安信活期宝货币市场基金

【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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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	安信活期宝	
交易代码	003402	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月17日	
报告期末基金份额总额	395,700,941.36份	
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。	
投资策略	资产配置方面,本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析,形成对宏观层面的判研。同时,通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比。在个券方面,本基金将首先考虑安全性因素,优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
下属分级基金的交易代码	003402	004167
报告期末下属分级基金的份额总额	13,413,074.92份	382,287,866.44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)	
	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
1. 本期已实现收益	49,571.66	2,118,731.60
2. 本期利润	49,571.66	2,118,731.60
3. 期末基金资产净值	13,413,074.92	382,287,866.44

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信活期宝货币A

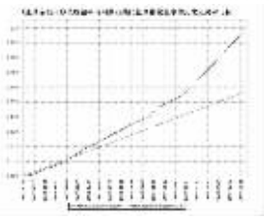
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7247%	0.0029%	0.3329%	0.0000%	0.3918%	0.0029%

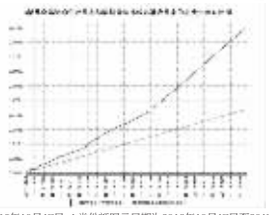
安信活期宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7852%	0.0028%	0.3329%	0.0000%	0.4523%	0.0028%

注:1.业绩比较基准收益率=七天通知存款税后利率;
2.本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2016年10月17日,A类份额图示日期为2016年10月17日至2017年3月31日;
2.本基金的建仓期为2016年10月17日至2017年4月16日,本基金目前仍然处于建仓期;
3.本基金自2016年12月22日起增加B类份额,B类份额的报告期间为2016年12月22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		
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016年10月17日	-	11	杨凯玮先生,台湾大学土木工程学,新竹交通大学管理学双硕士。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,台湾玉泰人寿保险股份有限公司科长,华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信永丰定期开放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、安信元宝增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。

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年一季度经济运行稳定,央行保持稳健中性的货币政策,持续实行金融去杠杆,资金面长期呈现紧平衡。债券市场短端收益率保持高位,尤其存单相比同期限利率债和短融等信用债具有较高配置价值。

本货币基金在今年一季度将大部分到期资产配置收益较高且资质优秀的短期资产,并且合理调整组合期限和资产到期,保持了充裕的流动性。

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1.0000元,本报告期份额净值增长率为0.7247%,同期业绩比较基准增长率为0.3329%。截至2017年03月31日,本基金C类份额净值为1.0000元,本报告期份额净值增长率为0.7852%,同期业绩比较基准增长率为0.3329%。

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	固定收益投资	391,662,703.62	87.86
	其中:债券	391,662,703.62	87.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	53,460,629.97	11.99
4	其他资产	673,187.16	0.15
5	合计	445,796,520.75	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.33	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	49,799,605.30	12.59
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
本基金本报告期未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	8.44	12.59
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	76.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	27.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.49	12.59

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本基金本报告期未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,456,723.40	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,892,803.62	10.08
	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	同业存单	347,313,176.60	87.77
8	其他	-	-
9	合计	391,662,703.62	98.98
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111797138	17宁波银行CD030	500,000	49,738,398.58	12.57
2	111712029	17北京银行CD029	500,000	49,735,860.01	12.57
3	111710088	17兴业银行CD088	500,000	49,695,348.01	12.56
4	111714058	17江苏银行CD058	500,000	49,694,559.23	12.56
5	111719035	17恒丰银行CD035	500,000	49,143,374.53	12.42
6	170203	17国开03	200,000	19,992,342.42	5.05
7	160217	16国开17	200,000	19,900,461.20	5.03
8	111792491	17广州农村商业银行CD022	200,000	19,645,918.68	4.96
9	111692414	16广州农村商业银行CD049	100,000	9,985,307.87	2.52
10	111794405	17邯郸银行CD040	100,000	9,970,710.88	2.52

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

序号	偏离情况	
	报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	
	报告期内偏离度的最高值	
	报告期内偏离度的最低值	
	报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本基金本报告期未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2
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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	763.10
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	672,424.06
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	673,187.16

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
报告期期初基金份额总额	16,519,583.07	47,074,995.56
报告期期间基金总申购份额	34,112,668.16	386,699,809.58
报告期期间基金总赎回份额	37,219,076.31	51,486,938.70
报告期末基金份额总额	13,413,074.92	382,287,866.44

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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年2月14日-2017年3月31日	-	301,465,824.49	-	301,465,824.49	76.19%
	2	2017年1月1日-2017年2月13日	20,272,870.70	67,239,713.24	16,700,000.00	70,812,583.94	17.90%
个人	1	2017年1月1日-2017年2月8日	20,001,585.72	51,527.58	20,053,113.30	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:
(1)基金在短时间内无法变现足够的资产不以应对,可能会产生基金合位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
(2)基金管理人被迫触售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会核准安信活期宝货币市场基金募集的文件;
2.《安信活期宝货币市场基金基金合同》;
3.《安信活期宝货币市场基金托管协议》;
4.《安信活期宝货币市场基金招募说明书》;
5.中国证监会要求的其他文件。

9.2 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

9.3 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

安信稳健增值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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	安信稳健增值混合	
交易代码	001316	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月25日	
报告期末基金份额总额	736,444,977.21份	
投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提,结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘,动态灵活调整投资策略,力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	资产配置方面,通过宏观基本面定性和定量研究,结合政策因素、市场情绪与估值因素等对比分析大类资产风险收益比,合理分配各大类资产配置比例;固定收益类投资方面,在自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略;股票投资上,秉承价值投资理念,高度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司;此外,本基金在理财用股指期货、国债期货、权证等衍生工具做套保或套利投资,对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略,实现基金资产增值增厚。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的金融机构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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
下属分级基金的交易代码	001316	001338
报告期末下属分级基金的份额总额	308,877,359.46份	427,567,617.75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)	
	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
1. 本期已实现收益	2,995,596.34	2,506,999.33
2. 本期利润	5,809,387.40	6,853,559.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0158
4. 期末基金资产净值	343,662,175.97	487,007,535.30
5. 期末基金份额净值	1.1126	1.1390

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

安信稳健增值混合A

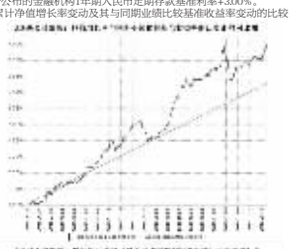
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.79%	0.08%	1.11%	0.01%	0.68%	0.07%

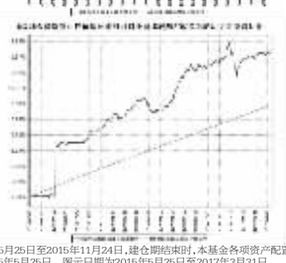
安信稳健增值混合C

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	1.42%	0.07%	1.11%	0.01%	0.31%	0.06%

注:业绩比较基准=中国人民银行公布的金融机构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.本基金的建仓期为2015年5月25日至2015年11月24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2015年5月25日。图示日期为2015年5月25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	2015年5月25日	-	6.5	张翼飞先生,经济学硕士。历任摩根机(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海证券有限责任公司投资理财部投资发展处研究员,秦皇岛耀隆高科实业有限公司财务总监,日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、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的基金经理助理,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。

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

股票方面,我们坚持了价值投资的理念,以盈利稳定增长、估值合理、分红收益高的大盘蓝筹股为主要投资标的,主要通过深入研究追踪公司的基本面,不断的优化配置组合。期间主要配置了汽车、家电、银行、基建、消费医药等行业,同时,为了维持收益的稳定增长,股票方面保持了较低的仓位。

债券方面,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。所以配置了小部分仓位的长债,大部分仓位用于配置回业存单和1年以内的短期债券。总的来说,在本报告期内,维持了中短久期、中高评级、中等杠杆的配置策略。

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1.1126元,本报告期份额净值增长率为1.79%,同期业绩比较基准增长率为1.11%。截至2017年03月31日,本基金C类份额净值为1.1390元,本报告期份额净值增长率为1.42%,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	65,293,543.56	6.00
	其中:股票	65,293,543.56	6.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,005,445,058.92	92.45
	其中:债券	1,005,445,058.92	92.45
	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	4,373,125.72	0.40
8	其他资产	12,453,081.83	1.15
9	合计	1,087,564,810.03	100.00

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

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	23,309,839.75	2.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,981,000.00	0.48
E	建筑业	2,832,970.92	0.34
F	批发和零售业	1,534,638.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	5,553,034.89	0.67
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	26,310,500.00	3.17
K	房地产业	1,771,560.00	0.21
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	65,293,543.56	7.95

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

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	601988	中国银行	2,610,000	9,657,000.00	1.16
2	600741	华域汽车	402,922	7,337,209.62	0.88
3	601318	中国平安	150,000	5,551,500.00	0.67
4	601398	工商银行	1,000,000	4,840,000.00	0.58
5	600660	福耀玻璃	200,000	4,522,000.00	0.54
6	601009	南京银行	350,000	4,207,000.00	0.51
7	600900	长江电力	300,000	3,981,000.00	0.48
8	601633	长城汽车	300,000	3,774,000.00	0.45
9	601012	隆基股份	200,100	3,165,582.00	0.38
10	600009	上海机场	100,000	2,998,000.00	0.36

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	17,041,528.60	2.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,884,000.00	4.80
	其中:政策性金融债	39,884,000.00	4.80
4	企业债券	111,869,161.80	13.47
5	企业短期融资券	354,659,500.00	42.70
6	中期票据	185,002,000.00	22.27
7	可转债(可交换债)	4,998,868.52	0.60
8	同业存单	291,990,000.00	35.15
9	其他	-	-
10	合计	1,005,445,058.92	121.04

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	111707036	17招商银行CD036	1,500,000	146,880,000.00	17.68
2	101664003	16中电路桥MTN001	600,000	58,050,000.00	6.99
3	111792694	17南京银行CD024	600,000	58,044,000.00	6.99
4	011698210	16苏美达SCP001	500,000	50,130,000.00	6.03
5	011698516	16云能投SCP006	500,000	49,955,000.00	6.01

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股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金在进行股指期货投资时,以风险对冲、套期保值为主要目的,将选择流动性好、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现货资产进行严格匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,实现基金资产增值保值。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现所资产的长期稳定增值。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1
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。

5.12.2
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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	90,281.68
2	应收证券清算款	251,588.22
3	应收股利	-
4	应收利息	12,034,251.65
5	应收申购款	76,960.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,453,081.83

5.12.4 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。

5.12.5 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

项目	安信稳健增值混合A	安信稳健增值混合C
报告期期初基金份额总额	265,878,049.72	435,322,623.97
报告期期间基金总申购份额	233,010,935.71	89,460,344.16
减:报告期期间基金总赎回份额	190,011,625.97	97,215,350.38
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	308,877,359.46	427,567,617.75

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 影响投资者决策的其他重要信息

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日-2017年3月31日	-	181,092,901.12	-	181,092,901.12	24.59%
	2	2017年2月15日-2017年3月31日	134,048,257.37	88,479,915.06	-	222,528,172.43	30.22%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:
(1)基金在短时间内无法变现足够的资产不以应对,可能会产生基金合位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
(2)基金管理人被迫触售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.