安信宝利债券型证券投资基金（LOF）

【2016】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：2016年4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2016年4月20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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信宝利（LOF）
场内简称	安信宝利（LOF）
交易代码	167501
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013年7月24日
报告期末基金份额总额	2,323,107,781.35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。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本产品属于中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险水平和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
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（2016年1月1日 - 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	31,473,352.15
2.本期利润	28,338,366.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0153
4.期末基金资产净值	2,441,965,003.54
5.期末基金份额净值	1.051

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	1.45%	0.06%	0.31%	0.07%	1.14%	-0.01%

注：业绩比较基准收益率＝中债综合指数。

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、本基金的建仓期为2013年7月24日至2014年1月23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。

2、本基金基金合同生效日为2013年7月24日。图示日期为2013年7月24日至2016年3月31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		
庄园	本基金的基金经理	2013年7月24日	-	12	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、安信安盈保本混合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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度，总体来看，债券市场继续走出了牛市行情，央行继续维持宽松的货币政策，债市资金供给增多，债券配置需求持续上升，收益率小幅下行，信用利差持续缩窄，处于历史较低水平，5年AA的企业债收益率处于4.5%以下水平。另外，美联储加息预期减弱，人民币汇率稳定，以及外围宽松的货币政策，均对债券构成利好因素，债市做多热情依旧。但3月下旬始，经济基本面数据和金融数据均持续好转，引发市场经济企稳预期，谨慎情绪上升。另外，监管层摸底债市杠杆、供给压力增大、信用风险爆发以及股市反弹等均对债市形成不利影响，利率债期限利差扩大，10年国债收益率上升至2.9%以上，信用债收益率处于盘整局面。但考虑到经济中的风险偏好仍难以快速升高，资金对债券的配置压力仍较大。

一季度安信宝利基金维持了较高的杠杆，在维持组合总体久期的前提下，着重增加了中长期利率债和同业存单的哑铃型配置。信用债方面精选个券，严格控制风险，根据规模变化增加了公司债的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，本基金份额净值为1.051元，本报告期份额净值增长率为1.45%，同期业绩比较基准增长率为0.31%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,722,061,798.01	93.79
	其中：债券	3,722,061,798.01	93.79
	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	20,000,150.00	0.50
	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	119,287,581.87	3.01
8	其他资产	107,199,683.94	2.70
9	合计	3,968,549,213.82	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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

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

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	2,234,116.50	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,168,000.00	8.98
	其中：政策性金融债	219,168,000.00	8.98
4	企业债券	2,558,782,208.81	104.78
5	企业短期融资券	70,560,000.00	2.89
6	中期票据	230,157,500.00	9.43
7	可转债（可交换债）	10,941,972.70	0.45
8	同业存单	630,218,000.00	25.81
9	其他	-	-
10	合计	3,722,061,798.01	152.42

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	111610015	16兴业CD015	2,400,000	238,248,000.00	9.76
2	122392	15恒大02	2,000,000	207,780,000.00	8.51
3	111691548	16南京银行CD026	2,000,000	194,180,000.00	7.95
4	101569028	15泛海MTN001	1,300,000	133,549,000.00	5.47
5	122366	14武钢债	1,200,000	123,360,000.00	5.05

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,662.74
2	应收证券清算款	21,539,201.48
3	应收股利	-
4	应收利息	70,925,705.16
5	应收申购款	176,573.57
6	其他应收款	14,523,540.99
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,199,683.94

5.10.4 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。

5.10.5 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

报告期期初基金份额总额	1,741,475,728.39
报告期期间基金总申购份额	829,238,123.58
减：报告期期间基金总赎回份额	247,606,070.62
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	2,323,107,781.35

注：申购含红利再投份额。

§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宝利债券型证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》；

3、《安信宝利分级债券型证券投资基金托管协议》；

4、《安信宝利分级债券型证券投资基金招募说明书》；

5、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》；

6、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
2016年4月22日

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2016】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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2016年4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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月20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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信灵活配置混合
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	50,775,261.87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（2016年1月1日 - 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	-20,368,717.05
2.本期利润	-18,307,405.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3178
4.期末基金资产净值	76,805,635.58
5.期末基金份额净值	1.513

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。

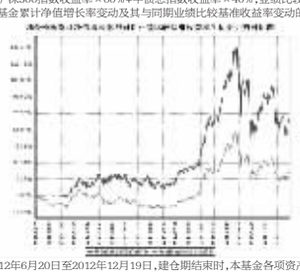
3.2 基金净值表现

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	-13.54%	2.18%	-8.00%	1.46%	-5.54%	0.72%

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2016年3月31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		
占冠良	本基金基金经理，研究部总经理兼基金投资部总经理	2015年12月1日	-	15	占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理兼基金投资部总经理。现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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度，A股市场整体大跌，1月份暴跌而2、3月份震荡回升。灵活配置基金在一季度的投资，总体上偏积极，基于开年初的低仓位以及市场暴跌后的风险释放，灵活配置基金适当的有所加仓，加上有资金的赎回影响，股票仓位基本保持中偏上的水平。风格上，一季度的A股市场有所轮动，泛涨价主题表现优异，主要集中于传统的煤炭、钢铁、有色、化工等行业。灵活配置基金的组合结构跟随市场也有所调整变化，组合以自下而上的个股投资、成长股投资为主，期间也曾在组合结构上有所调整切换至泛涨价主题，但效果并不理想，季度后期仍主要集中于中小创个股，涉及多个未来具有巨大发展空间的新兴产业主题。从收益结果来看，报告期内灵活配置基金受大盘影响，仍出现一定的亏损。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，本基金份额净值为1.513元，本报告期份额净值增长率为-13.54%，同期业绩比较基准增长率为-8.00%。

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	姓名	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资		57,626,655.60	67.99
	其中：股票		57,626,655.60	67.99
2	基金投资		-	-
3	固定收益投资		5,628,811.03	6.64
	其中：债券		5,628,811.03	6.64
	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		12,500,000.00	14.75
	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		3,534,988.07	4.17
8	其他资产		5,473,155.56	6.46
9	合计		84,763,610.26	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	1,213,000.00	1.58
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,061,345.60	46.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,870.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,435,140.00	1.87
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	15,368,340.00	20.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,694,500.00	3.51
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	361,190.00	0.47
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	447,270.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	57,626,655.60	75.03

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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

代码	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	002230	科大讯飞	115,000	3,728,300.00	4.85
2	600872	中炬高新	285,000	3,702,150.00	4.82
3	002007	华兰生物	67,000	2,974,130.00	3.87
4	300207	欣旺达	100,000	2,632,000.00	3.43
5	300367	东方网力	76,000	2,320,280.00	3.02
6	002292	奥飞动漫	53,000	2,157,630.00	2.81
7	002271	东方雨虹	125,000	2,111,250.00	2.75
8	300017	网宿科技	36,000	2,102,760.00	2.74
9	002668	奥马电器	24,000	1,664,400.00	2.17
10	000920	南方汇通	90,000	1,604,700.00	2.09

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	3,011,505.00	3.92
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）	2,617,306.03	3.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,628,811.03	7.33

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	110031	航信转债	18,710	2,429,306.40	3.16
2	019518	15国债18	20,100	2,011,005.00	2.62
3	019509	15国债09	10,000	1,000,500.00	1.30
4	132005	15国资EB	810	87,852.60	0.11
5	110033	国贸转债	540	61,149.60	0.08

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。

5.10.3 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除“欣旺达（300207）”在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形外，其它投资的证券均未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。

根据2015年7月14日公告，该公司控股股东及一致行动人王明旺、王威、新余市欣明达投资有限公司（以下简称“欣明达”）分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（深证调查通字15087、15088、15089号）。因公司控股股东王明旺及一致行动人欣明达涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对王明旺、王威、欣明达进行立案调查。

根据该公司2015年11月12日的公告，公司控股股东王明旺先生于2015年11月11日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《行政处罚决定书》（（2015）50号）根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十三条第二款、第二百零四条的规定，证监会决定：

一、责令王明旺改正违法行为，在收到行政处罚决定书之日起3日内对超比例减持情况进行报告和公告，并就超比例减持行为公开致歉。

二、对王明旺超比例减持未披露及在限制转让期限内的减持行为予以警告。

三、对王明旺超比例减持未披露行为处以40万元罚款，对王明旺在限制转让期限内的减持行为处以1170万元罚款，对王明旺合计罚款1210万元。

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	64,633.49
2	应收证券清算款	5,350,261.94
3	应收股利	-
4	应收利息	57,175.06
5	应收申购款	1,085.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,473,155.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	2,429,306.40	3.16

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	002230	科大讯飞	3,728,300.00	4.85	重大事项
2	000920	南方汇通	1,604,700.00	2.09	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	84,595,293.31
报告期期间基金总申购份额	14,168,764.22
减：报告期期间基金总赎回份额	47,988,796.66
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	50,775,261.87

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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,668,367.35
报告期期间买入/申购总份额	-
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	5,668,367.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	11.16

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。

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
2016年4月22日

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

【2016】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：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2016年4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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月20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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信动态策略混合
交易代码	001185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
报告期末基金份额总额	231,282,580.32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、低风险获利投资、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，合理利用权证等做备保或套利投资；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	上海浦东发展银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	安信动态策略A	安信动态策略C
下属分级基金的交易代码	001185	002029
报告期末下属分级基金的份额总额	231,282,580.32份	0.00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（2016年1月1日 - 2016年3月31日）	
	安信动态策略A	安信动态策略C
1. 本期已实现收益	3,215,371.65	2,510,164.46
2. 本期利润	3,449,216.57	-3,486,852.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0145	-0.0074
4. 期末基金资产净值	244,472,217.71	-
5. 期末基金份额净值	1.057	-

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

安信动态策略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	1.44%	0.10%	1.08%	0.02%	0.36%	0.08%

安信动态策略C

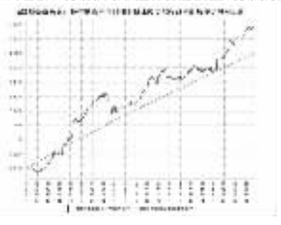
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.08%	0.40%	0.01%	-0.50%	0.07%

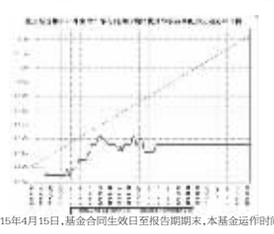
注：1、业绩比较基准收益率=1年期人民币定期存款基准利率+3.00%

2、本基金自2015年11月17日起增加C类份额，并于2016年2月2日C类份额被赎空，C类份额的报告期间为2015年11月17日至2016年2月2日。

3、业绩比较基准收益率=（1+成立日至报告期末的收益率）/（1+成立日至报告期初的收益率）-1

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4月15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4月15日至2016年3月31日。

2、本基的建仓期为2015年4月15日至2015年10月14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。

3、本基金自2015年11月18日起增加C类份额并于2016年2月2日C类份额被赎空。A