安信保证金交易型货币市场基金

【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: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	安信货币
场内简称	安信货币
交易代码	511680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月9日
报告期末基金份额总额	6,884,918.04份
投资目标	在力争保持基金资产相对低风险和相对高流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	久期配置上,本基金根据对未来利率变动的合理预判,结合基金未来现金流的综合预期,动态决定和调整投资组合平均剩余期限。类属配置上,通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断,来确定并动态调整投资组合国债、央行票据、债券回购、非金融企业债务融资工具及现金等各类属品种的配置比例。个券选择上,优先选择高信用等级的流动性好的债券品种,并对低估值品种进行重点关注。此外,本基金还会采用套利策略、回购策略、流动性管理策略,在保持高流动性的基础上,把握无风险套利机会,获取安全的超额收益。
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	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(2017年1月1日 - 2017年3月31日?)
1.本期已实现收益	7,585,011.00
2. 本期利润	7,585,011.0077
3. 期末基金资产净值	688,491,799.89

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。

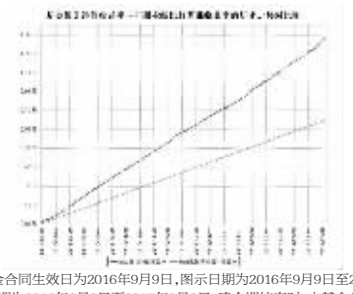
3.2 基金净值表现

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

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	0.6281%	0.0028%	0.3329%	0.0000%	0.2952%	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9月9日,图示日期为2016年9月9日至2017年3月31日;
2、本基金的建仓期为2016年9月9日至2017年3月8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。

§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9月9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信托股份有限公司基金经理。台湾宏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。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。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新规惠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年一季度宏观经济保持L型态势发展,货币政策首次采用"稳健中性"的表达方式。央行上调了OMO、MLF、SLF操作利率,并实现了净回笼2300亿。同时,3月季末MPA考核将表外理财纳入广义信贷进行考核,使得市场资金利率有较明显上升。

由于考虑到春节因素和MPA考核对流动性的冲击,本货币基金在一季度的投资策略更加谨慎。在保持较好的流动性满足客户的需求的同时,本基金预留了在资金紧张、收益率上行的时点性机会进行配置空间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年03月31日,本基金份额净值为1.0000元,本报告期份额净值增长率为0.6281%,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	337,001,076.91	48.90
	其中:债券	307,001,076.91	44.54
	资产支持证券	30,000,000.00	4.35
2	买入返售金融资产	239,891,154.73	34.81
	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	107,175,075.66	15.55
4	其他资产	5,127,808.30	0.74
5	合计	689,195,115.60	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		1.31
	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	-	-
	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

本基金本报告期末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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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	69.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.39	-
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)	4.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		94.99	-

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	87,044,519.82	12.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,245,539.67	4.39
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,031,432.84	5.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	149,679,584.58	21.74
8	其他	-	-
9	合计	307,001,076.91	44.59
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,245,539.67	4.39

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	019539	16国债11	870,280	87,044,519.82	12.64
2	111714014	17江苏银行CD014	500,000	49,929,606.02	7.25
3	041656013	16青国投CP002	400,000	40,031,432.84	5.81
4	130242	13国开42	300,000	30,245,539.67	4.39
5	111720025	17广发银行CD025	300,000	29,982,405.54	4.35
6	111699000	16合肥科技农村商行CD027	300,000	29,932,255.81	4.35
7	111684110	16福建海峡银行CD025	200,000	19,884,557.07	2.89
8	111611272	16平安CD272	100,000	9,986,978.21	1.45
9	111608241	16中信CD241	100,000	9,963,781.93	1.45

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	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	0.0697%
报告期内偏离度的最低值	-0.2243%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0742%

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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)?	占基金资产净值比例(%)
1	142333	花呗11优先级	300,000.00	30,000,000.00	4.36

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	23,969.23
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,103,849.07
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,127,808.30

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	14,919,966.17
报告期期间基金总申购份额	5,385,949.09
报告期期间基金总赎回份额	13,420,997.22
报告期期末基金份额总额	6,884,918.04

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

无。

§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保证金交易型货币市场基金募集的文件;
2、《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》;
3、《安信保证金交易型货币市场基金托管协议》;
4、《安信保证金交易型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

安信动态策略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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	368,957,182.88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	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、低风险套利投资、事件驱动等策略,挖掘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	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	350,141,560.46份	18,815,622.42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)	
	安信动态策略A	安信动态策略C
1. 本期已实现收益	6,091,343.73	689,607.95
2. 本期利润	10,672,611.59	1,225,568.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0283	0.0303
4. 期末基金资产净值	387,785,555.27	20,783,484.19
5. 期末基金份额净值	1.1075	1.1046

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、本基金自2015年11月17日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月17日至2017年3月31日。

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

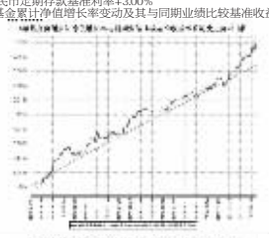
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.55%	0.13%	1.11%	0.01%	1.44%	0.12%

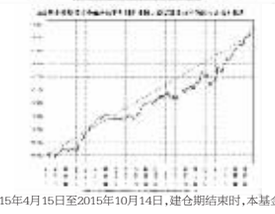
安信动态策略C

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	2.56%	0.13%	1.11%	0.01%	1.45%	0.12%

注:业绩比较基准=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。
2、本基金基金合同生效日为2015年4月15日。图示日期为2015年4月15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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015年4月15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、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,在去年四季度的惯性和今年初地产、基建投资带动下,经济出现较大幅度回暖,工业企业利润增速有所抬升,上游行业特别是煤炭开采、黑色金属、石油开采等行业利润增幅较大。然而在当期整体盈利好转的同时,市场对盈利改善的持续性存疑,同时上游涨价对中游利润的侵蚀并未得到扭转,经济的好转或许仅是结构性的,一季度A股行业指数涨幅出现较大分化,盈利增长确定性较高的家电、食品饮料涨幅居前,而估值和盈利增长预期存压的计算机等行业表现较弱,整体市场风格偏向稳定消费板块。

期间,安信动态策略基金遵循绝对收益原则,动态调整权益投资头寸,主要持有业绩稳健、估值较低的金融、地产蓝筹股为主,同时参与低风险新股投资,配置高等级优质债券,缩短组合久期,取得了较好的投资业绩。

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1.1075元,本报告期份额净值增长率为2.55%,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1.1046元,本报告期份额净值增长率为2.56%,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	132,418,765.36	31.10
	其中:股票	132,418,765.36	31.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	256,560,997.44	60.26
	其中:债券	256,560,997.44	60.26
	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	15,000,000.00	3.52
	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	19,870,794.59	4.67
8	其他资产	1,907,025.99	0.45
9	合计	425,757,583.38	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	43,044,838.85	10.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,054,909.00	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,273,731.60	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,177,250.00	1.27
J	金融业	34,513,725.21	8.45
K	房地产业	32,615,432.68	7.98
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	5,738,878.02	1.40
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	132,418,765.36	32.41

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	001979	招商蛇口	540,100	9,505,760.00	2.33
2	600048	保利地产	897,200	8,550,316.00	2.09
3	601398	工商银行	1,587,700	7,684,468.00	1.88
4	000423	东阿阿胶	108,704	7,130,982.40	1.75
5	000963	华东医药	72,000	6,670,800.00	1.63
6	601318	中国平安	168,200	6,225,082.00	1.52
7	601288	农业银行	1,756,700	5,867,378.00	1.44
8	000069	华侨城A	779,747	5,692,153.10	1.39
9	002236	大华股份	336,100	5,367,517.00	1.31
10	002230	科大讯飞	147,500	5,177,250.00	1.27

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	78,572,000.00	19.23
	其中:政策性金融债	78,572,000.00	19.23
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)	582,997.44	0.14
8	同业存单	177,406,000.00	43.42
9	其他	-	-
10	合计	256,560,997.44	62.80

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	111717046	17光大银行CD046	800,000	79,096,000.00	19.36
2	111708062	17中信银行CD062	500,000	49,440,000.00	12.10
3	111610658	16兴业CD658	500,000	48,870,000.00	11.96
4	160212	16国开12	300,000	29,940,000.00	7.33
5	160208	16国开08	300,000	29,358,000.00	7.19

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

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

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。

5.11.2 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。

5.12 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	87,008.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,718,025.64
5	应收申购款	101,992.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,907,025.99

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	安信动态策略A	安信动态策略C
报告期期初基金份额总额	407,852,052.47	66,164,107.27
报告期期间基金总申购份额	479,118.06	-
减:报告期期间基金总赎回份额	58,189,610.07	47,348,484.85
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	350,141,560.46	18,815,622.42

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	140,976,503.76	-	-	140,976,503.76	38.21%
	2	2017年2月15日-2017年3月31日	93,544,434.05	-	-	93,544,434.05	25.35%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							

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予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,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份额的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)基金管理人被迫抛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动态策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《安信动态策略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。

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

安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

【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	安信沪深300增强	
交易代码	003261	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2016年10月12日	
报告期末基金份额总额	12,287,224.56份	
投资目标	本基金为增强型指数基金,在力求有效跟踪标的指数,控制本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的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%的基础上,结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。	
投资策略	股票投资上,本基金作为增强型的指数基金,一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数,另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。债券投资上,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期及债券资产配置。股指期货投资上,本基金以套期保值为目的,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,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。资产支持证券投资上,对部分高质量的资产支持证券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	95%*沪深300指数收益率+1.5%*指年收益率,评价时按期间折算)。	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期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。	
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