

安信安盈保本混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 24 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 2016 年 10 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信安盈保本混合
交易代码	002308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 9 日
报告期末基金份额总额	1,718,298,967.79 份
投资目标	在保证投资者本金的基础上，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金运用恒定比例组合保险（CPPI）原理，动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，通过对固定收益类资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对权益类资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。固定收益投资方面，本基金通过对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，综合考虑各种市场因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。权益资产投资方面，本基金在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资。
业绩比较基准	两年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种，其预期风险和预期

	收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金保证人	中合中小企业融资担保股份有限公司

§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（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	11,640,458.65
2. 本期利润	24,629,711.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0140
4. 期末基金资产净值	1,781,624,412.31
5. 期末基金份额净值	1.037

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

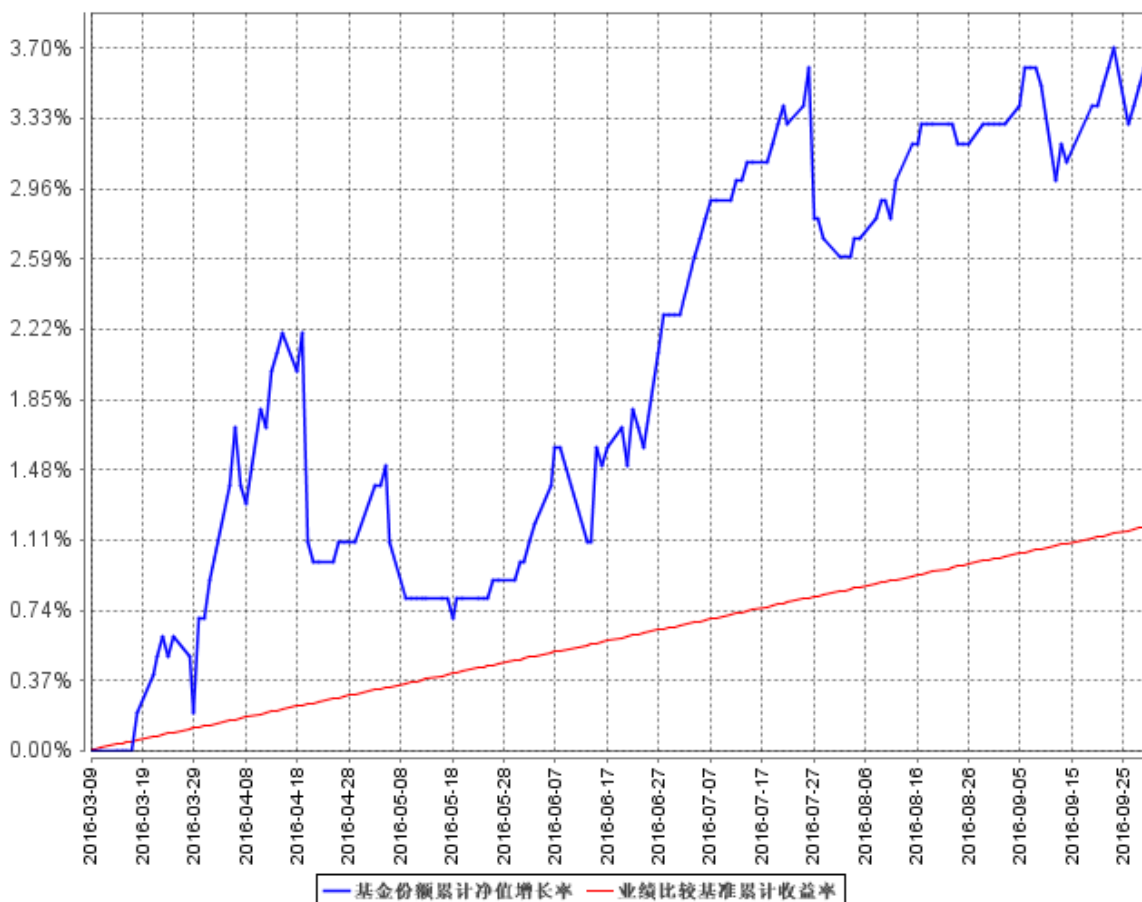
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.37%	0.16%	0.53%	0.01%	0.84%	0.15%

注：业绩比较基准收益率=2年期银行定期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 3 月 9 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 9 月 30 日。

2、本基金的建仓期为 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 9 月 9 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		
庄园	本基金的基金经理	2016 年 3 月 9 日	-	12	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资

					部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012 年 5 月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016 年 3 月 10 日	-	10	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、安信安盈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

进入三季度，宏观经济方面先抑后扬，7 月经济金融数据全面低于预期，展现出通胀较低、增长乏力的态势，8、9 月，过剩产能供给侧改革初见成效，商品价格上涨，实体经济迎来一小轮向上波动；但纵观国内外经济，内需外需仍然疲弱，新的增长点难觅，供给侧改革可持续性存疑，国内经济持续回暖并走稳的概率不大。同时由于外汇市场维稳需求，央行坚持不降准，超储率出现明显下降，资金面波动剧烈。另外，实体投资疲弱，债券市场配置力量源源不断，资产荒贯穿三季度。

在此背景下，由于本基金在三季度之前完成债券资产配置，三季度债券投资方面主要维持原有持仓，进行了小规模的仓位跟踪调整；股票方面，本基金通过量化选股模型，利用行业优选、个股优选和策略转换机制来优选个股、调整行业；通过分散行业和个股的投资来控制股票部位的个股风险；此外，三季度本基金还进行了热点行业跟踪、精选个股投资以博取超额收益，并通过新股申购增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.037 元，本报告期份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准增长率为 0.53%。

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	229,748,453.70	9.29
	其中：股票	229,748,453.70	9.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,182,555,712.56	88.26
	其中：债券	2,182,555,712.56	88.26
	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	-	-
	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	28,518,190.74	1.15
8	其他资产	32,016,669.84	1.29
9	合计	2,472,839,026.84	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	4,651,898.40	0.26
C	制造业	214,600,556.04	12.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	218,985.90	0.01
F	批发和零售业	6,668,808.33	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,592,650.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	601,167.09	0.03
J	金融业	177,223.18	0.01
K	房地产业	-	-
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	1,237,164.76	0.07
S	综合	-	-
	合计	229,748,453.70	12.90

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	603688	石英股份	354,734	7,194,005.52	0.40
2	300301	长方集团	794,940	6,836,484.00	0.38
3	002134	天津普林	489,596	6,682,985.40	0.38
4	002149	西部材料	185,700	6,386,223.00	0.36
5	002578	闽发铝业	543,000	6,097,890.00	0.34
6	300127	银河磁体	292,200	6,054,384.00	0.34
7	600213	亚星客车	418,900	6,040,538.00	0.34
8	000100	TCL 集团	1,739,900	5,950,458.00	0.33
9	002680	长生生物	306,800	5,936,580.00	0.33
10	002403	爱仕达	394,100	5,927,264.00	0.33

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	432,677,000.00	24.29
	其中：政策性金融债	382,022,000.00	21.44
4	企业债券	551,770,585.06	30.97
5	企业短期融资券	815,580,000.00	45.78
6	中期票据	295,121,000.00	16.56
7	可转债（可交换债）	215,127.50	0.01
8	同业存单	87,192,000.00	4.89

9	其他	-	-
10	合计	2,182,555,712.56	122.50

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	011699928	16 奇瑞 SCP003	1,000,000	100,720,000.00	5.65
2	120227	12 国开 27	1,000,000	100,600,000.00	5.65
3	160210	16 国开 10	1,000,000	100,390,000.00	5.63
4	111690289	16 九台农村商业银行 CD006	900,000	87,192,000.00	4.89
5	101662012	16 经纬纺织 MTN001	800,000	81,304,000.00	4.56

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

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金以套期保值为目的，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，有效管理投资组合的系统性风险，积极改善组合的风险收益特征。

本基金通过对宏观经济和股票市场走势的分析与判断，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的股指期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、

展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

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	449,578.60
2	应收证券清算款	113,295.34
3	应收股利	-
4	应收利息	31,352,921.72
5	应收申购款	100,874.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,016,669.84

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000100	TCL 集团	5,950,458.00	0.33	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,788,964,151.99
报告期期间基金总申购份额	5,409,785.47
减：报告期期间基金总赎回份额	76,074,969.67
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	1,718,298,967.79

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，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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信安盈保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信安盈保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信安盈保本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
2016 年 10 月 24 日