安信鑫发优选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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信鑫发优选混合
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	60,162,003.39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债券基准的绝对回报。
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,动态运用个股精选、低风险套利投资、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,合理利用权证等做套保或套利投资;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	广发银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-748,261.31
2.本期利润	1,775,056.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0276
4.期末基金资产净值	71,226,480.01
5.期末基金份额净值	1.184

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。

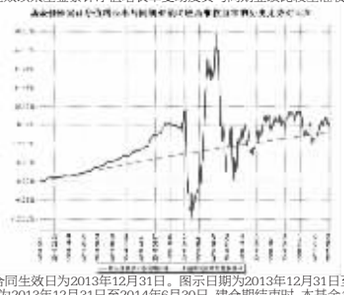
3.2 基金净值表现

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	2.26%	0.76%	1.11%	0.01%	1.14%	0.75%

注: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%。

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2013年12月31日。图示日期为2013年12月31日至2017年3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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2013年12月31日	-	10	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,现任权益投资部基金经理。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,安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;现任安信新常态沪港深精选股票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 管理人对投资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

2017年一季度,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,但仍存在一些隐忧,例如美联储加息、MPA考核、债灾之后银行委外的撤回等。所以适当减持了长债,增配了短债。总的来说,在本报告期内,维持了中等久期、中高评级、中高杠杆获取利差的配置策略。

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1.184元,本报告期份额净值增长率为2.25%,同期业绩比较基准增长率为1.11%。

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	67,407,699.09	93.66
	其中:股票	67,407,699.09	93.66
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	4,358,806.87	6.06
8	其他资产	205,993.65	0.29
9	合计	71,972,499.61	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,185,192.79	48.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,840,550.00	6.80
E	建筑业	16,022.26	0.02
F	批发和零售业	2,441,862.63	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	3,343,759.24	4.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,197,505.70	3.09
J	金融业	9,924,304.47	13.93
K	房地产业	10,434,844.96	14.65
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	23,657.04	0.03
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	67,407,699.09	94.64

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

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	600048	保利地产	438,516	4,179,057.48	5.87
2	601965	中国汽研	408,313	4,168,875.73	5.85
3	600079	人福医药	203,900	4,024,989.00	5.65
4	600340	华夏幸福	142,898	3,895,399.48	5.47
5	600562	国睿科技	115,872	3,678,936.00	5.17
6	600879	航天电子	206,314	3,653,820.94	5.13
7	601336	新华保险	81,600	3,442,704.00	4.83
8	601818	光大银行	826,765	3,398,004.15	4.77
9	601006	大秦铁路	439,300	3,325,501.00	4.67
10	600885	宏发股份	87,400	3,174,368.00	4.46

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	147,865.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,161.21
5	应收申购款	56,966.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,993.65

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	66,601,337.78
报告期期间基金总申购份额	2,612,779.33
减:报告期期间基金总赎回份额	9,052,113.72
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	60,162,003.39

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,本基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信鑫发优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
2017年4月22日

安信永丰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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信永丰定开债券	
交易代码	003273	
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。 本基金的封闭期为基金合同生效日起(包括该日)或日每一开放期结束之日次日起(包括该日)3个月的期间。第一个封闭期为自本基金基金合同生效日起(包括该日)3个月的期间。第二个封闭期为自首个开放期结束之日次日起(包括该日)3个月的期间,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。	
基金合同生效日	2016年10月10日	
报告期末基金份额总额	670,735,709.94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,力争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,在组合久期配置上,本基金将遵守投资组合久期与封闭期适当匹配的原则,确定投资组合的久期配置。在品种配置上,合理配置并调整国债、央票、金融债、企业债、公司债等不同债券类属券种在投资组合中的构成比例。在信用投资上,采取内外部评级结合的方法,建立信用债券的研究库和投资库,并进行动态调整和维护,适时调整投资组合。此外,本基金还将投资于可转换债券、资产支持证券和国债期货等。 开放期内,本基金将主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的组合流动性,减小基金净值的波动。	
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	安信永丰定开债券A	安信永丰定开债券C
下属分级基金的交易代码	003273	003274
报告期末下属分级基金的份额总额	528,481,033.03份	142,254,676.91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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	安信永丰定开债券A	安信永丰定开债券C
1. 本期已实现收益	90,101.13	-89,532.91
2. 本期利润	816,356.10	168,407.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0015	0.0011
4. 期末基金资产净值	521,967,704.79	140,350,577.12
5. 期末基金份额净值	0.9877	0.9866

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

安信永丰定开债券A

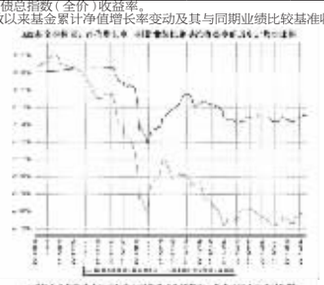
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.06%	0.06%	-1.45%	0.10%	1.51%	-0.04%

安信永丰定开债券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	0.00%	0.06%	-1.45%	0.10%	1.45%	-0.04%

注: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2016年10月10日至2017年04月09日,截至报告期末基金尚未完成建仓。

2、本基金基金合同生效日为2016年10月10日。图示日期为2016年10月10日至2017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		
杨凯炜	本基金的基金经理,固定收益部总经理	2016年10月10日	-	11	杨凯炜先生,台湾大学土木工程学,新竹交通大学管理学硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员,台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员,台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员,台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾至泰人寿保险股份有限公司科长,华南永大基金管理有限公司固定收益部总经理,安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信安鑫保本混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理职理。安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理。现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信永鑫定期开放债券型证券投资基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
陆芳瑞	本基金的基金经理	2017年2月17日	-	12	陆芳瑞女士,经济学,理学学士,2005年至2008年在中国光大银行股份有限公司深圳分行任资金部交易员,2008年-2010年在中国银行股份有限公司总行任金融市场总部投资经理,自2010年9月加入安信基金管理有限责任公司。曾任固定收益部投资经理。现任固定收益部基金经理。现任安信永丰定期开放债券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

2017年一季度债市继续调整,不过跌幅较去年四季度明显缩小。以国开债为例,2017年一季度1年期和10年期品种分别上行37BP和38BP,曲线平坦化上行。

趋势来看,一季度的下跌主要归在1月,2月和3月以震荡为主。受货币政策转向稳健中性,MLF利率、OMO利率上调超预期冲击,10年国开从年初开始一路上行,最终在2月7日达到4.19%的短期高点。尔后,公开市场再现净投放,TLF等传言带动下,投资者对货币政策的悲观预期有所修正,国债期货大涨带动现券小幅回落,160213在2月下旬回落到4.04%左右的位置。进入3月后,市场情绪转弱10年国开再度碰到4.2%的高位。不过冲高的时间并不长,在2月CPI大幅低于预期、房地产调控升级等利好刺激下,现券再度小幅回落。

一季度5年AA+中票信用利差上行20BP,AA级上行4BP。与去年四季度相比,信用利差上行的幅度缩窄的更加明显。

趋势来看,信用利差的扩大主要集中在1月中旬至2月上旬。2月下旬至今,信用利差震荡略微下行。整体来看,信用利差小幅扩大,信用债依然表现为熊市越熊。至于一季度信用利差调整幅度大幅缩窄,应与信用债收益率已经较接近贷款利率有关。

资金面方面,我们觉得紧缩预期难消。一方面货币政策转向,宽松周期结束。另一方面在金融去杠杆的大背景下,MPA监管从严,CD纳入同业负债,整个银行系统监管升级,对流动性也会造成一定影响。同时经济继续探底。我们觉得债市一季度可能是震荡行情,建议维持低杠杆,低久期,并择机进行利率债波段操作。

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0.9877元,本报告期份额净值增长率为0.06%,同期业绩比较基准增长率为-1.45%。截至2017年03月31日,本基金C类份额净值为0.9866元,本报告期份额净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准增长率为-1.45%。

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	784,964,645.38	95.36
	其中:债券	784,964,645.38	95.36
	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	27,781,889.39	3.38
8	其他资产	10,380,738.15	1.26
9	合计	823,127,272.92	100.00

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 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。

5.3.1 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	393,539,669.20	59.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	127,056,000.00	19.18
7	可转债(可交换债)	23,214,976.18	3.51
8	同业存单	241,155,000.00	36.41
9	其他	-	-
10	合计	784,964,645.38	118.52

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	111681045	16杭州银行CD192	1,000,000	95,950,000.00	14.49
2	112283	15西部02	500,000	49,565,000.00	7.48
3	112475	16万丰01	500,000	49,550,000.00	7.48
4	112479	16珠海债	500,000	49,360,000.00	7.45
5	136857	16国内01	500,000	49,000,000.00	7.40

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 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	23,325.37
2	应收证券清算款	968,895.66
3	应收股利	-
4	应收利息	9,388,517.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,380,738.15

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	113010	江南转债	7,984,376.40	1.21
2	110033	国贸转债	5,974,170.90	0.90
3	113009	广汽转债	2,422,000.00	0.37
4	127003	海印转债	2,133,000.00	0.32
5	120001	16比亚转债	1,844,322.00	0.28
6	110030	格力转债	1,612,200.00	0.24
7	128010	顺昌转债	1,165,900.00	0.18
8	113012	骆驼转债	78,996.88	0.01

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	626,634,279.68	173,289,264.72
报告期期间基金总申购份额	51,491.26	-
减:报告期期间基金总赎回份额	98,204,737.91	31,034,587.81
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	528,481,033.03	142,254,676.91

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,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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永丰定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《安信永丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《安信永丰定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、《安信永丰定期开放债券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
2017年4月22日

安信永利信用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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017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	207,740,745.62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,预测利率和收益率的变动,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,依据内外评级结果,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	185,052,301.02份	22,688,444.60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(2017年1月1日 - 2017年3月31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	1,427,911.01	148,933.95
2. 本期利润	1,520,505.89	160,097.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0082	0.0071
4. 期末基金资产净值	198,657,328.49	23,985,434.98
5. 期末基金份额净值	1.074	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

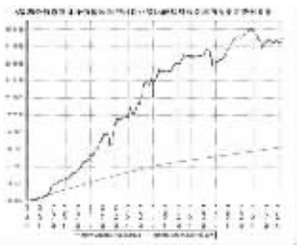
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.85%	0.10%	0.55%	0.01%	0.30%	0.09%

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	0.67%	0.10%	0.55%	0.01%	0.12%	0.09%

注:业绩比较基准=1.5×1年期银行定期存款基准利率。

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2013年11月8日至2014年5月7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11月8日。图示日期为2013年11月8日至2017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		
张翼飞	本基金的基金经理	2016年3月14日	-	6.5	张翼飞先生,经济学硕士。历任摩根机机(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员,泰旦易隆高科实业有限公司财务总监,日晶暴蓝云科国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任安信