安信活期宝货币市场基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:2018 年 01 月 20 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 2018 年 1 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信活期宝	
基金主代码	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	2,785,838,965.60 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,本基金将百先考虑安全性因素,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 A	安信活期宝 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	1,093,932,857.54 份	1,691,906,108.06 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 10 月 01 日 - 2017 年 12 月 31 日)	
	安信活期宝 A	安信活期宝 B
1.本期已实现收益	10,525,380.68	17,431,473.36
2.本期利润	10,525,380.68	17,431,473.36
3.期末基金资产净值	1,093,932,857.54	1,691,906,108.06

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。

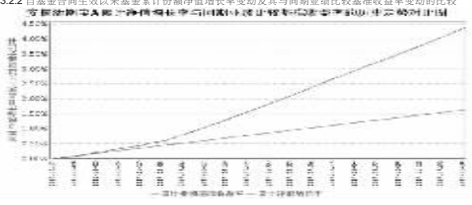
3.2 基金净值表现

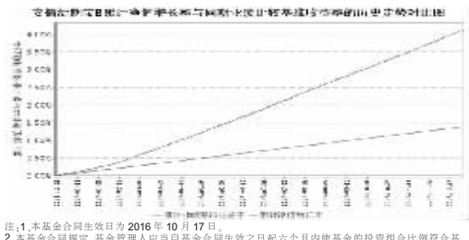
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信活期宝 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	1.0955%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.7552%	0.0014%
安信活期宝 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	1.0994%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.7591%	0.0014%

注: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份额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.本基金合同生效日为 2016 年 10 月 17 日。

2.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.本基金自 2016 年 12 月 22 日起增加 B 类份额。

§ 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年	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总经理。曾任安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理;现任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、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年 6 月 6 日	-	6年	肖芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016 年 4 月 5 日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理,现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信永泰定期开放债券型发起式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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年四季度,国外经济持续回暖,国内经济韧性仍存,投资增速小幅下滑,出口保持高位,消费基本平稳,人民币稳中有升。央行公开市场跟随美联储加息,货币政策稳健偏紧;金融监管征求意见陆出台,显示了去杠杆政策的定力和决心。整个四季度,shibor 不断上涨,债券市场收益率普遍上行,货币市场价格中枢也不断上行。在保证流动性的前提下,本基金结合时点配置和波段操作,获得了较好的收益率,并为 2018 年配置了收益率较好的基础资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安信活期宝货币 A 的基金份额净值收益率为 1.0955%,本报告期安信活期宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0994%,同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,713,696,131.06	93.94
	其中:债券	2,713,696,131.06	93.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	149,220,195.33	5.17
	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	8,413,642.85	0.29
4	其他资产	17,500,081.70	0.61
5	合计	2,888,830,050.94	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		7.80
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	100,799,648.80	3.62
	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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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	16.04	3.62
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60 天	22.85	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.60	-
3	60天(含)—90 天	55.90	-
	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)	8.27	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.07	3.62

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	2,999,406.03	0.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	289,834,619.47	10.40
	其中:政策性金融债	289,834,619.47	10.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,200,365.65	2.52
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,350,661,739.91	84.38
8	其他	-	-
9	合计	2,713,696,131.06	97.41
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	100,310,201.94	3.60

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	160305	16进出 05	1,000,000	100,310,201.94	3.60
2	170410	17农发 10	1,000,000	99,729,951.02	3.58
3	111709405	17浦发银行 CD405	1,000,000	99,650,896.63	3.58
4	111708394	17中信银行 CD394	1,000,000	99,320,063.49	3.57
5	111789407	17厦门国际银行 CD231	1,000,000	99,301,882.47	3.56
6	111716270	17上海银行 CD270	1,000,000	99,197,191.98	3.56
7	111709480	17浦发银行 CD480	1,000,000	99,149,688.68	3.56
8	111707287	17招商银行 CD287	1,000,000	99,141,387.46	3.56
9	111708417	17中信银行 CD417	1,000,000	99,132,753.85	3.56
10	111709483	17浦发银行 CD483	1,000,000	99,132,753.85	3.56

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0685%
报告期内偏离度的最低值	-0.1309%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0491%

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(人民币元)
1	存出保证金	374.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,936,315.37
4	应收申购款	11,563,392.28
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	17,500,081.70

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信活期宝 A	安信活期宝 B
报告期期初基金份额总额	962,085,669.99	1,554,400,929.38
报告期期间基金总申购份额	1,997,263,031.03	1,085,116,150.19
减:报告期期间基金总赎回份额	1,865,415,843.48	947,610,971.51
报告期期末基金份额总额	1,093,932,857.54	1,691,906,108.06

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20171001-20171123	505,985,620.08	5,533,272.32	510,573,624.59	945,267.81	0.03	
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据财政部、国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016] 36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税[2016] 46 号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税[2016] 70 号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016] 140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017] 2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017] 56 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017] 90 号)等相关税收规定,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

安信基金管理有限责任公司将执行相关增值税政策,自 2018 年 1 月 1 日起,对公司旗下资管产品(含公开募集证券投资基金及特定客户资产管理计划)运营过程中产生的增值税及附加税费在委托财产中计提,并按照现行规定缴纳。由于增值税及附加税费将直接从委托财产中扣缴,因此将导致资管产品税费支出增加、净值和实际收益率降低,从而影响投资者的收益水平。敬请投资者关注投资风险并审慎作出投资决策。

上述事项已于 2017 年 12 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及安信基金管理有限责任公司官方网站披露。

§ 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

本基金管理人和基金托管人的住所。

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
2018 年 01 月 20 日

安信消费医药主题股票型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:2018 年 01 月 20 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 2018 年 1 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信消费医药股票
基金主代码	000974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 03 月 19 日
报告期末基金份额总额	1,681,014,607.13 份
投资目标	通过投资于消费与医药行业中的优质上市公司,分享其发展和成长机会,力争获取超越业绩比较基准的中长期收益。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标,同时结合定量分析的方法,对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,调整原则和调整范围。本基金的股票资产主要投资于价值型股票,坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上,分析基础利率的走势,研究利率期限结构和中长期收益率走势,在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率× 90%+上证国债指数收益率× 10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金,属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 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 10 月 01 日 - 2017 年 12 月 31 日)	
	安信消费医药主题股票型证券投资基金 A	安信消费医药主题股票型证券投资基金 B
1.本期已实现收益	31,830,565.90	128,581,899.39
2.本期利润	128,581,899.39	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0915	
4.期末基金资产净值	2,622,781,688.13	
5.期末基金份额净值	1.560	

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。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	7.36%	0.97%	1.93%	0.69%	5.43%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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.本基金合同生效日为 2015 年 3 月 19 日。

2.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例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		
陈一峰	本基金的基金经理,总经理助理兼研究总监	2016年 3 月 14 日	-	9年	陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。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;现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年四季度,国外经济持续回暖,国内经济韧性仍存,投资增速小幅下滑,出口保持高位,消费基本平稳,人民币稳中有升。央行公开市场跟随美联储加息,货币政策稳健偏紧;金融监管征求意见陆出台,显示了去杠杆政策的定力和决心。整个四季度,shibor 不断上涨,债券市场收益率普遍上行,货币市场价格中枢也不断上行。本基金结合时点配置和波段操作,获得了较好的收益率,在保证流动性的前提下,为 2018 年配置了部分收益率较好的基础资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.560 元;本报告期基金份额净值增长率为 7.36%,业绩比较基准收益率为 1.93%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,389,064,140.19	86.28
	其中:股票	2,389,064,140.19	86.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,159,592.38	0.04
	其中:债券	1,159,592.38	0.04
	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	100,000,000.00	3.61
	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	266,337,516.92	9.62
8	其他资产	12,356,197.05	0.45
9	合计	2,768,917,446.54	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	6,063,415.94	0.23
C	制造业	1,620,091,086.01	61.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,181,176.00	2.14
E	建筑业	154,771,154.45	5.90
F	批发和零售业	182,687,839.90	6.97
G	交通运输、仓储和邮政业	61,033,390.19	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	190,833,230.17	7.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	68,768,381.44	2.62
M	科学研究和技术服务业	2,642,076.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
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	45,925,954.34	1.75
S	综合	-	-
	合计	2,389,064,140.19	91.09

5.2.2 报告期末按行业分类的港股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	600566	济川药业	3,947,708	150,605,060.20	5.74
2	600201	生物股份	4,244,703	134,726,873.22	5.14
3	600612	老凤祥	3,075,409	126,583,834.44	4.83
4	002202	金风科技	5,456,772	102,860,152.20	3.92
5	600887	伊利股份	3,128,916	100,719,806.04	3.84
6	000963	华东医药	1,746,084	94,079,005.92	3.59
7	603589	口子窖	1,917,221	88,288,027.05	3.37
8	600068	葛洲坝	10,222,214	83,822,154.80	3.20
9	601328	交通银行	13,290,217	82,532,247.57	3.15
10	002027	分众传媒	4,884,118	68,768,381.44	2.62

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	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)	1,159,592.38	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,159,592.38	0.04

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	128029	太阳转债	11,596	1,159,592.38	0.04

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

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除分众传媒(002027),本期没有出现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。

分众传媒信息技术股份有限公司(下称分众传媒,股票代码:002027)于 2017 年 6 月 8 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局下发的《关于对分众传媒信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》([2017]14 号),分众传媒存在以下违法违规事项:1)部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整,2015 年年报信息披露存在遗漏;2)未在股东大会授权范围内购买银行理财产品。

根据《证券法》第一百七十九条、《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定,证监会广东监管局对分众传媒予以警示;请分众传媒认真吸取教训,切实加强对证券法律法规的学习,不断完善内部控制,依法履行信息披露义务,杜绝此类问题再次发生。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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(人民币元)
1	存出保证金	627,700.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,062.45
5	应收申购款	11,671,434.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,356,197.05

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,107,073,261.13
报告期期间基金总申购份额	1,260,991,601.97
减:报告期期间基金总赎回份额	687,050,255.97
报告期期末基金份额总额	1,681,014,607.13

§ 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,基金管理人未持有本基金份额。

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据财政部、国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016] 36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税[2016] 46 号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税[2016] 70 号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016] 140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017] 2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通