325

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

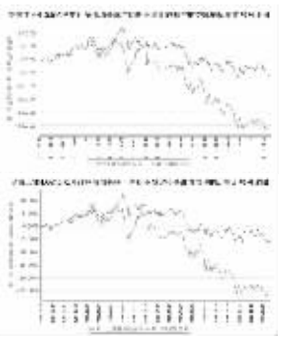
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信工业4.0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	-11.79%	1.20%	-5.50%	0.95%	-6.29%	0.25%

安信工业4.0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	-11.81%	1.20%	-5.50%	0.95%	-6.31%	0.25%

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7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		
谭珏娜	本基金的基金经理	2018年8月8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控风险控制员、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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张竞	本基金的基金经理,权益投资部总经理	2018年8月8日	-	11年	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。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任安信新常态沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券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

四季度A股市场各指数均出现显著下跌,我们对未来的市场的看法仍然维持三季度对于市场谨慎的观点,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是个长期的过程,过去数十年的全球化过程也有逆转的趋势。

其次是国内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解决过程缓慢。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。

具体操作上,行业配置方面,本基金相对重配了猪养殖、电力设备、电子、黄金等行业。未来一段时间本基金坚持在控制波动率的基础上努力获取绝对收益。

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0.7339元,本报告期基金份额净值增长率为-11.79%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为0.7325元,本报告期基金份额净值增长率为-11.81%;同期业绩比较基准收益率为-5.50%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,时间范围为2018年10月8日至2018年12月31日。

自上季度2018年7月2日至本季度2018年12月31日,本基金基金资产净值出现了连续60个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§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	11,927,830.65	42.35
	其中:股票	11,927,830.65	42.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	57,501.20	0.20
	其中:债券	57,501.20	0.20
	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	15,668,285.22	55.63
8	其他资产	509,324.79	1.81
9	合计	28,162,941.86	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	535,325.00	1.91
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,094,395.00	25.35
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	2,670,736.20	9.54
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	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	10,300,456.20	36.80

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(人民币)	占基金资产净值比例(%)
保健	266,644.80	0.95
材料	597,664.93	2.14
工业	215,545.00	0.77
金融	-	-
能源	-	-
必需消费品	-	-
非必需消费品	-	-
科技	547,519.72	1.96
通讯	-	-
公用事业	-	-
合计	1,627,374.45	5.81

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

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	34,800	1,242,012.00	4.44
2	002415	海康威视	36,300	935,088.00	3.34
3	600406	国电南瑞	46,600	863,498.00	3.09
4	600761	安徽合力	96,300	842,625.00	3.01
5	300349	金卡智能	51,300	825,930.00	2.95
6	002384	东山精密	69,100	780,139.00	2.79
7	300604	长川科技	25,090	767,754.00	2.74
8	600745	闻泰科技	29,500	623,335.00	2.23
9	01787	山东黄金	35,750	597,664.93	2.14
10	300470	日机密封	28,640	592,740.00	2.12

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)	57,501.20	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,501.20	0.21

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	128046	利尔转债	580	57,501.20	0.21

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

本基金投资股指期货将以对冲投资组合的系统性风险为目的,优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置,在系统性风险积累较大时,通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险,力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

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东山精密(股票代码:002384),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。

苏州东山精密制造股份有限公司高新区分公司于2018年6月28日因部分建设项目未完成环保验收等问题,受到虎丘区环保局行政处罚:(1)将案件移送公安机关;(2)责令停止违法行为;(3)合计罚款人民币155.02万元。

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	21,323.70
2	应收证券清算款	479,298.96
3	应收股利	1,881.60
4	应收利息	6,820.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509,324.79

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	安信工业4.0混合A	安信工业4.0混合C
报告期期初基金份额总额	25,348,541.34	13,619,342.85
报告期期间基金总申购份额	130,837.90	5,084.98
减:报告期期间基金总赎回份额	933,206.35	7,405.60
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	24,546,172.89	13,617,022.23

§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	11,862,396.20
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	11,862,396.20
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	31.08

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	20181001-20181231	11,862,396.20	-	-	11,862,396.20	31.08
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》的约定暂停接受基金份额的申请,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工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《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合同》;

3、《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托管协议》;

4、《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