安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

【2015】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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	一带分级		
场内简称	一带分级		
交易代码	167503		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2015年5月14日		
报告期末基金份额总额	802,394,806.01份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	股票投资上,本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整;债券投资上,本基金将以宏观形势及利率分析为基础,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价;权证投资上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价,谨慎进行权证投资;资产支持证券投资方面,综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。		
业绩比较基准	中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
基金管理人	安信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
下属分级基金简称	一带一A	一带一B	一带分级
下属分级场内简称	一带一A	一带一B	一带分级
下属分级基金交易代码	150275	150276	167503
下属分级基金报告期末基金份额总额	355,481,715.00份	355,481,715.00份	91,431,376.01份
下属分级基金的风险收益特征	安信一带一路A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	安信一带一路B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,764,278,366.31
2.本期利润	-1,388,372,213.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5990
4.期末基金资产净值	669,757,365.21
5.期末基金份额净值	0.835

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。

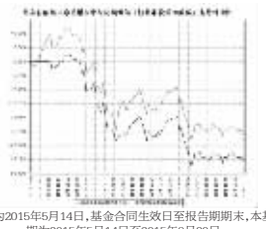
3.2 基金净值表现

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	-34.35%	3.94%	-27.31%	3.99%	-7.04%	-0.05%

注:业绩比较基准收益率=中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)

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2015年5月14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2015年5月14日至2015年9月30日。
2.本基金的建仓期为2015年5月14日至2015年11月13日。截止本报告期末,本基金仍处于建仓期。

§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		
龙川	本基金的基金经理、量化投资部总经理	2015年5月14日	-	13	龙川先生,统计学博士。历任Susquehanna International Group(美国)量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路指数分级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》、《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

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度是风云变幻的一季,中国A股市场遭遇一场载入史册的“股灾”,在清理场外配资和融资融券的压力下,上证综指由6月高位5178点断崖式下跌,进入震荡盘整期。政府救市行动、改革监管等措施层出不穷。然而,市场仍弥漫对中国宏观经济改善乏力的担忧,救市效果不甚理想。在此影响下,中证一带一路指数在第三季度遭遇大幅下跌,基金在7月上旬发生下折。

安信一带一路基金采取完全复制指数的被动式指数管理策略,量化及人工管理相结合的投资方法,处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。在报告期内,本基金遇到多次大额申购赎回事件,在一定程度上增加了本基金的交易成本,我们仍然较好地将跟踪误差以及日均跟踪偏离度控制在合理水平以内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为0.835元,本报告期份额净值增长率为-34.35%,同期业绩比较基准增长率为-27.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

“一带一路”战略对提振我国宏观经济,发展全球经济协同效应具有重要作用。2015年9月,商务部公布今年首8个月,中国企业对“一带一路”沿线的48个国家直接投资增长48.2%至107.3亿美元。期内中国在沿线国家新承揽对外承包工程新签合同额占对外承包工程合同额总量的43.5%,增长近3成,主要涉及电力工程建设、交通运输建设、房屋建筑及石油化工等板块。同时,9月公布的中美合作筹建高铁合资公司,修建美西高铁项目,也充分说明中国高铁的核心竞争力得到了国际进一步承认。9月内人民币贬值预期也将拉动中国出口及对外承包。由于中国在高铁、北斗、核电、建筑和通信等诸多行业拥有国际竞争优势,目前这些板块蕴藏着丰富的投资机会。

近期资本市场的暴跌迅速挤掉了前期涨幅过大的泡沫,在一带一路版块内,多支优质个股已迎来建仓最佳时机。我们将保持稳健的投资风格和均衡配置的策略,保持相对灵活的仓位,力争为投资者带来更好的回报。

4.6 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,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

§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	608,271,155.06	89.62
	其中:股票	608,271,155.06	89.62
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	53,042,547.66	7.82
7	其他资产	17,382,480.82	2.56
8	合计	678,696,183.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	62,663,328.71	9.36
C	制造业	280,427,114.77	41.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	136,271,873.95	20.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	116,447,781.90	17.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,927,645.73	1.78
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	533,410.00	0.08
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	608,271,155.06	90.82

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600312	平高电气	3,285,300	43,595,931.00	6.51
2	601018	宁波港	4,726,949	32,048,714.22	4.79
3	601618	中国中冶	3,506,967	21,041,802.00	3.14
4	601866	中海集运	2,539,605	17,040,749.55	2.54
5	601989	中国重工	1,671,884	16,735,558.84	2.50
6	600028	中国石化	3,418,800	16,205,112.00	2.42
7	601857	中国石油	1,943,100	15,991,713.00	2.39
8	601727	上海电气	1,397,500	15,693,925.00	2.34
9	601668	中国建筑	2,688,599	15,540,102.22	2.32
10	000063	中兴通讯	983,011	15,334,971.60	2.29

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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(元)
1	存出保证金	14,509,133.04
2	应收证券清算款	2,783,922.38
3	应收股利	-
4	应收利息	28,720.72
5	应收申购款	31,840.77
6	其他应收款	755.66
7	待摊费用	28,108.25
8	其他	-
9	合计	17,382,480.82

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600312	平高电气	43,595,931.00	6.51	重大事项停牌
2	601018	宁波港	32,048,714.22	4.79	重大事项停牌
3	601618	中国中冶	21,041,802.00	3.14	重大事项停牌
4	601866	中海集运	17,040,749.55	2.54	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	一带一A	一带一B	一带分级
报告期期初基金份额总额	4,183,050,783.00	4,183,050,783.00	117,160,072.32
报告期期间基金总申购份额	-	-	268,549,653.53
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	4,814,155,098.71
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-3,827,569,068.00	-3,827,569,068.00	4,519,876,748.86
报告期期末基金份额总额	355,481,715.00	355,481,715.00	91,431,376.01

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 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件;
2、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》;
4、《安信中证一带一路主题指数分级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莲花街道益田路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
2015年10月26日

安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信优势增长混合
交易代码	001287
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月20日
报告期末基金份额总额	439,741,989.76份
投资目标	本基金将以严谨细致的逻辑和基本面分析为基础,通过自上而下和自下而上结合,把握经济转型发展期具有较高增长潜力的上市公司的投资机会,力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	资产配置方面,通过对基本面数据的分析和逻辑梳理,分析比较大类资产的风险收益比,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例;股票投资方面,主要从行业配置和个股精选两个层面进行投资;固定收益类投资方面,根据宏观数据和市场交易情况,合理判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,构建固定收益类债券投资组合;此外,本基金还采用股指期货投资策略、权证投资策略、低风险套利型投资策略等衍生品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×50%+中证综合债券指数收益率×50%。
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	招商证券股份有限公司

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	109,257,956.73
2.本期利润	52,859,717.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085
4.期末基金资产净值	452,423,182.34
5.期末基金份额净值	1.029

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。

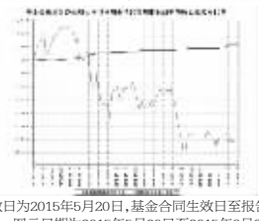
3.2 基金净值表现

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	1.38%	0.06%	-13.63%	1.67%	15.01%	-1.61%

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

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



注:1.本基金基金合同生效日为2015年5月20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2015年5月20日至2015年9月30日。
2.本基金的建仓期为2015年5月20日至2015年11月19日。截止本报告期末,本基金仍处于建仓期。

§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5月20日	-	8	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、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长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》、《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

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,“去杠杆”成为主导A股市场运行的关键因素。在非市场因素的扰动下,A股买卖双方力量对比发生变化,由流动性危机带来的恐慌性卖出暂告一段落,市场的暴涨暴跌得到缓解。但进入8月中旬后,由于人民币汇率定价机制调整带来的短期人民币大幅贬值,使得市场再度急剧下跌,市场权益类产品净值普遍出现较大回调。安信优势增长在整个三季度以防御为主,考虑到A股处于非正常的运行区间,加上外部美联储加息延期预期,我们主要进行现金管理的操作,以保护净值,获取绝对投资收益为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.029元,本报告期份额净值增长率为1.38%,同期业绩比较基准增长率为-13.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期看,稳增长的微刺激措施在不断推出,物价同比增速回落使得影响货币宽松的因素在削弱,利好消息在集聚,在投资者过度悲观预期下,市场存在过往矫正下的短期投资机会。从中长期看,汇率波动对重新进入了存量资金博弈的A股市场影响关键。因此在货币政策维持宽松原则下,稳定汇率的关键因素应该寄希望于由改革开放激发的市场活力,但当前改革开放的推进不会一步到位。因此,我们认为产能出清,结构调整将带来较长时间的阵痛期,看好具备真成长、符合转型方向的好公司。操作上以现金管理为主,获取绝对收益。

4.6 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,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

§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	7,124,079.90	1.57
	其中:股票	7,124,079.90	1.57
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	446,154,676.38	98.05
8	其他资产	1,728,348.55	0.38
9	合计	455,007,104.83	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,124,079.90	1.57
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	-	-
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	7,124,079.90	1.57

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	600900	长江电力	857,290	7,124,079.90	1.57

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
本基金的股指期货投资,以风险对冲、套期保值为主要目的,以控制股票投资组合的系统性风险。套期保值主要选择流动性好、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股票现货资产进行匹配,在投资授权审批流程完成后进行股指期货套期保值投资,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(元)
1	存出保证金	644,184.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,081,181.55
5	应收申购款	2,982.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,728,348.55

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	7,124,079.90	1.57	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	12,069,191,138.26
报告期期间基金总申购份额	6,112,406.32
减:报告期期间基金总赎回份额	11,635,561,554.82
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	439,741,989.76

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 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《安信优势增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。

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莲花街道益田路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
2015年10月26日

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:2015年10月26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2015年10月23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2015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	
交易代码	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	294,083,067.01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,预测利率和政策变化趋势,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,依照内外评级结果,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	
下属分级基金的基金简称	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
下属分级基金的交易代码	000310	000335
报告期末下属分级基金的份额总额	207,766,752.10份	86,316,314.91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(2015年7月1日-2015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	3,681,265.04	1,418,194.68
2. 本期利润	2,917,796.38	1,103,309.21
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0128
4. 期末基金资产净值	242,342,104.68	99,905,501.62
5. 期末基金份额净值	1.166	1.157

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	1.22%	0.37%	0.67%	0.01%	0.55%	0.36%

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	1.05%	0.38%	0.67%	0.01%	0.38%