

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2016 年第 4 季度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 21 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 2017 年 1 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 10 月 12 日(基金合同生效日)起至 12 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	12,043,152.21 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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003261	003262
报告期末下属分级基金的份额总额	11,660,258.21 份	382,894.00 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（2016 年 10 月 12 日 — 2016 年 12 月 31 日）	
	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	476,519.06	10,420.88
2. 本期利润	132,836.38	-17,026.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0109	-0.0856
4. 期末基金资产净值	11,735,992.69	385,278.97
5. 期末基金份额净值	1.0065	1.0062

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、本基金于 2016 年 10 月 12 日成立，本截至 2016 年 12 月 31 日成立不满一季度。

#### 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

###### 安信沪深 300 增强 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	0.65%	0.62%	0.44%	0.67%	0.21%	-0.05%

###### 安信沪深 300 增强 C

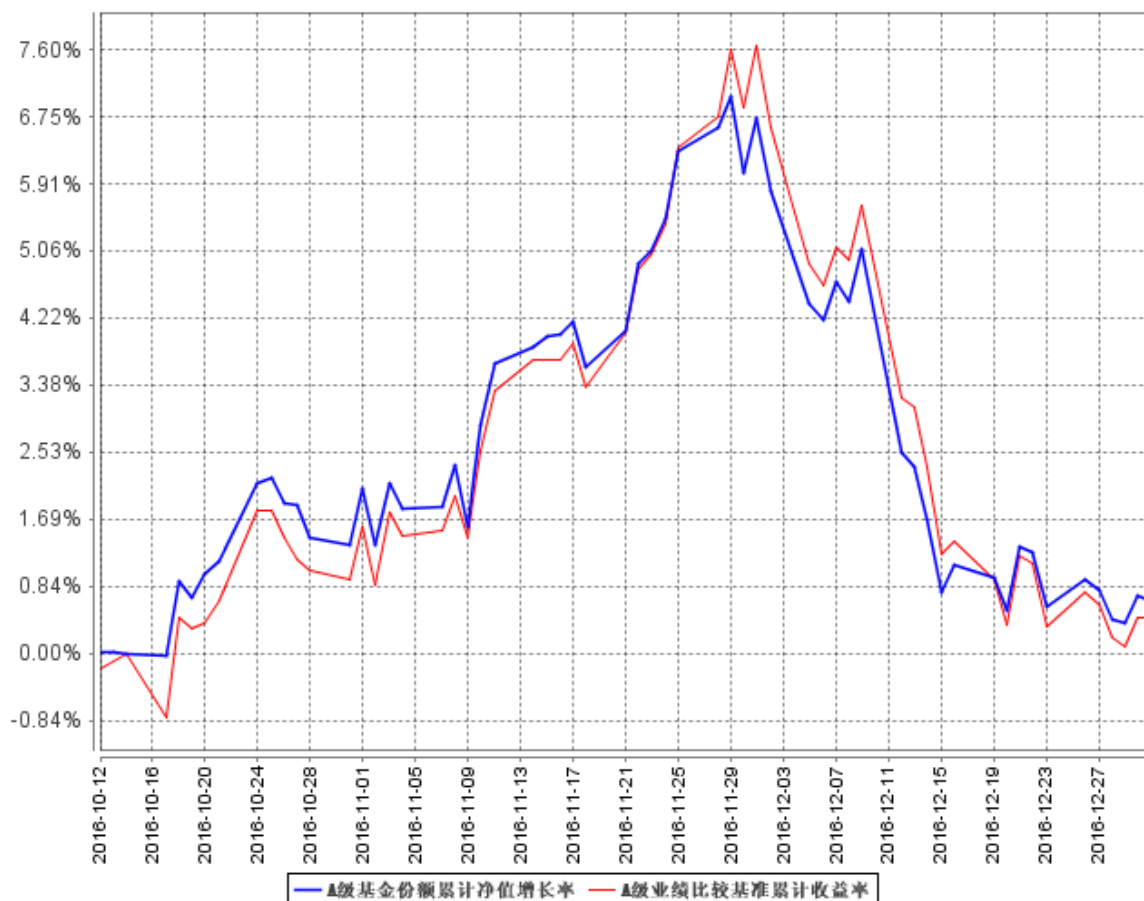
阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	0.62%	0.62%	0.44%	0.67%	0.18%	-0.05%

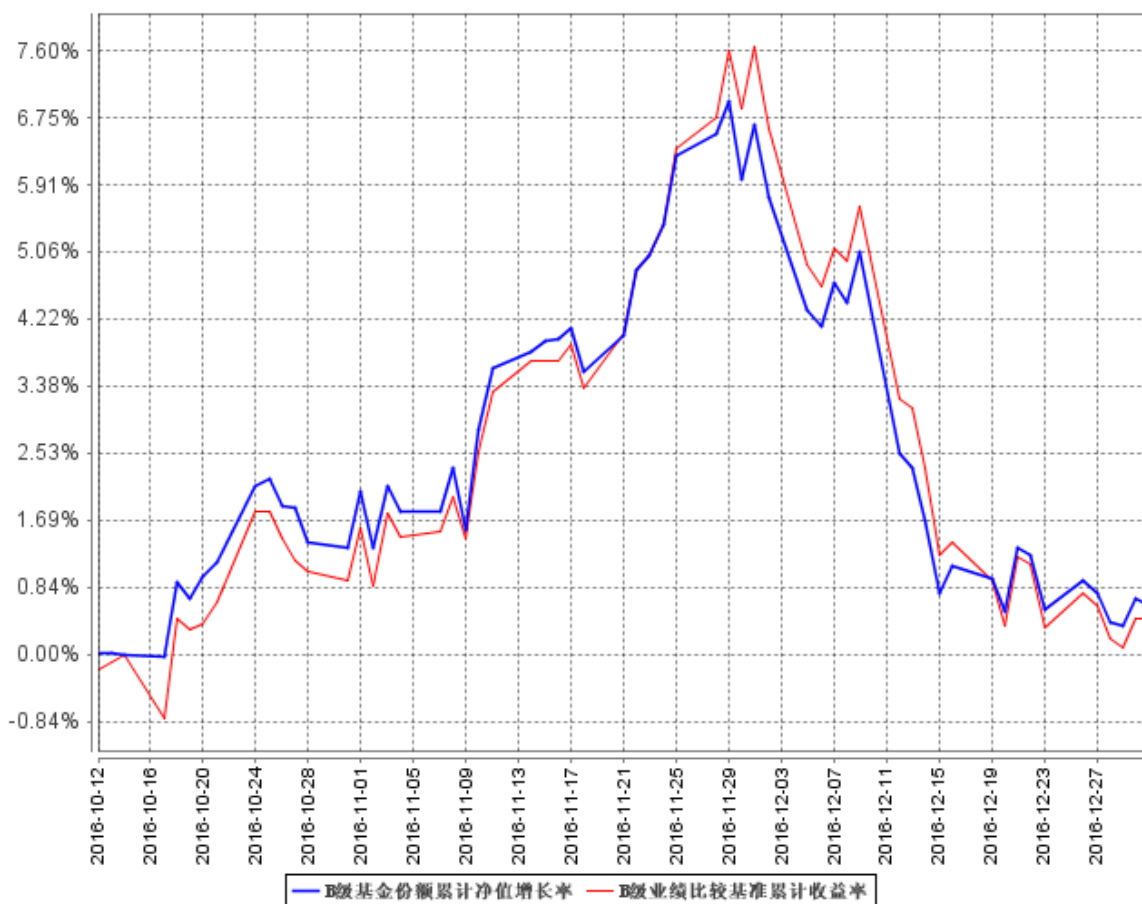
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×95%+1.5%

### 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

A级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



**B级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：注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 12 日。图示日期为 2016 年 10 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金的建仓期为 2016 年 10 月 12 日至 2017 年 4 月 11 日，本基金目前仍然处于建仓期。

## § 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		
龙川	本基金的基金经理、量化投资部总经理	2016 年 10 月 12 日	-	14	龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路指数分级证

					券投资基金、安信沪深 300 指数增强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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

四季度上证指数上涨 3.29%，创业板指数下跌 8.74%，沪深 300 涨幅 1.75%，同期安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金上涨 0.65%

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0065 元，本报告期份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准增长率为 0.44%。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 C 类份额净值为 1.0062 元，本报告期份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准增长率为 0.44%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，报告期不存在需要说明的情况。

### § 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	11,159,263.00	90.87
	其中：股票	11,159,263.00	90.87
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	1,106,590.03	9.01
8	其他资产	14,864.53	0.12
9	合计	12,280,717.56	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资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	293,558.00	2.42
C	制造业	2,303,171.00	19.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	320,264.00	2.64
E	建筑业	455,034.00	3.75
F	批发和零售业	141,412.00	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	498,954.00	4.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	203,552.00	1.68
J	金融业	3,489,630.00	28.79
K	房地产业	444,151.00	3.66
L	租赁和商务服务业	55,762.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	8,554.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,980.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	132,817.00	1.10
S	综合	2,262.00	0.02
	合计	8,355,101.00	68.93

### 5.2.2 报告期末积极投资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	25,400.00	0.21
B	采掘业	58,165.00	0.48
C	制造业	1,598,836.00	13.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	505,741.00	4.17
E	建筑业	27,405.00	0.23
F	批发和零售业	106,652.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	200,784.00	1.66
H	住宿和餐饮业	11,272.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,403.00	0.49
J	金融业	4,000.00	0.03
K	房地产业	135,718.00	1.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,366.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	27,432.00	0.23
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	8,092.00	0.07
S	综合	22,896.00	0.19
	合计	2,804,162.00	23.13

### 5.2.3 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

#### 5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	9,700	343,671.00	2.84
2	601166	兴业银行	18,400	296,976.00	2.45
3	601398	工商银行	60,800	268,128.00	2.21
4	601288	农业银行	84,700	262,570.00	2.17
5	601006	大秦铁路	36,900	261,252.00	2.16
6	601668	中国建筑	22,200	196,692.00	1.62
7	601328	交通银行	32,100	185,217.00	1.53
8	600816	安信信托	7,400	174,788.00	1.44
9	600036	招商银行	9,800	172,480.00	1.42
10	600104	上汽集团	7,300	171,185.00	1.41

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601566	九牧王	11,400	201,666.00	1.66
2	600578	京能电力	30,100	126,420.00	1.04
3	600642	申能股份	19,700	115,639.00	0.95
4	600863	内蒙华电	30,000	92,400.00	0.76
5	600507	方大特钢	13,500	91,395.00	0.75

### 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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。本基金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。

## 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	11,663.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	275.68
5	应收申购款	2,925.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,864.53

### 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

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C

基金合同生效日( 2016 年 10 月 12 日 )	12, 550, 364. 95	63, 773. 37
基金份额总额		
报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	150, 841. 25	422, 491. 08
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1, 040, 947. 99	103, 370. 45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	11, 660, 258. 21	382, 894. 00

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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10, 000, 000. 00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10, 000, 000. 00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	83. 03

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10, 000, 000. 00	83. 03	10, 000, 000. 00	79. 28	3
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 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沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信沪深 300 指数增强型发起式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 1 月 21 日