方正富邦货币市场基金

2014 第三季度报告

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司
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。

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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	方正富邦货币
基金主代码	730003
基金交易代码	730003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月26日
报告期末基金份额总额	87,790,682.73份
投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。 具体而言,本基金的投资策略以自上而下为主,同时兼顾自下而上的方式。其中,自上而下是指基金管理人通过宏观与定性相结合的综合分析,对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测,在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构,构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析,同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会,进行相应的套利操作,增加投资收益。
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高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
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	方正富邦货币A	方正富邦货币B
下属两级基金的交易代码	730003	730103
报告期末下属两级基金的份额总额	19,119,263.85份	68,671,418.88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)	
	方正富邦货币A	方正富邦货币B
1.本期已实现收益	183,171.55	840,249.39
2.本期利润	183,171.55	840,249.39
3.期末基金资产净值	19,119,263.85	68,671,418.88

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,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、方正富邦货币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	1.2040%	0.0175%	0.3403%	0.0000%	0.8637%	0.0175%

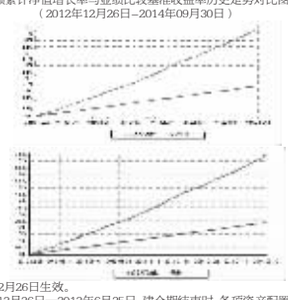
2、方正富邦货币B

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	1.2653%	0.0175%	0.3403%	0.0000%	0.9250%	0.0175%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

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

方正富邦货币市场基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月26日-2014年09月30日)



注:1、本基金合同于2012年12月26日生效。

2、本基金的建仓期为2012年12月26日—2013年6月26日,建仓期结束时,各项资产配置比例均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		
沈毅	公司投资总监兼研究总监	2014年01月09日	-	12年	本科毕业于清华大学国民经济管理专业,硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理(MBA)专业。1993年8月加入中国人民银行深圳分行外汇经纪中心,总行国际司国际业务资金处,历任交易员、投资经理职务;2002年6月加入嘉实基金管理有限公司投资部,任投资经理职务;2004年4月加入光大保德信基金管理有限公司投资部,历任高级投资经理兼资产配置经理、货币基金基金经理、投资副总监、代理投资总监职务;2007年11月加入长江养老保险股份有限公司投资部,任部门总经理职务;2008年1月加入泰达宏利基金管理有限公司固定收益部,任部门总经理职务;2012年10月加入方正富邦基金管理有限公司,任基金投资部总监兼研究部总监职务;2014年1月,任基金经理。
李文君	本基金基金经理	2014年03月07日	-	7年	本科毕业于天津财经大学计算机科学与技术专业和金融学专业,硕士毕业于中国人民大学金融学专业。2007年9月至2011年4月,任东方基金管理有限公司交易部交易员;2011年5月至2013年7月,任方正富邦基金管理有限公司交易部交易员;2013年8月至2014年2月,任基金投资部基金经理助理;2014年3月,任基金经理。

注:①“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无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

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先,价格优先的原则严格执行所有指令,确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,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3季度,美元摆脱了2013年3季度以来的盘整格局,开始一波强劲上扬。受此影响,人民币汇率维持宽幅度的震荡。虽然资易条件有所改善,但热钱回流迹象相当明显,央行在公开市场的立场也转向宽松。同时央行启动SLF和PSL作为新的利率管理工具,降低资金成本。利率通道走势逐渐显露,新股申购仍对资金市场有所冲击。本基金在3季度操作中,重点配置的企业融资券等品种,表现稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2014年9月30日,本基金本报告期A级份额净值收益率为1.2040%,B级份额净值收益率为1.2653%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望4季度,十二届四中全会以及年底中央经济工作会议,将给宏观经济的走向带来一定的变数。但预计货币政策仍将维持适度的宽松,同时随着银行资金余额管理转向日均计算,资金利率的波动将进一步有所下降。货币市场品种预计整体将表现平稳,个别信用等级较低的品种则需要有所回避。

§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	固定收益投资	27,079,984.75	30.73
	其中:债券	27,079,984.75	30.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,000,165.00	38.58
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	26,133,155.55	29.65
4	其他资产	916,276.99	1.04
5	合计	88,129,582.29	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		
1	报告期内债券回购融资余额	占基金资产净值比例(%)	7.41
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。

5.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内,本货币市场基金债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天,本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	13.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	17.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.34	-

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,008,163.43	7.98
	其中:政策性金融债	7,008,163.43	7.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,071,821.32	22.86
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	27,079,984.75	30.85
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	70,000	7,008,163.43	7.98
2	041452019	14西王CP003	50,000	5,071,288.53	5.78
3	041462012	14华映科技CP001	50,000	5,000,209.58	5.70
4	041462011	14冀物流CP001	50,000	5,000,202.87	5.70
5	041456004	14美克CP001	50,000	5,000,120.34	5.70

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	57
报告期内偏离度的最高值	0.4179%
报告期内偏离度的最低值	0.1738%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3122%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为“公允价值变动损益”,并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

5.8.2 本基金本报告期内未发生持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	916,276.99
4	应收申购款	
5	其他应收款	-
6	其他	-
	合计	916,276.99

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	方正富邦货币A	方正富邦货币B
报告期期初基金份额总额	14,874,621.26	65,112,126.22
报告期基金总申购份额	53,718,978.08	21,370,588.39
减:报告期基金总赎回份额	49,474,335.49	17,811,295.73
报告期期末基金份额总额	19,119,263.85	68,671,418.88

注:总申购份额含红利再投、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

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	2014年07月09日	2,500,000.00	2,500,000.00	-
2	赎回	2014年08月06日	2,000,000.00	2,000,000.00	-
合计			4,500,000.00	4,500,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准基金募集的文件;

(2)《方正富邦货币市场基金基金合同》;

(3)《方正富邦货币市场基金基金托管协议》;

(4)《方正富邦货币市场基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一四年十月二十七日

安信策略精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: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	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
交易代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	28,143,297.85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	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的模式,在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上,以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司

§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	3,227,107.09
2.本期利润	4,835,835.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.1448
4.期末基金资产净值	34,120,242.09
5.期末基金份额净值	1.212

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	12.95%	0.75%	8.07%	0.54%	4.88%	0.21%

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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、本基金的建仓期为2012年6月20日至2012年12月19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2012年6月20日。图示日期为2012年6月20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		
黄立华	本基金的基金经理	2014年1月15日	-	8	黄立华先生,理学硕士、工商管理硕士,注册金融分析师(CFA)。历任Lanac Technology(美国)项目经理。Emory Investment Management(美国)公司研究员、Eamest Partners(美国)公司研究员、投资经理,安信证券股份有限公司高级投资经理。2013年2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,安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:1、此处任职日期是指其注册成为本基金的基金经理注册生效日。

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,在经济改革持续推进、沪港通政策出台,资金成本下降,IPO下半年限量发行,增量资金逐步进入股市等因素的刺激下,A股大盘迎来了持续时间较长的反弹。本基金在进入三季度以后,出于对于整体创业板估值泡沫积累的担忧,逐渐降低了高估值品种的配置比例,适度保留了一些成长性长期看好的并受益于经济结构转型的品种,同时逐步增加了蓝筹股的配置比例、可转债的比例以及消费医药的比例。

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1.212元,本报告期份额净值增长率为12.95%,同期业绩比较基准增长率为8.07%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年四季度,海外发达国家经济复苏虽然比预期要弱,但发达国家尤其是美国经济内在的复苏还是很明显。前期公布的地产和工业增加值等数据普遍反映国内经济偏弱,出于稳定经济增长的需要,在上半年推出一系列措施如加快基建项目批复、出台京津冀一体化政策、定向降准、放松银行的存贷比等的基础上,政府进入四季度开始在地产政策出现明显的放松。在宏观经济能够相对稳定和资金成本逐步下降的背景下,虽然大盘从底部反弹了约15%,但蓝筹股从估值和业绩角度出发依然有较大吸引力,下行空间较小,而创业板估值经过三季度的大幅反弹后又积累了较大泡沫,不少成长股公司的下半年业绩也有较大可能会低于预期,随着沪港通在10月份的实质性推出以及投资者对后期注册制的预期,大批伪成长股股价有较大下行风险,而A股的一些稀缺品种和防御性板块如消费医药等则有可能受投资者关注。安信策略精选灵活配置基金在做好大类资产配置同时,以精选个股为主,重点关注低估值而盈利前景看好的蓝筹股以及受益于经济结构转型的行业及其优质成长股,如非银金融、TMT、大众消费、高端装备、新能源等,同时关注市场化改革相关受益领域和新股的投资机会。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	24,669,312.88	71.28
	其中:股票	24,669,312.88	71.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,689,852.00	13.55
	其中:债券	4,689,852.00	13.55
	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	1,300,000.00	3.76
	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	3,811,203.69	11.01
8	其他各项资产	139,772.44	0.40
9	合计	34,610,141.01	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	1,233,301.88	3.61
B	采矿业	282,000.00	0.83
C	制造业	12,919,331.00	37.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,680.00	0.01
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	1,532,800.00	4.49
J	金融业	3,961,200.00	11.61
K	房地产业	1,515,400.00	4.44
L	租赁和商务服务业	871,900.00	2.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,024,100.00	5.93
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	324,600.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	24,669,312.88	72.30

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	000625	长安汽车	120,000	1,644,000.00	4.82
2	600030	中信证券	120,000	1,598,400.00	4.68
3	300212	易华录	40,000	1,532,800.00	4.49
4	000069	华侨城A	250,000	1,362,500.00	3.99
5	601318	中国平安	30,000	1,240,200.00	3.63
6	600585	海螺水泥	70,000	1,202,600.00	3.52
7	000002	万 科A	130,000	1,193,400.00	3.50
8	600741	华域汽车	90,000	1,157,400.00	3.39
9	300147	香雪制药	50,000	1,134,500.00	3.33
10	600518	康美药业	70,000	1,121,400.00	3.29

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	4,689,852.00	13.75
8	其他	-	-
9	合计	4,689,852.00	13.75

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	110023	民生转债	15,000	1,403,400.00	4.11
2	113005	平安转债	11,360	1,243,352.00	3.64
3	110015	石化转债	7,000	763,210.00	2.24
4	113002	工行转债	7,000	762,090.00	2.23
5	113001	中行转债	5,000	517,800.00	1.52

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	42,814.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,436.02
5	应收申购款	78,521.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,772.44

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	110023	民生转债	1,403,400.00	4.11
2	113005	平安转债	1,243,352.00	3.64
3	110015	石化转债	763,210.00	2.24
4	113002	工行转债	762,090.00	2.23
5	113001	中行转债	517,800.00	1.52

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300212	易华录	1,532,800.00	4.49	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	36,595,350.37
报告期期间基金总申购份额	9,976,038.51
减:报告期期间基金总赎回份额	18,428,091.03
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	28,143,297.85

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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金出现了资产净值连续20个工作日低于5000万元人民币的情形。

§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策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信策略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

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

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
二〇一四年十月二十七日

安信宝利分级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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	安信宝利分级债券(场内简称“安信宝利”)	
基金主代码	167501	
基金运作方式	契约型。本基金基金合同生效之日起2年内,宝利A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,宝利B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后2年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2013年7月24日	
报告期末基金份额总额	1,864,397,976.79份	
投资目标	在适度承担信用风险的情况下,力争实现基金财产当期稳定的超越基准的投资收益。	
投资策略	本基金的债券投资主要将采用信用策略,同时辅以利率策略、收益率策略、回购策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、新股投资策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过信用分析和对信用利差趋势的判断,为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。	
业