安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年04月22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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月07日
报告期末基金份额总额	504,128,059.69份
投资目标	灵活运用多种投资策略,深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果,力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在经济"新常态"的背景下,动态运用多种策略,实现基金资产长期稳定增值。资产配置上,基于宏观、政策及市场分析,将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间,股票投资方面,客观分析在"新常态"背景下行业景气度和发展前景、行业竞争结构和盈利模式,充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会;债券投资方面,利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合,并注重信用风险的控制;此外,本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。
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

§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(2019年01月01日 - 2019年03月31日)
1.本期已实现收益	27,516,181.16
2.本期利润	151,113,225.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.3112
4.期末基金资产净值	652,707,182.99
5.期末基金份额净值	1.295

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。

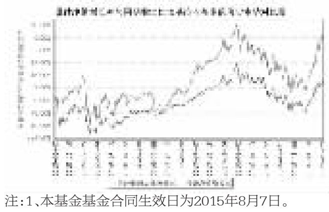
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	31.34%	1.51%	18.35%	1.06%	12.99%	0.45%

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8月7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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015年11月2日	-	13年	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。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司,现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信优势增长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、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票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。
袁玮	本基金的基金经理	2016年4月11日	-	9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、安信盈利驱动股票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

2019年一季度,市场如我们之前的判断,出现整体见底回升的局面。在指数逐月攀升的过程中风格轮动依然比较剧烈。一月份至春节前受到货币政策宽松与财政政策积极的宏观面影响,地产与周期股走势相对抢眼。春节过后,随着指数明显走强,利率的不断下行,市场的风险偏好迅速上升,使得成长股和缺乏基本面支撑的小盘股表现突出,大盘蓝筹股则是维稳运行。在三月末期,前期涨幅较大的成长股和小盘股出现了一定的调整,但此时沉寂了一段时间的大消费板块在经济数据回暖的带动下,出现了强劲的走势。至此,整个一季度周期、成长、消费均有良好表现。

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。一月份我们持有较多的地产与周期股,是我们相对表现最好的月份,在春节前我们兑现了部分地产和周期的盈利,转而适度增加了部分优质成长股的仓位,为二月份的成长爆发储备了一定的机会。三月中旬,我们又根据估值水平的情况以及基本面的情况，兑现了部分涨幅较大的成长股而提前布局了部分优质的消费股,一定程度上受益了之后的消费股行情。总体上看,本基金一季度收益还是比较理想的。

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1.295元，本报告期基金份额净值增长率为31.34%,同期业绩比较基准收益率为18.35%。

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	608,848,658.15	91.32
	其中:股票	608,848,658.15	91.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,997.26	0.01
	其中:债券	49,997.26	0.01
	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	48,760,852.84	7.31
8	其他资产	9,064,417.72	1.36
9	合计	666,723,925.97	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	11,468,061.00	1.76
C	制造业	285,958,188.71	43.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	72,325,323.61	11.08
F	批发和零售业	19,459,358.63	2.98
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	39,763,944.11	6.09
J	金融业	34,430,554.00	5.28
K	房地产业	134,997,275.75	20.68
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	10,445,952.34	1.60
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	608,848,658.15	93.28

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	000069	华侨城A	4,798,337	36,947,194.90	5.66
2	002230	科大讯飞	971,673	35,262,013.17	5.40
3	600383	金地集团	2,546,299	35,011,611.25	5.36
4	600048	保利地产	2,241,243	31,915,300.32	4.89
5	000002	万科A	1,013,124	31,123,169.28	4.77
6	000338	潍柴动力	2,308,348	27,353,923.80	4.19
7	601668	中国建筑	4,409,794	26,987,939.28	4.13
8	600741	华域汽车	1,105,168	22,523,323.84	3.45
9	000501	鄂武商A	1,620,263	19,459,358.63	2.98
10	002051	中工国际	1,249,997	18,862,454.73	2.89

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)	49,997.26	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,997.26	0.01

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	127011	中鼎转2	500	49,997.26	0.01

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。

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本期是否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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	173,827.77
2	应收证券清算款	8,777,033.51
3	应收股利	-
4	应收利息	12,519.02
5	应收申购款	101,037.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,064,417.72

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

报告期期初基金份额总额	426,018,022.51
报告期期间基金总申购份额	158,032,755.73
减:报告期期间基金总赎回份额	79,922,718.55
报告期期末基金份额总额	504,128,059.69

§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	7,691,538.46
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	7,691,538.46
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2019-03-28	7,691,538.46	9,666,279.42	0.10
合计			7,691,538.46	9,666,279.42	

§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新常态沪港深精选股票型证券投资基金募集的文件;
2、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金托管协议》;
4、《安信新常态沪港深精选股票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04月22日

安信新成长灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年04月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信新成长混合	
基金主代码	003345	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年09月29日	
报告期末基金份额总额	449,894,090.93份	
投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置，深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果。在严格控制风险的前提下,力争为投资者带来长期的超额收益。	
投资策略	根据国民经济发展过程各行业的投资机遇,结合宏观经济发展趋势及行业前景,选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司,在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报。通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，从而在一定程度上规避系统性风险。股票投资秉承价值投资理念,深度挖掘发展潜力巨大的行业与公司;同时灵活运用多种低风险投资策略,把握市场定价偏差带来的投资机会。	
业绩比较基准	50%*沪深300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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信新成长混合A	安信新成长混合C
下属分级基金的交易代码	003345	003346
报告期末下属分级基金的份额总额	400,635,622.40份	49,258,468.53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(2019年01月01日 - 2019年03月31日)	
	安信新成长混合A	安信新成长混合C
1.本期已实现收益	3,143,013.40	344,665.65
2.本期利润	15,414,215.52	1,795,587.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0368	0.0365
4.期末基金资产净值	417,101,570.99	51,230,929.56
5.期末基金份额净值	1.0411	1.0400

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

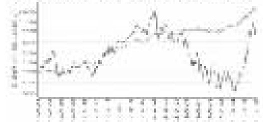
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

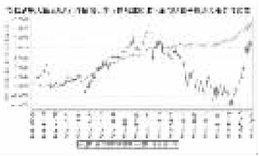
安信新成长混合A						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.68%	0.21%	13.72%	0.76%	-10.04%	-0.55%

安信新成长混合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	3.63%	0.21%	13.72%	0.76%	-10.09%	-0.55%

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2016年9月29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		
陈一峰	本基金的基金经理，总经理助理兼研究总监	2016年9月29日	-	11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、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；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的基金经理。
庄园	本基金的基金经理	2016年10月12日	-	15年	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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛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

2019年一季度流动性净投放明显缩量,货币市场利率波动性加大。货币市场利率中枢仍处于政策利率水平,但公开市场操作降频缩量。实体层面暂时尚未看到宽信用的明显效果。债券市场收益率整体走出了先下后上的趋势,尤其进入三月后股债跷跷板效应显现,在基准利率上行的带动下收益低位反弹。

权益方面一季度市场大幅上涨，上证指数上涨23.93%，沪深300指数上涨28.62%，中证500指数上涨33.10%,创业板指数上涨35.43%,中小盘股票显著好于大盘股。分行业来看,一季度农业、计算机、电子、食品饮料等行业涨幅居前,银行、公用事业、建筑装饰等行业涨幅靠后。

本基金一季度减掉了长久期利率债的配置仓位,以短久期、中高评级信用债为主要的配置方向。权益方面适当提高了持仓比例。

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1.0411元,本报告期基金份额净值增长率为3.68%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.0400元,本报告期基金份额净值增长率为3.63%;同期业绩比较基准收益率为13.72%。

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	81,759,171.32	17.44
	其中:股票	81,759,171.32	17.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	309,240,161.80	65.96
	其中:债券	309,240,161.80	65.96
	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	63,980,401.97	13.65
	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	6,866,287.37	1.46
8	其他资产	6,966,718.23	1.49
9	合计	468,812,740.69	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	5,383,319.00	1.15
C	制造业	52,478,542.98	11.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,985,600.00	0.64
E	建筑业	2,504,426.40	0.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,905,750.00	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	0.01
J	金融业	8,846,430.00	1.89
K	房地产业	3,987,200.00	0.85
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	3,635,000.00	0.78
S	综合	-	-
	合计	81,759,171.32	17.46

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	600352	浙江龙盛	375,241	6,454,145.20	1.38
2	600519	贵州茅台	5,700	4,867,743.00	1.04
3	600048	保利地产	280,000	3,987,200.00	0.85
4	600757	长江传媒	500,000	3,635,000.00	0.78
5	603589	口子窖	60,000	3,263,400.00	0.70
6	600741	华域汽车	160,000	3,260,800.00	0.70
7	601088	中国神华	164,900	3,233,689.00	0.69
8	600612	老凤祥	70,000	3,108,000.00	0.66
9	601288	农业银行	808,600	3,016,078.00	0.64
10	600674	川投能源	320,000	2,985,600.00	0.64

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	39,948,000.00	8.53
	其中:政策性金融债	39,948,000.00	8.53
4	企业债券	75,422,161.80	16.10
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	193,870,000.00	41.40
9	其他	-	-
10	合计	309,240,161.80	66.03

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	111805237	18建设银行CD237	500,000	48,850,000.00	10.43
2	111808257	18中信银行CD257	500,000	48,820,000.00	10.42
3	111807084	18招商银行CD084	500,000	47,870,000.00	10.22
4	190301	19进出01	400,000	39,948,000.00	8.53
5	0980140	09铁道03	300,000	30,417,000.00	6.49

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,力求实现所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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体除18浦发银行CD135（证券代码:111809135 CY，对应上市公司:浦发银行,股票代码:600000）、18浦发银行CD313(证券代码:111809313 CY,对应上市公司:浦发银行,股票代码:600000)、18招商银行CD084(证券代码:111807084 CY,对应上市公司:招商银行,股票代码:600036)、18中信银行CD257(证券代码:111808257 CY),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。

上海浦东发展银行股份有限公司于2018年8月1日收到中国人民银行处罚决定书（银反洗罚决字(2018)3号)。因浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、存在与身份不明的客户进行交易的行为等,根据《中华人民共和国反洗钱法》被合计处以170万元罚款,相关责任人被合计处以18万元罚款。

招商银行股份有限公司于2018年7月9日收到深圳保监局行政处罚决定书(深保监罚〔2018〕23号),因电话销售欺骗投保人,被罚款30万元。

招商银行股份有限公司于2018年5月4日收到中国银监会行政处罚决定书(银监罚决字〔2018〕1号),因内控管理严重违反审慎经营规则等行为,被罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

中信银行股份有限公司于2018年12月7日收到中国银保监会行政处罚书(银保监银罚决字〔2018〕14号),因违规经营、违规提供担保及财务资助,被予以罚款。

中信银行股份有限公司于2018年6月20日收到审计署审计决定书(总第41号),因财务会计报告违规,未依法履行职责,被责令整改。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	8,565.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,908,102.81
5	应收申购款	50,049.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,966,718.23

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	安信新成长混合A	安信新成长混合C
报告期期初基金份额总额	419,633,483.65	49,112,656.52
报告期期间基金总申购份额	686,266.18	508,625.42
减：报告期期间基金总赎回份额	19,684,127.43	362,813.41
报告期期末基金份额总额	400,635,622.40	49,258,468.53

§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

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	20190101-20190331	398,801,595.22	-	-	398,801,595.22	88.64
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新成长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《安信新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《安信新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《安信新成长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04月22日

安信新起点灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年04月22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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信新起点混合	
基金主代码	003957	
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	67,320,003.10份	
投资目标	本基金将以严格风险管理与控制为前提,通过积极主动的资产配置和灵活多样的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的投资回报。	
投资策略	资产配置方面,本基金通过分析宏观指标和政策,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。固定收益投资方面,本基金在利率走势分析、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、可转换债券等投资策略,配置流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种。股票投资方面,遵循自上而下和自下而上相结合原则,挖掘增长潜力巨大、同时符合资本市场阶段偏好的标的,同时,灵活运用多种低风险投资策略与事情驱动策略,把握市场定价偏差带来的投资机会。此外,本基金将合理利用权证、股指期货、国债期货等衍生工具,实现基金资产保值增值。	
业绩比较基准	50%*沪深300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	安信新起点混合A	安信新起点混合C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	591,467.76份	66,728,535.34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(2019年01月01日 - 2019年03月31日)	
安信新起点混合	A安信新起点混合C	
1.本期已实现收益	47,296.13	5,872,401.78
2.本期利润	123,675.02	18,658,868.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.2251	0.2257
4.期末基金资产净值	651,885.73	72,967,317.03
5.期末基金份额净值	1.1021	1.0935

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

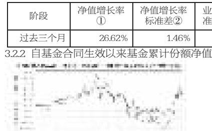
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

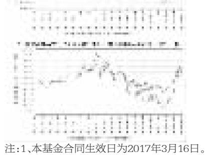
安信新起点混合A						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.68%	1.46%	13.72%	0.76%	12.96%	0.70%

安信新起点混合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	26.62%	1.46%	13.72%	0.76%	12.90%	0.70%

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		
徐黄玮	本基金的基金经理	2017年11月1日	-	12年	徐黄玮先生,理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任安信新起点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

2019年一季度,经济下行压力催生市场对宽松政策的期待,货币政策中性偏宽松,市场流动性相对充裕,十年期国债利率向下接近3%,中美贸易谈判也出现一定程度的好转。上述因素共同催化了2019年一季度的行情。

我们继续运用量化多因子模型,综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素,以自下而上为主,自上而下为辅,精选优质、具有投资价值和合理估值的公司作为主要的投资标的,为客户追求较好的投资回报。

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1.1021元,本报告期基金份额净值增长率为26.68%;截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.0935元,本报告期基金份额净值增长率为26.62%;同期业绩比较基准收益率为13.72%。

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	66,305,810.14	83.45
	其中:股票	66,305,810.14	83.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,724,810.64	4.69
	其中:债券	3,724,810.64	4.69
	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	3,600,000.00	4.53
	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	5,261,599.33	6.62
9	其他资产	565,690.97	0.71
10	合计	79,457,911.08	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	672,523.00	0.91
B	采矿业	2,365,716.00	3.21
C	制造业	26,239,095.03	35.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,413,452.00	1.92
E	建筑业	2,642,772.20	3.59
F	批发和零售业	1,405,347.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,097,925.00	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,110,658.74	2.87
J	金融业	21,934,834.57	29.79
K	房地产业	3,832,293.00	5.21
L	租赁和商务服务业	545,853.60	0.74
M	科学研究和技术服务业	75,056.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	235,448.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	399,415.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	335,421.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	66,305,810.14	90.07

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	601318	中国平安	53,800	4,147,980.00	5.63
2	600519	贵州茅台	2,700	2,305,773.00	3.13
3	600036	招商银行	54,600	1,852,032.00	2.52
4	000651	格力电器	28,800	1,359,648.00	1.85
5	600030	中信证券	52,700	1,305,906.00	1.77
6	000333	美的集团	24,950	1,215,813.50	1.65
7	601288	农业银行	308,400	1,150,332.00	1.56
8	601668	中国建筑	170,860	1,045,663.20	1.42
9	000002	万科A	30,400	933,888.00	1.27
10	600887	伊利股份	31,756	924,417.16	1.26

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	3,703,670.00	5.03
	其中:政策性金融债	3,703,670.00	5.03
4	企业债券	1,041.00	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	20,099.64	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,724,810.64	5.06

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	018005	国开1701	27,000	2,700,270.00	3.67
2	108901	农发1801	10,000	1,003,400.00	1.36
3	110054	通威转债	160	15,999.65	0.02
4	127012	招路转债	41	4,099.99	0.01
5	124079	PR保国资	50	1,041.00	0.00

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1904	IF1904	3	3,489,840.00	141,300.00	-
公允价值变动总额合计(元)					141,300.00
股指期货投资本期收益(元)					353,126.21
股指期货投资本期公允价值变动(元)					554,940.00

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,以套期保值为目的,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

本基金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本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体除农业银行（股票代码:601288)、招商银行（股票代码:600036)、中信证券(股票代码:600030),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。

中国农业银行股份有限公司多个分行于2018年5月15日因税收问题被处罚款。

招商银行股份有限公司于2018年7月9日收到深圳保监局行政处罚决定书(深保监罚〔2018〕23号),因电话销售欺骗投保人,被罚款30万元。

招商银行股份有限公司于2018年5月4日收到中国银监会行政处罚决定书(银监罚决字〔2018〕1号),因内控管理严重违反审慎经营规则等行为,被罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

中信证券股份有限公司于2018年5月25日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号),因违规对司度(上海)贸易有限公司提供融资融券服务,被证监会给予警告,没收违法所得人民币61,655,849.78元,并处人民币308,279,248.90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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	394,305.13
2	应收证券清算款	54,634.85
3	应收股利	-
4	应收利息	113,799.07
5	应收申购款	2,951.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	565,690.97

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	安信新起点混合A	安信新起点混合C
报告期期初基金份额总额	517,655.17	86,816,053.09
报告期期间基金总申购份额	144,776.52	17,766,293.91
减:报告期期间基金总赎回份额	70,963.93	37,853,811.66
报告期期末基金份额总额	591,467.76	66,728,535.34

§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	-
报告期期间买入/申购总份额	11,578,094.25
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	11,578,094.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	17.20

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	基金转换(入)	2019-01-02	11,578,094.25	10,000,000.00	0.00
合计			11,578,094.25	10,000,000.00	

§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	20190221-20190331	14,895,729.89	-	-	14,895,729.89	22.13
	2	20190101-20190331	50,975,337.28	-	26,200,000.00	24,775,337.28	36.80
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新起点灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《安信新起点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04月22日