

安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

2014 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：广发银行股份有限公司
报告送出日期：2015年1月21日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。
本报告自2015年1月19日起生效。
本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	安信鑫发优选混合
基金代码	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	481,510,867.820
投资目标	以风险管理为基础，通过积极灵活的资产配置和注重有效的投资策略，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上，结合宏观经济、市场估值与信用等因素，分类大类资产风险收益，合理配置；在个股选择上，采用基本面、估值、行业景气、业绩、治理等策略，选择成长性良好、风险适度合理、长期成长性和信用质量较高的品种；在股票投资上，采取自下而上、行业轮动、个股精选、分散投资、动态调整等策略，把握市场阶段性轮动带来的投资机会；在固定收益投资上，合理运用固定收益类资产和权益类资产，在风险管理上，根据市场环境的变化，动态调整仓位和资产配置，力争实现基金资产的长期增值和稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型平衡基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金，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	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年10月1日—2014年12月31日)
1.本期已实现收益	19,633,799.30
2.本期利润	18,496,460.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252
4.期末基金资产净值	524,293,465.88
5.期末基金份额净值	1.089

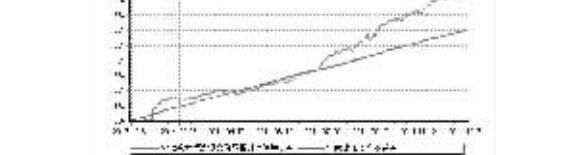
注：1.所述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.35%	0.13%	1.45%	0.02%	0.90%	0.11%

注：业绩比较基准收益率=1年期人民币定期存款利率+1年期人民币定期存款利率×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，展示日期为2013年12月31日至2014年12月31日。
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约定。

§4 管理人报告	
4.1 基金管理人（或基金基金经理）简介	
姓名	职务
蓝蔚生	基金基金经理
蓝蔚生	基金基金经理

注：1.蓝蔚生的任职日期为本基金合同生效日。
2.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

2.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

3.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

4.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

5.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

6.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

7.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

8.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

9.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

10.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

11.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

12.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

13.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

14.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

15.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

16.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

17.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

18.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

19.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

20.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

21.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

22.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

23.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

24.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

25.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

26.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

27.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

28.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

29.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

30.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

31.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

32.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

33.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

34.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

35.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

36.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

37.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

38.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

39.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

40.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

41.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

42.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

43.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

44.蓝蔚生先生毕业于清华大学，曾任中信证券股份有限公司资产管理部负责人，现任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作，并担任安信基金管理有限责任公司资产管理部负责人，负责安信基金管理有限责任公司资产管理部日常管理工作。

序号	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	3,240,480.57	0.62
C	制造业	28,738,394.73	5.48
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	1,817,200.00	0.35
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	采矿业	-	-
K	制造业	-	-
L	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,595,654.40	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	房地产业	-	-
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		37,391,899.70	7.13

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	002377	华测检测	91,529	5,295,867.94	1.01
2	600271	航天信息	140,436	4,284,702.36	0.82
3	300021	大晟软件	345,719	4,134,576.45	0.79
4	300012	华测检测	260,522	3,595,654.40	0.69
5	000049	山东黄金	318,043	3,240,480.57	0.62
6	002117	东富药业	158,000	3,233,615.00	0.62
7	600685	中航证券	68,100	2,425,722.00	0.46
8	600899	紫金矿业	89,278	2,310,423.50	0.44
9	002658	诺思达	67,500	1,858,560.00	0.35
10	002385	大北农	135,904	1,823,831.68	0.35

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,010,000.00	3.82
4	企业债	20,010,000.00	3.82
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,232,000.00	0.43
8	其他	-	-
9	合计	22,242,000.00	4.24

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十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140410	14债10	200,000	20,010,000.00	3.82
2	110410	11债10	20,000	2,010,000.00	0.43

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投资情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金股指期货投资的收益情况

5.9.3 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

2014 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：广发银行股份有限公司
报告送出日期：2015年1月21日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。
本报告自2014年10月1日起生效。
本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	安信永利信用债券
基金代码	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08日
报告期末基金份额总额	294,083,067.010
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，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上，结合宏观经济、市场估值与信用等因素，分类大类资产风险收益，合理配置；在个股选择上，采用基本面、估值、行业景气、业绩、治理等策略，选择成长性良好、风险适度合理、长期成长性和信用质量较高的品种；在股票投资上，采取自下而上、行业轮动、个股精选、分散投资、动态调整等策略，把握市场阶段性轮动带来的投资机会；在固定收益投资上，合理运用固定收益类资产和权益类资产，在风险管理上，根据市场环境的变化，动态调整仓位和资产配置，力争实现基金资产的长期增值和稳健增值。
业绩比较基准	1.5x1年期定期存款基准利率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，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
基金销售机构	安信永利信用债券A 安信永利信用债券B
报告期末基金份额总额	297,766,752.100

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年10月1日—2014年12月31日)
1.本期已实现收益	8,003,000.43
2.本期利润	7,314,080.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0385
4.期末基金资产净值	218,382,692.49
5.期末基金份额净值	1.051

注：1.所述基金净值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。