

安信永鑫定期开放债券型证券投资基金

【2017】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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。
本报告自2017年1月13日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金
交易代码	000607
基金运作方式	定期开放运作
基金合同生效日	2017年1月13日
报告期末基金份额总额	314,314,472.03份
投资目标	为管理好本基金资产并实现预期的投资目标,并兼顾对资产流动性的要求,本基金主要投资于固定收益类资产,包括国债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场基金等,在法律法规允许的范围内,可适度参与股票资产投资,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。在资产配置上,本基金将根据宏观经济形势、政策取向、市场利率、发行主体资质及信用评级等因素,综合判断债券市场利率走势,确定债券组合久期,并在此基础上,采取买入并持有策略,持有到期,获取稳定的利息收入。在个券选择上,本基金将采取自下而上的策略,通过信用分析、流动性分析、估值分析等方法,精选具有较高性价比的个券进行投资。在风险控制上,本基金将严格控制信用风险,通过分散投资、信用评级等方式,降低组合的信用风险。同时,本基金还将严格控制流动性风险,通过分散投资、流动性分析等方式,降低组合的流动性风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:中债总指数(全价)收益率
风险收益特征	本基金为固定收益基金,其预期收益水平低于股票型基金,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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	安信永鑫定期开放债券A
下属分级基金的交易代码	000608
报告期末下属分级基金的份额总额	192,701,485.22份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年1月13日至2017年3月31日)	安信永鑫定期开放债券A	安信永鑫定期开放债券C
1.本期已实现收益	478,509.81	1,384,344.01	-
2.本期利润	288,399.06	1,084,044.00	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004	0.0003	-
4.期末基金资产净值	63,000,474.28	263,897,235.71	-
5.期末基金份额净值	1.0000	1.0001	-

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(不含公允价值变动损益)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.本基金于2017年1月13日成立,截至2017年3月31日成立未满一季。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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

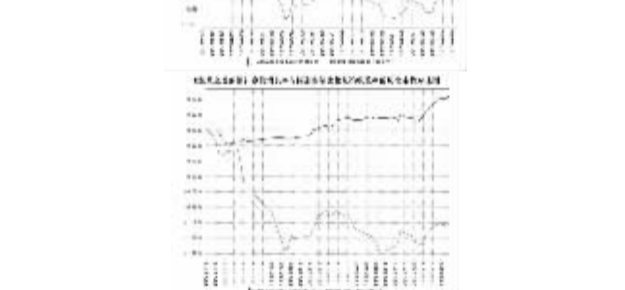
安信永鑫定期开放债券A

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
基金合同生效以来	0.04%	0.04%	-1.19%	0.11%	1.67%	-0.07%

安信永鑫定期开放债券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
基金合同生效以来	0.47%	0.04%	-1.10%	0.11%	1.62%	-0.07%

注:本基金的业绩比较基准:中债总指数(全价)收益率。
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



注:1.本基金的建仓期为2017年1月13日至2017年7月12日,截至报告期末基金尚未完成建仓。
2.本基金合同生效日为2017年1月13日,图示日期为2017年1月13日至2017年3月31日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
张翼飞	本基金基金经理	2017年1月13日	6年	张翼飞先生,经济学硕士,历任中航证券、上海证券、招商证券等证券公司研究员,2014年加入安信基金管理有限责任公司,曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部副经理、安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。2017年1月13日起担任安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金经理。张翼飞先生具有基金从业资格,并具备中国证监会规定的基金从业资格。

注:1.此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司公告(生效)日期填写。
2.证券从业年限计算标准参照行业协会《证券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 管理人报告期内基金运作的合规情况说明

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、监管部门的有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前提下,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的利益。

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《证券投资基金管理人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,公平对待所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
报告期内本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度初,市场处于去年12月债灾之后的反弹过程中,我们当时认为债市虽然已经明显好转,但仍存在一些担忧,例如通胀依旧、MPA考核、债灾之后银行表外的抛压等。所以适当配置了比较少的长债,主要集中在国债的持有和一年以内的短期国债。总的说来,在本报告期内,保持了中短久、中高评级、中高性价比和流动性较好的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年03月31日,本基金A类份额净值为1.0048元,本报告期份额净值增长率为0.48%,同期业绩比较基准增长率为-1.19%。截至2017年03月31日,本基金C类份额净值为1.0043元,本报告期份额净值增长率为0.45%,同期业绩比较基准增长率为-1.19%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满20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

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:2017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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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。
本报告自2017年1月13日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	安信—中证一级债
场内简称	安信一级
交易代码	367603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月14日
报告期末基金份额总额	2,220,023,262.05份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证一级债主题指数,在正市场环境下,力争获取与市场基准相近的收益率,并超越市场基准的收益率(扣除基金费用后)达到0.50%以上,并超越业绩比较基准0.50%以上。
投资策略	投资策略上,本基金主要采用完全复制的方法进行投资,跟踪标的指数的数量及结构构建基金资产组合,并跟踪标的指数的变动进行动态调整。在资产配置上,本基金将主要投资于中证一级债主题指数成份股及备选成份股,并适当参与非成份股、债券、货币市场基金等投资,以分散投资风险,提高基金资产的流动性。在风险控制上,本基金将严格控制信用风险,通过分散投资、信用评级等方式,降低组合的信用风险。同时,本基金还将严格控制流动性风险,通过分散投资、流动性分析等方式,降低组合的流动性风险。
业绩比较基准	中证一级债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相一致。
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
下属分级基金的基金简称	安信—中证一级A
下属分级基金的交易代码	367602
报告期末下属分级基金的份额总额	941,686,514.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-3,361,364.79
2.本期利润	682,614.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0003
4.期末基金资产净值	1,052,083,040.41
5.期末基金份额净值	0.821

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(不含公允价值变动损益)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.本基金净值表现
3.2.1 本报告期末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
过去六个月	7.23%	0.72%	7.78%	0.77%	-0.64%	-0.05%

注:业绩比较基准收益率为中证一级债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)
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2015年5月14日至2015年11月13日,建仓期结束后,本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	477,271,042.68	90.98
4	其中:债券	476,271,042.68	90.66
5	资产支持证券	2,000,000.00	0.41
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产-回购协议	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	8,474,022.71	1.72
11	其他资产	6,474,586.23	1.32
12	合计	492,215,733.62	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境内股票。

5.3.1 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。

5.4 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。

5.5 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	国债	-	-
2	金融债	-	-
3	企业债	30,350,000.00	0.54
4	其中:政策性金融债	30,350,000.00	0.54
5	企业债	126,914,560.00	40.17
6	公司债	64,914,500.00	20.55
7	中期票据	9,512,000.00	2.14
8	资产支持证券	400,000.00	0.16
9	银行存款	282,980,000.00	79.91
10	合计	476,271,042.68	90.66

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	11171052	17国债02	600,000	58,044,000.00	15.27
2	11171030	17国债01	300,000	58,044,000.00	15.27
2	11171705	17光大银行	500,000	49,106,000.00	16.49
3	160207	16国债07	500,000	49,106,000.00	16.49
4	11171050	16国债05	300,000	30,350,000.00	9.67
5	11171050	17广发银行	300,000	29,022,000.00	9.19

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140209	信托140A1	20,000	2,000,000.00	0.63

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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。

5.10.1 本期国债逆回购交易情况说明
本基金尚未在基金合同中明确国债逆回购的投资策略,比例限制,信息披露等,本基金暂不参与国债逆回购交易。

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
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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
报告期内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事先入库再买。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,040.33
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	6,429,762.89
6	其他资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,474,586.23

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

项目	安信永鑫定期开放债券A	安信永鑫定期开放债券C
基金合同生效以来(2017年1月13日至2017年3月31日)基金份额总额	42,701,485.22	261,813,186.81
报告期期初基金份额总额	-	-
报告期期间基金总申购份额	-	-
基金合同生效以来基金总申购份额	-	-
基金合同生效以来基金总赎回份额	-	-
基金合同生效以来基金总赎回份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期末基金份额总额	42,701,485.22	261,813,186.81

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。

7.1 基金份额持有人持有基金份额变动情况
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,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

投资者类别	序号	持有基金份额比例(%)	期初份额	期末份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年3月31日	200,000,000.00	-	200,000,000.00	63.59%
个人	-	-	-	-	-	-

注:1.此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司公告(生效)日期填写。
2.证券从业年限计算标准参照行业协会《证券从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员的范围。

4.2 管理人报告期内基金运作的合规情况说明
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、监管部门的有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前提下,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的利益。

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《证券投资基金管理人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,公平对待所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
报告期内本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
一季度初,市场处于去年12月债灾之后的反弹过程中,我们当时认为债市虽然已经明显好转,但仍存在一些担忧,例如通胀依旧、MPA考核、债灾之后银行表外的抛压等。所以适当配置了比较少的长债,主要集中在国债的持有和一年以内的短期国债。总的说来,在本报告期内,保持了中短久、中高评级、中高性价比和流动性较好的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2017年03月31日,本基金A类份额净值为1.0048元,本报告期份额净值增长率为0.48%,同期业绩比较基准增长率为-1.19%。截至2017年03月31日,本基金C类份额净值为1.0043元,本报告期份额净值增长率为0.45%,同期业绩比较基准增长率为-1.19%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满20人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

安信基金管理有限责任公司
地址: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
客户服务热线:4008-088-088
网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2017年4月22日

安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

【2017】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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2017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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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。
本报告自2017年1月13日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	安信优势增长混合
交易代码	001097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月10日
报告期末基金份额总额	11,497,488.78份
投资目标	本基金将以严谨稳健的选股和基金资产配置,通过自上而下和自下而上相结合,把握投资机会,追求基金资产的长期增值,力争实现基金资产的持续增值。
投资策略	资产配置方面,通过基本面分析、宏观经济、行业景气度、估值水平、市场情绪等多种因素,对宏观经济、行业景气度、估值水平、市场情绪等多种因素进行综合分析,确定资产配置比例。在个股选择上,本基金将采取自下而上的策略,通过信用分析、流动性分析、估值分析等方法,精选具有较高性价比的个券进行投资。在风险控制上,本基金将严格控制信用风险,通过分散投资、信用评级等方式,降低组合的信用风险。同时,本基金还将严格控制流动性风险,通过分散投资、流动性分析等方式,降低组合的流动性风险。
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	本基金属于股票基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相一致。
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
下属分级基金的基金简称	安信优势增长混合A
下属分级基金的交易代码	001097
报告期末下属分级基金的份额总额	11,497,488.78份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

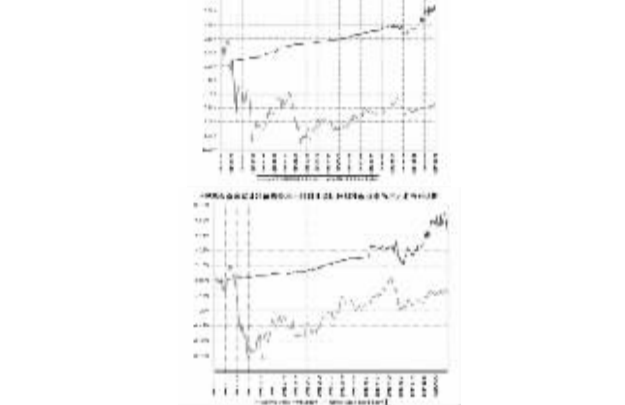
主要财务指标	报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)
1.本期已实现收益	734,568.83
2.本期利润	620,369.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004
4.期末基金资产净值	12,029,020.74
5.期末基金份额净值	1.1301

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(不含公允价值变动损益)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 本报告期末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
过去六个月	4.26%	0.02%	2.13%	0.26%	2.22%	0.26%

注: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%。
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2015年5月20日至2015年11月19日,建仓期结束后,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。
2.本基金合同生效日为2015年5月20日,图示日期为2015年5月20日至2017年3月31日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
周世林	本基金基金经理	2016年2月18日	9	周世林先生,经济学硕士,历任中航证券、招商证券等证券公司研究员,2014年加入安信基金管理有限责任公司,曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部副经理、安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。