安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	安信鑫发优选混合
基金主代码	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	37,307,305.45 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业绩基准的绝对回报。
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,灵活运用个股精选、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 10 月 01 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	414,273.34
2.本期利润	- 778,233.73
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.0197
4.期末基金资产净值	47,166,667.26
5.期末基金份额净值	1.264

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;

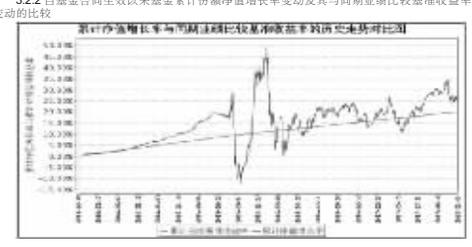
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	- 1.79%	0.90%	1.13%	0.02%	- 2.92%	0.88%

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、本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 31 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		
蓝蕾书	本基金的基金经理	2013年 12 月 31 日	-	11年	蓝蕾书先生,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、管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、安信动态策略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、安信工业 4.0 主题沪港深精选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,十九大报告中对社会主要矛盾的新表述,经济总量增长目标被弱化,市场对经济增速未来预期相对谨慎,叠加利率上行,期间上证指数、深证指数、中小板综指、创业板综指都录得负收益,市场资金更愿意往食品饮料、家电、医药等偏防守的消费行业集中,周期类的有色金属、化工等跌幅较大。

期间,安信鑫发优选基金以低估值金融地产为底仓,沿着资本开支扩张路径配置部分优质工业机械标的,同时配置少量受益于海外经济复苏的相关品种,这些行业标的配置贡献了正收益。虽然我们降低了保险、军工持仓权重,但持有的保险、军工品种对组合净值仍然有拖累。

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 1.264 元;本报告期基金份额净值增长率为 -1.79%,业绩比较基准收益率为 1.13%。

4.5 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,本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,时间范围为 2017 年 11 月 23 日至 2017 年 12 月 31 日。

§ 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	41,004,576.06	86.34
	其中:股票	41,004,576.06	86.34
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	6,324,388.80	13.32
8	其他资产	160,929.81	0.34
9	合计	47,489,894.67	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	29,587,697.36	62.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	709,236.00	1.50
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	5,897,347.70	12.50
K	房地产业	3,795,740.00	8.05
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	1,014,555.00	2.15
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	41,004,576.06	86.94

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	000513	丽珠集团	40,034	2,660,259.30	5.64
2	002534	杭钢股份	216,000	2,337,120.00	4.96
3	000546	金圆股份	129,188	2,306,005.80	4.89
4	002444	巨星科技	154,302	2,133,996.66	4.52
5	601398	工商银行	320,400	1,986,480.00	4.21
6	300415	伊之密	113,800	1,967,602.00	4.17
7	601155	新城控股	65,800	1,927,940.00	4.09
8	601965	中国汽研	228,240	1,912,651.20	4.06
9	600048	保利地产	132,000	1,867,800.00	3.96
10	600487	亨通光电	45,800	1,851,236.00	3.92

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

本基金投资的前十名证券的发行主体,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。

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	153,829.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,781.58
5	应收申购款	5,318.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,929.81

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	43,312,585.68
报告期期间基金总申购份额	670,037.89
减:报告期期间基金总赎回份额	6,675,318.12
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	37,307,305.45

§ 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 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。

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

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 06 月 20 日
报告期末基金份额总额	86,254,538.48 份
投资目标	灵活运用多种投资策略,深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果, 力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的模式,在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上, 以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	60%× 沪深 300 指数收益率 +40%× 中债总指数收益率
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司

§ 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)
1.本期已实现收益	3,154,054.23
2.本期利润	- 2,545,124.35
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.0275
4.期末基金资产净值	96,384,941.32
5.期末基金份额净值	1.117

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。

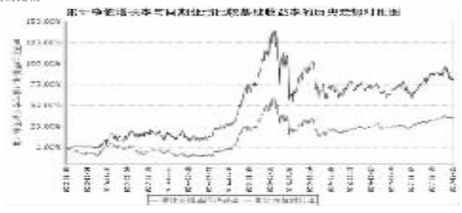
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	- 3.12%	1.14%	2.47%	0.48%	- 5.59%	0.66%

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、本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 20 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		
占冠良	本基金的基金经理,研究部总经理	2015 年 12 月 1 日	-	16年	占冠良先生,管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员,大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理,南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现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。
张竞	本基金的基金经理,权益投资部总经理	2017 年 12 月 29 日	-	10年	张竞先生,南开大学金融学硕士,具有 10 年证券投资研究经验。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员、安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理。安信基金筹备组研究部研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。现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。

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

四季度,A 股市场先扬后抑,结构分化依旧。经济表现韧性,十九大前后的维稳以及会议相对经济政策信号等支持,市场情绪相对转暖。然而年末因素令投资者求稳心态较重,缺乏投资积极性,而继续追捧保险、银行、食品饮料、家电等白马板块,周期板块受冷遇,半导体、5G 等体现国家主导创新发展的主题板块也一度表现抢眼。其后,钢铁引领周期于季度中期有强劲表现,然而面临采暖季限产严厉以及环保压制导致对经济的阶段性担忧,以及高利率环境下的经济中期增长的疑虑,加上政策强调的继续加强金融监管,使得市场在持续上行后拐头向下,周期股、次新股、中小创持续大跌,白酒、家电、金融等资产在小幅调整之后继续受机构投资者抱团而上行。

在基金的投资管理上,由于对市场面临特殊岁末时点的运行特征预期不足,基于周期行业的强劲的产品价格和业绩预期而在钢铁、造纸等周期领域配置较重,相反对于前期已经大幅上涨的白马行业配置较低,四季度基金业绩表现一般。

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 1.117 元;本报告期基金份额净值增长率为 -3.12%,业绩比较基准收益率为 2.47%。

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	73,050,392.63	72.18
	其中:股票	73,050,392.63	72.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,160,654.90	8.06
	其中:债券	8,160,654.90	8.06
	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	13,000,000.00	12.85
	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	6,812,960.83	6.73
8	其他资产	181,751.73	0.18
9	合计	101,205,760.09	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	2,407,498.00	2.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	56,630,749.63	58.75
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	3,862,839.00	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,431,240.00	2.52
J	金融业	6,753,586.00	7.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	964,480.00	1.00
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	73,050,392.63	75.79

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	600581	八一钢铁	355,100	4,850,666.00	5.03
2	600036	招商银行	133,300	3,868,366.00	4.01
3	000786	北新建材	129,900	2,922,750.00	3.03
4	002024	苏宁云商	236,100	2,901,669.00	3.01
5	002142	宁波银行	162,000	2,885,220.00	2.99
6	600406	国电南瑞	133,000	2,431,240.00	2.52
7	002078	太阳纸业	260,600	2,418,368.00	2.51
8	000830	鲁西化工	151,500	2,411,880.00	2.50
9	000338	潍柴动力	288,000	2,401,920.00	2.49
10	300308	中际旭创	41,000	2,398,500.00	2.49

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	4,992,500.00	5.18
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)	3,168,154.90	3.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,160,654.90	8.47

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	019563	17国债 09	50,000	4,992,500.00	5.18
2	128016	雨虹转债	14,190	1,618,795.20	1.68
3	110034	九州转债	11,420	1,248,320.20	1.30
4	113014	林洋转债	1,600	189,088.00	0.20
5	113011	光大转债	540	56,359.80	0.06

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(人民币元)
1	存出保证金	49,770.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	115,275.54
5	应收申购款	16,705.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,751.73

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	1,248,320.20	1.30
2	113011	光大转债	56,359.80	0.06

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	100,018,346.76
报告期期间基金总申购份额	631,694.72
减:报告期期间基金总赎回份额	14,395,503.00
报告期期末基金份额总额	86,254,538.48

§ 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 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- 20171231;	66,049,537.65	-	-	66,049,537.65	76.58
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策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信策略精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。

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

安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

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:广发银行股份有限公司
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