安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信鑫发优选混合
基金主代码	000433
交易代码	000433
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月31日
报告期末基金份额总额	616,031,752.09份
投资目标	以风险管理为基础,通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上,结合政策因素、市场情绪与估值因素等,分析大类资产风险收益比,合理配置;在固定收益类的投资上,采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略,选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种;在股票投资上,秉承价值投资理念,灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略,把握市场定价偏差带来的投资机会;在衍生品投资上,合理利用权证等做套保或套利投资;在风险管理上,根据市场环境的变化,动态调整仓位和投资品种,并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	1年期人民币定期存款基准利率+3.00%
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	广发银行股份有限公司

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	17,718,430.99
2.本期利润	21,715,018.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0348
4.期末基金资产净值	655,193,245.51
5.期末基金份额净值	1.064

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。

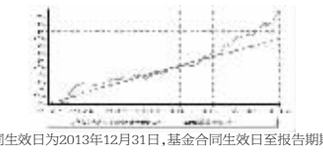
3.2 基金净值表现

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	3.50%	0.10%	1.47%	0.01%	2.03%	0.09%

注:业绩比较基准收益率=1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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2013年12月31日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

2、本基金的建仓期为2013年12月31日至2014年6月30日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。图示日期为2013年12月31日至2014年9月30日。

§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	2013年12月31日	-	7	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基金投资部。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;现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。

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

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》、《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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年三季度,A股市场经历了较大幅度上涨,而市场上涨的核心推动动力在3季度前后有显著差异。7月份,市场上涨仍然是以经济基本面的阶段性改善作为反弹核心矛盾,底部徘徊的A股在7月PMI数据超预期情况下走出第一波行情。但从8月开始,特别是8月下旬陆续公布的一系列不利经济数据,并未给市场带来大幅度调整,之后市场反而走出更为凌厉的第二波行情,究其原因,就是在系统风险不大情况下,驱动市场的核心矛盾已经从经济基本面转向改革预期带来的风险溢价水平降低上,加上沪港通预期带来的增量资金,共同推动市场上涨。安信鑫发优选基金在三季度基本把握住行情的波动,适时调整权益类资产配置比例,以军工、核电、工业自动化、农林牧渔等行业领域配置为主要配置,取得了相对较好的投资业绩。同时,新股投资收益较前期也有所改善,贡献了部分净值收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.064元,本报告期份额净值增长率为3.50%,同期业绩比较基准增长率为1.47%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续,支撑市场上涨的改革预期等因素可能会阶段性弱化,加上上市公司三季报业绩有下行风险,外部资金流入的持续性也会受阻于美元的不断升值,市场后续上涨空间相对有限,四季度的权益配置上应以平衡配置为主,适时降低权益资产配置比例。重点配置行业包括:房地产相关产业链,这主要是考虑到当前房地产市场无论从政策面还是基本面,都在朝好的方向发展,而在政策蜜月期往往是配置房地产相关产业链最优时期;另外,增加医药行业配置,主要是考虑到医药行业前期涨幅较小,而明年的招投标大年对于相关医药公司形成利好。此外,在主题投资上,军工、国企改革和体育产业可以继续关注。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	61,056,660.55	9.30
	其中:股票	61,056,660.55	9.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,282,000.00	3.24
	其中:债券	21,282,000.00	3.24
	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	420,000,000.00	63.97
	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	153,178,582.17	23.33
8	其他各项资产	1,002,760.56	0.15
9	合计	656,520,003.28	100.00

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	2,997,708.00	0.46
B	采矿业	11,051,328.86	1.69
C	制造业	19,356,448.52	2.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,696,693.68	0.56
F	批发和零售业	5,850,353.14	0.89
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	1,513,976.17	0.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	12,147,163.00	1.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,621,197.18	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	2,821,792.00	0.43
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	61,056,660.55	9.32

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	000402	金融街	1,148,000	7,393,120.00	1.13
2	000409	山东地矿	485,300	6,352,577.00	0.97
3	600859	王府井	310,199	5,850,353.14	0.89
4	600126	杭钢股份	1,105,570	5,472,571.50	0.84
5	600158	中体产业	371,700	4,754,043.00	0.73
6	000697	炼石有色	215,737	4,698,751.86	0.72
7	000911	南宁糖业	358,068	3,945,909.36	0.60
8	600133	东湖高新	516,298	3,696,693.68	0.56
9	600108	亚盛集团	355,600	2,997,708.00	0.46
10	000978	桂林旅游	348,800	2,821,792.00	0.43

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	20,032,000.00	3.06
	其中:政策性金融债	20,032,000.00	3.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,250,000.00	0.19
8	其他	-	-
9	合计	21,282,000.00	3.25

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	140410	14农发10	200,000	20,032,000.00	3.06
2	128008	齐峰转债	12,500	1,250,000.00	0.19

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

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。

5.11 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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	155,808.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	843,981.95
5	应收申购款	2,970.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,002,760.56

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	631,894,232.57
报告期期间基金总申购份额	68,446,382.48
减:报告期期间基金总赎回份额	84,308,862.96
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	616,031,752.09

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信鑫发优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。

8.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

8.3 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
二〇一四年十月二十七日

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

【2014】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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2014年10月22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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信永利信用债券	
基金主代码	000310	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2013年11月8日	
报告期末基金份额总额	251,618,414.92份	
投资目标	在严格控制信用风险的前提下,通过稳健的投资策略,为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	封闭期内,在久期配置上,预测利率和收益率的变动,合理匹配投资组合久期和封闭期;在品种配置上,基于宏观基本面研究,分析多种因素,合理配置不同债券的构成比例;在信用投资上,依据内外评级结果,建立信用债券的投资库,并进行动态调整和维护;在可转债投资上,合理估值,投资价值低估的可转债;在资产支持证券的投资上,重点关注基础资产的类型、发行条款、提前偿还率和市场流动性等因素,综合评估。开放期内,主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的流动性,减小净值的波动。	
业绩比较基准	1.5×1年期银行定期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
下属两级基金的交易代码	000310	000335
报告期末下属两级基金的份额总额	190,312,774.81份	61,305,640.11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(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
1.本期已实现收益	7,201,779.63	2,246,531.07
2.本期利润	7,986,136.88	2,498,117.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0420	0.0407
4.期末基金资产净值	209,724,669.65	67,317,952.67
5.期末基金份额净值	1.102	1.098

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

安信永利信用债券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	3.96%	0.13%	1.10%	0.01%	2.86%	0.12%

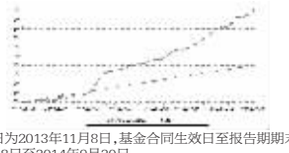
安信永利信用债券C

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	3.88%	0.12%	1.10%	0.01%	2.78%	0.11%

注:业绩比较基准=1.5×1年期银行定期存款基准利率

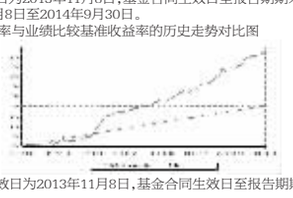
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金基金合同生效日为2013年11月8日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2013年11月8日至2014年9月30日。

本基金C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、本基金基金合同生效日为2013年11月8日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

2、本基金的建仓期为2013年11月8日至2014年5月7日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。图示日期为2013年11月8日至2014年9月30日。

§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			
李勇	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理	2013年11月8日		8	李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。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;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。	

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

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》、《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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债市呈现先抑后扬的格局。中债总财富(总值)指数从7月1日的147.87点,先下探至7月18日的146.56,后逐步上涨至9月底的150.43点。我们在此轮行情中,基于"弱经济,强政策"的基本判断,始终保持了较高的仓位,为客户取得了较好的收益。期间,阶段性的增仓转债,较好的参与了近期的股市行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金A类份额净值为1.102元,本基金C类份额净值为1.098元。本报告期本基金A类份额净值增长率为3.96%,本基金C类份额净值增长率为3.88%,同期业绩比较基准增长为1.10%。基金业绩分别高于同期业绩比较基准2.86%和2.78%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今后半年,房地产仍然是经济增速的主要影响因素。近期房地产的刺激政策出台很多,力度可观。但我们认为,大约还需要2个季度的时间,这些政策的效能才能得到充分释放,最终改变经济增速的下行趋势。最近1-2个季度,宏观经济仍然比较脆弱,对债市来说政策面资金面风险不大。同时,较低的经济增速,以及收入增速下,通胀压力不大。我们认为,未来债券的资本利得也许空间不大,但中短期信用债的配置价值仍然很好。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	482,102,412.42	93.26
	其中:债券	482,102,412.42	93.26
	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	17,569,574.01	3.40
8	其他各项资产	17,257,233.64	3.34
9	合计	516,929,220.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,132,200.00	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,040,300.00	4.71
	其中:政策性金融债	13,040,300.00	4.71
4	企业债券	332,421,642.42	119.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	91,464,000.00	33.01
7	可转债	42,044,270.00	15.18
8	其他	-	-
9	合计	482,102,412.42	174.02

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1182395	11宽国资MTN1	500,000	50,990,000.00	18.41
2	122266	13中信03	490,750	49,276,207.50	17.79
3	112054	11鄂能债	446,611	44,750,422.20	16.15
4	112001	08粤电债	339,769	34,096,158.92	12.31
5	124640	09吴国资	292,370	29,675,555.00	10.71

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

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

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。

5.11 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证券没有超出基金合同规定的备选证券库,本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	121,610.16
2	应收证券清算款	4,793,389.38
3	应收股利	-
4	应收利息	12,342,234.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	17,257,233.64

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	9,376,580.00	3.38
2	113005	平安转债	8,208,750.00	2.96

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
本报告期期初基金份额总额	190,312,774.81	61,305,640.11
本报告期期间基金总申购份额	-	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	190,312,774.81	61,305,640.11

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永利信用定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、《安信永利信用定期开放债券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。

8.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

8.3 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
二〇一四年十月二十七日

安信现金管理货币市场基金

【2014】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信现金管理货币	
基金主代码	750006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年02月05日	
报告期末基金份额总额	1,075,683,051.72份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资组合,力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	1.资产配置策略。通过对宏观经济指标的跟踪和分析,并结合央行公开市场操作等情况,合理预测货币市场利率趋势变化,决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。 2.个券选择策略。考虑安全性因素,优先选择国债等高信用等级债券以规避信用风险。在满足信用评级要求的前提下,根据我公司债券评分标准对信用债券进行评分筛选,重点关注低估值品种。 3.套利策略。在保证安全性和流动性的前提下,本基金将在充分验证套利机会可行性的基础上,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会。 4.回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异,在精确投资收益测算的基础上,积极采取回购杠杆操作,为基金资产增加收益。 5.流动性管理策略。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,确保基金资产的变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
下属两级基金的交易代码	750006	750007
报告期末下属两级基金的份额总额	272,115,399.03份	803,567,652.69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(2014年07月01日-2014年09月30日)	
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
1.本期已实现收益	4,273,412.35	10,133,686.84
2.本期利润	4,273,412.35	10,133,686.84
3.期末基金资产净值	272,115,399.03	803,567,652.69

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、安信现金管理货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1281%	0.0060%	0.3403%	0.0000%	0.7878%	0.0060%

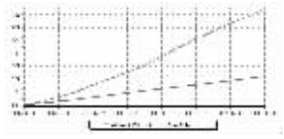
2、安信现金管理货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1895%	0.0060%	0.3403%	0.0000%	0.8492%	0.0060%

注:1、本基金收益分配为按日结转份额;

2、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金的建仓期为2013年2月5日至2013年8月4日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日。图示日期为2013年2月5日至2014年9月30日。

§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		
李勇	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理	2013年02月05日	-	8	李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。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;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
张翼飞	本基金的基金经理	2014年03月26日	-	3.5	张翼飞先生,经济学硕士。历任摩根礼机(上海)有限公司财务部会计、财务主管、上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员、秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监、日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信现金