

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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 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。

基金托管人中国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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信沪深 300A	安信沪深 300C
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	11,481,337.03 份	805,887.53 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）	
	安信沪深 300A	安信沪深 300C
1. 本期已实现收益	-36,359.76	2,699.70
2. 本期利润	399,776.19	9,885.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0344	0.0205
4. 期末基金资产净值	11,948,879.35	838,065.00
5. 期末基金份额净值	1.0407	1.0399

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

###### 安信沪深 300A

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	3.40%	0.55%	4.57%	0.49%	-1.17%	0.06%

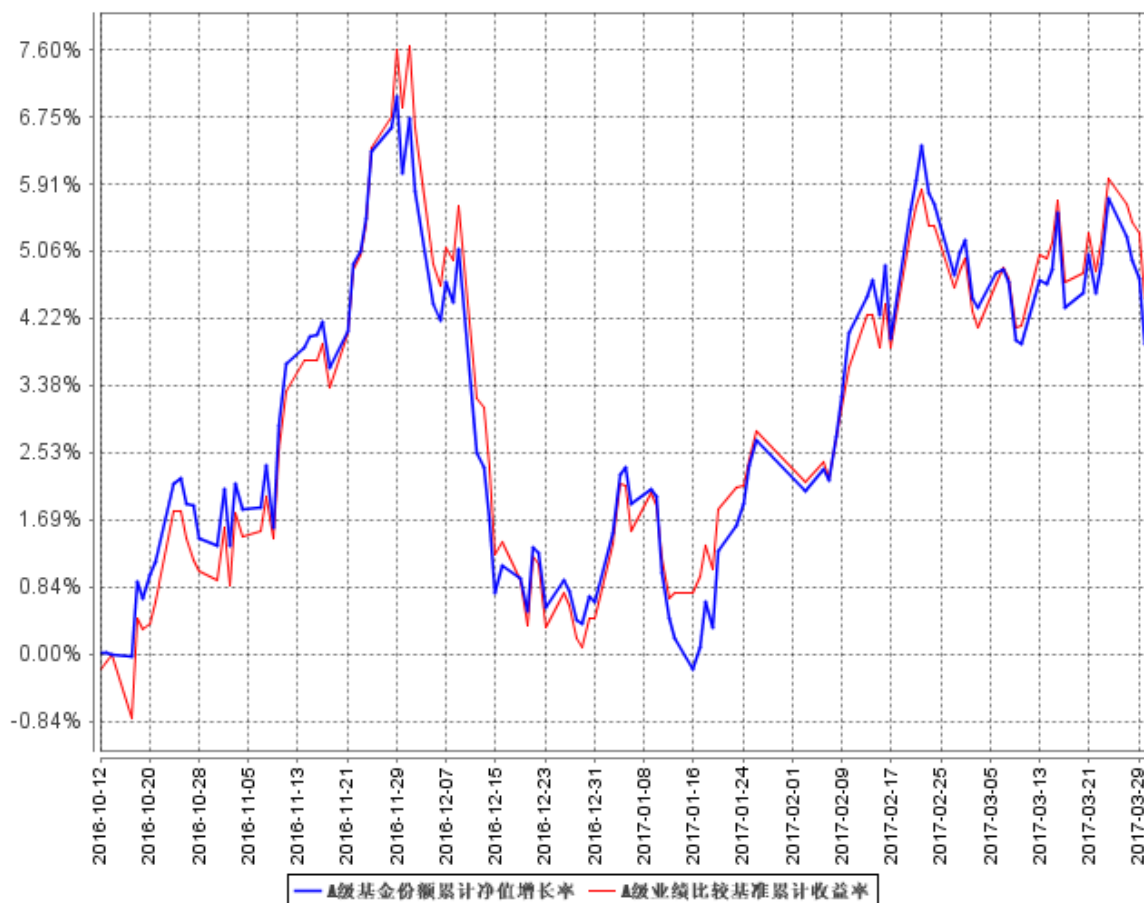
###### 安信沪深 300C

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	3.35%	0.55%	4.57%	0.49%	-1.22%	0.06%

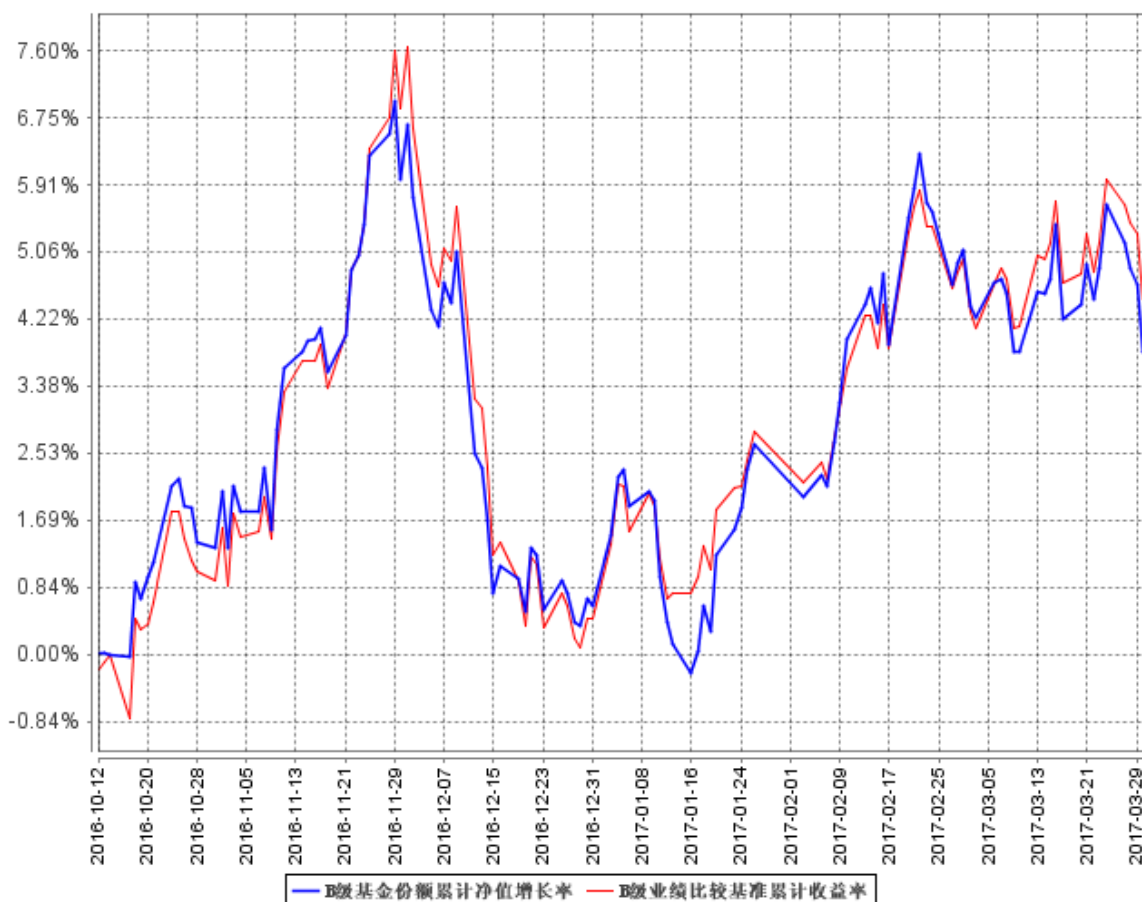
月						
---	--	--	--	--	--	--

### 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：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 2017 年 3 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	-	15	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主题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

2017 年一季度,宏观经济在供给侧改革、去产能、积极财政政策等多项措施下,经济运行逐步企稳。消费保持平稳较快增长,投资增速虽然有所放缓,但结构呈优化趋势。同时,企业盈利呈逐步改善趋势,工业企业的销售增长加快,利润由降转增,增速加快。

从国际宏观形势来看,特朗普的上台引起了对于全球自由贸易的担忧;美元的加息客观上给人民币带来贬值压力,加大了经济扰动。但是随着月末十二届全国人大五次会议的召开,

给资本市场带来了积极预期。金融市场,货币供应整体充裕,资金环境保持相对宽松。市场情绪回暖,股指底部稳步抬高,沪深 300 指数从 3310 点一路上涨到 3456 点。

## 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 1.0407 元,本报告期份额净值增长率为 3.40%,同期业绩比较基准增长率为 4.57%。截至 2017 年 03 月 31 日,本基金 C 类份额净值为 1.0399 元,本报告期份额净值增长率为 3.35%,同期业绩比较基准增长率为 4.57%。

#### 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	11,691,143.58	89.50
	其中：股票	11,691,143.58	89.50
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	1,197,908.69	9.17
8	其他资产	173,757.69	1.33
9	合计	13,062,809.96	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	252,046.00	1.97
C	制造业	3,744,650.00	29.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	315,241.00	2.47
E	建筑业	586,735.00	4.59
F	批发和零售业	354,409.00	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	235,270.00	1.84
H	住宿和餐饮业	37,544.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	355,339.00	2.78
J	金融业	2,885,446.00	22.57
K	房地产业	619,879.00	4.85
L	租赁和商务服务业	428,061.00	3.35
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	261,121.00	2.04
S	综合	44,016.00	0.34
	合计	10,119,757.00	79.14

### 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	24,933.00	0.19
B	采掘业	80,191.00	0.63
C	制造业	877,869.58	6.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,441.00	0.97
E	建筑业	48,168.00	0.38
F	批发和零售业	142,764.00	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	64,616.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,410.00	0.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	150,834.00	1.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,682.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	8,316.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,640.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	4,522.00	0.04
	合计	1,571,386.58	12.29

### 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	601166	兴业银行	43,100	698,651.00	5.46
2	600015	华夏银行	60,600	684,174.00	5.35
3	600873	梅花生物	53,000	387,960.00	3.03
4	000776	广发证券	21,900	374,271.00	2.93
5	601390	中国中铁	40,800	359,448.00	2.81
6	000415	渤海金控	48,900	348,657.00	2.73
7	601818	光大银行	71,400	293,454.00	2.29
8	600816	安信信托	23,500	266,490.00	2.08
9	002241	歌尔股份	7,600	258,704.00	2.02
10	600582	天地科技	41,800	236,588.00	1.85

#### 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	600665	天地源	5,600	30,576.00	0.24
2	000900	现代投资	2,900	25,897.00	0.20
3	000539	粤电力A	4,500	25,200.00	0.20
4	600966	博汇纸业	4,800	24,624.00	0.19
5	600231	凌钢股份	6,900	23,805.00	0.19

### 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除“广发证券（000776）”和“歌尔股份（002241）”在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形外，其他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。

经查明，广发证券涉嫌违法违规的事实如下：广发证券未对外部接入的第三方交易终端软件（HOMS 系统、铭创系统）进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份信息缺乏了解。广发证券未采集 123 个使用 HOMS 系统、铭创系统接入的主账户客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。综上，广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，

《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条等相关条例，获利 6,805,135.75 元。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，对广发证券做出以下处罚决定：对广发证券责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款；对王新栋、林建何、梅纪元、周翔给予警告，并分别处以 10 万元罚款；

经查，歌尔股份 2015 年以来内幕信息知情人登记管理主要存在以下问题：

《2014 年年报披露》、《2015 年一季报披露》、《2015 年半年报披露》、《2015 年三季报披露》、《2015 年年报披露》、《2016 年一季报披露》内幕信息知情人名单明显不符合定期报告编制、审计、通知、审议、披露所涉及的岗位和人员情况，《2014 年年度利润分配》、《2015 年年度利润分配》不符合利润分配商议筹划、论证、提议、通知、审议所涉及的人员情况。《员工持股计划》、《重大事项停牌》相关的内幕信息知情人档案，登记的内幕信息知情人与该事项所需的审批权限明显不匹配。

鉴于上述事实与情节，山东证监局要求 30 日内完成整改工作并披露整改报告，公司已于 2016 年 8 月整改完毕。

## 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	12,038.47
2	应收证券清算款	109,339.17
3	应收股利	-
4	应收利息	250.05
5	应收申购款	52,130.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,757.69

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五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	安信沪深 300A	安信沪深 300C
报告期期初基金份额总额	11,660,258.21	382,894.00
报告期期间基金总申购份额	164,637.46	657,718.27
减：报告期期间基金总赎回份额	343,558.64	234,724.74
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	11,481,337.03	805,887.53

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额比例（%）	81.39

### 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	81.39	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 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	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	81.39%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p>							

- (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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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。

### 10.2 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

### 10.3 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