

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资
基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 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.....	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
7.8 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贵金属投资明细.....	66
7.9 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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	69
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	69
§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76

11.1 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	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录.....	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	安信沪深 300 增强	
基金主代码	003261	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 12 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	
报告期末基金份额总额	138,221,324.06 份	
基金合同存续期	不定期	
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	137,491,886.27 份	729,437.79 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	王永民
	联系电话	0755-82509999	010-66594896
	电子邮箱	service@essencefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95566
传真		0755-82799292	010-66594942
注册地址		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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518026	100818
法定代表人		刘入领	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,951,070.88	-15,348.41
本期利润	7,443,133.88	32,874.02
加权平均基金份额本期利润	0.1149	0.0577
本期加权平均净值利润率	11.27%	5.61%
本期基金份额净值增长率	7.68%	7.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,084,144.51	5,295.23
期末可供分配基金份额利润	0.0079	0.0073
期末基金资产净值	149,009,028.65	790,063.17
期末基金份额净值	1.0838	1.0831
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.38%	8.31%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

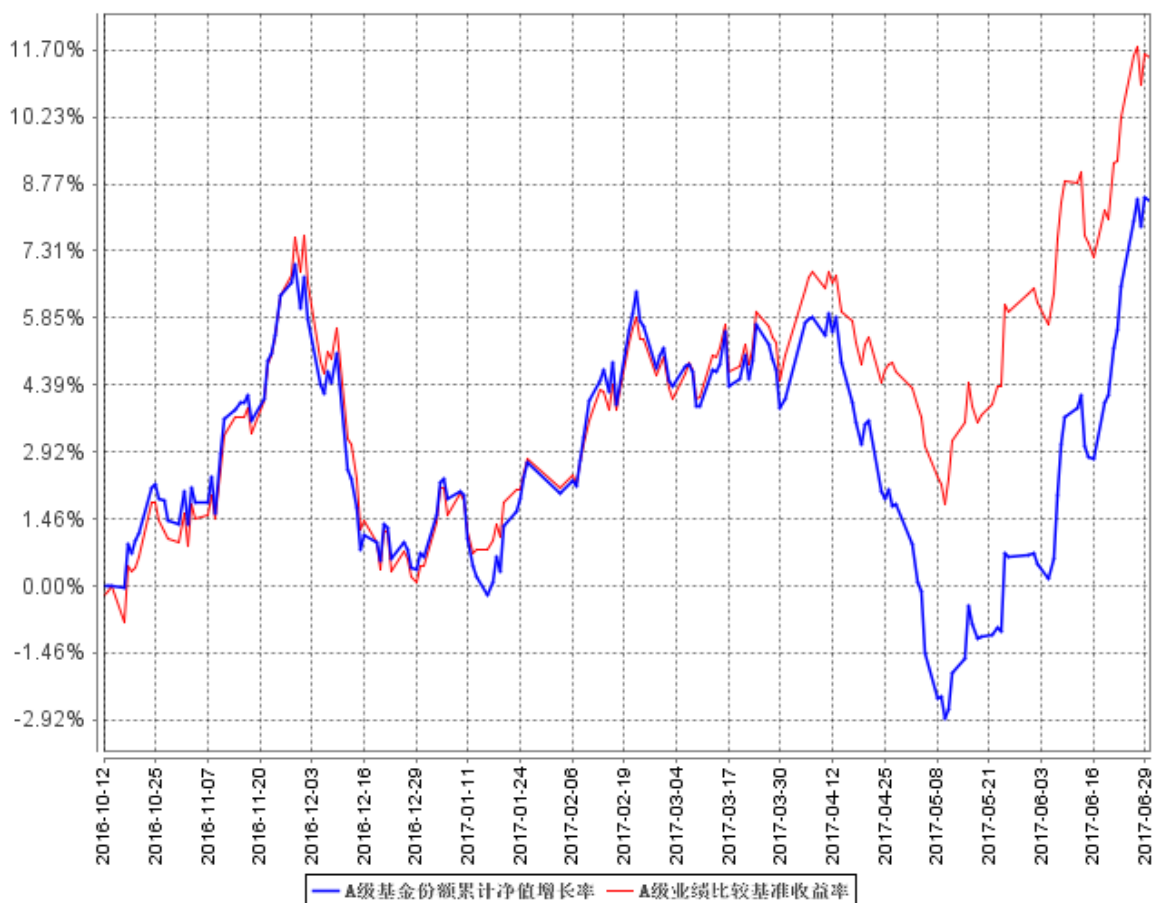
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	7.66%	0.64%	4.86%	0.64%	2.80%	0.00%
过去三个月	4.14%	0.69%	6.19%	0.59%	-2.05%	0.10%
过去六个月	7.68%	0.62%	11.04%	0.54%	-3.36%	0.08%
自基金合同生效起至今	8.38%	0.62%	11.53%	0.58%	-3.15%	0.04%

安信沪深 300 增强 C

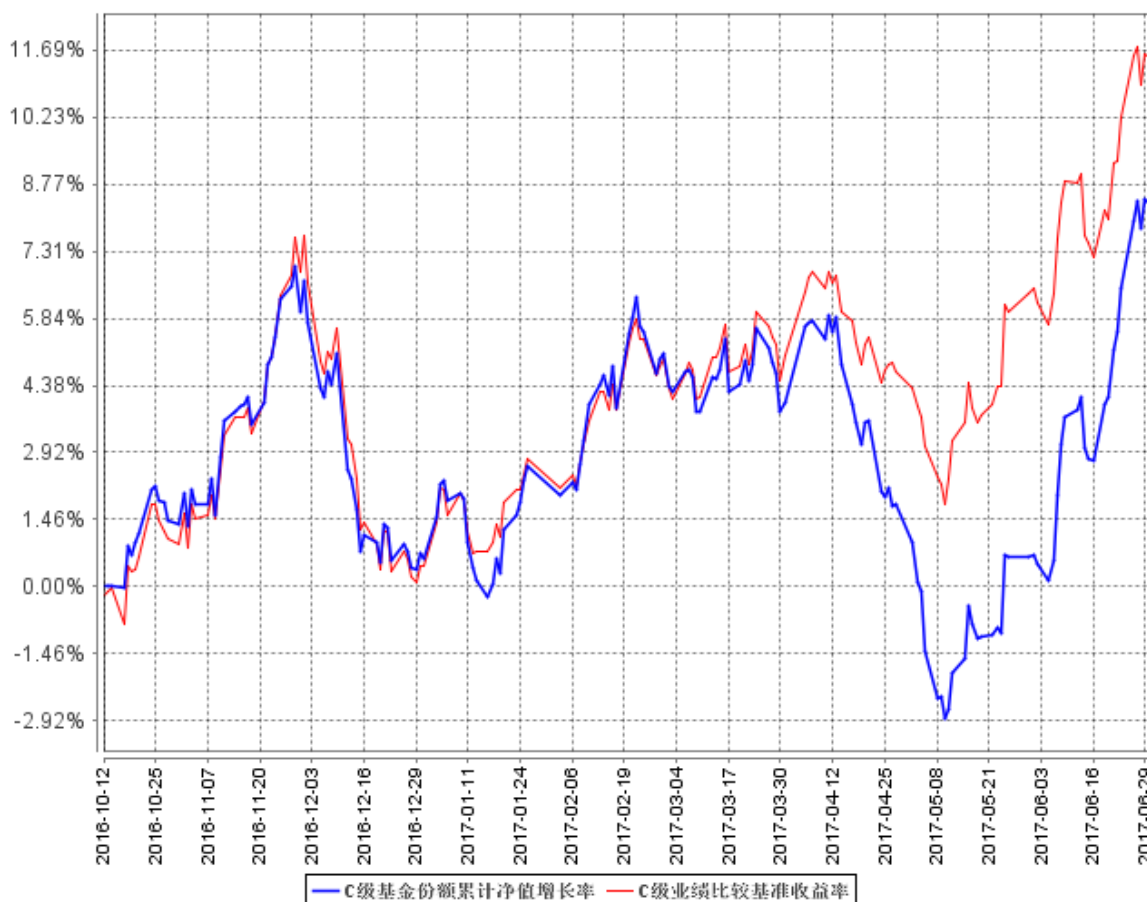
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.60%	0.64%	4.86%	0.64%	2.74%	0.00%
过去三个月	4.15%	0.69%	6.19%	0.59%	-2.04%	0.10%
过去六个月	7.64%	0.62%	11.04%	0.54%	-3.40%	0.08%
自基金合同生效起至今	8.31%	0.62%	11.53%	0.58%	-3.22%	0.04%

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

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



C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、本基金合同生效日为 2016 年 10 月 12 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 3.5 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 38.72% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 19.71% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 8.57% 的股权。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 34 只开放式基金，具体如下：从 2012 年 6 月 20 日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2012 年 9 月 25 日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从 2012 年 12 月 18 日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从 2013 年 2 月 5 日起管理安信现金管理货币市场基金；从 2013 年 7 月 24 日起管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)；从 2013 年 11 月 8 日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从 2013 年 12 月 31 日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2014 年 4 月 21 日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从 2014 年 11 月 24 日起管理安信现金增利货币市场基金；从 2015 年 3 月 19 日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从 2015 年 4 月 15 日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 14 日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从 2015 年 5 月 20 日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 25 日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 6 月 5 日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日起管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日起管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年

10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 1 月 13 日起管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理）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。
施荣盛	本基金的基 金经理助理	2016 年 10 月 24 日	-	4	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证 券资产管理有限公司量化投资部研究 员、安信基金管理有限责任公司量化投 资部研究助理。现任安信基金管理有限 责任公司量化投资部基金经理助理。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助理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职

日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

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。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年上半年，大盘总体运行平稳，但在结构上明显分化。以金融、家电为代表的蓝筹股一路上涨，反观中小盘题材股则走势疲软。截至 6 月 30 日收盘，上证综指、深证综指沪深 300、和创业板指数分别上涨 2.86%、-3.63%、10.78%和-7.34%，同期安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金上涨 7.68%。本基金的跟踪误差和偏离度被控制在基金合同的允许范围内，最大化的提升了风险收益比率。

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%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信沪深增强 A 基金份额净值为 1.0838 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.68%；截至本报告期末安信沪深增强 C 基金份额净值为 1.0831 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.64%；同期业绩比较基准收益率为 11.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年下半年，随着整体经济仍保持平稳增长，A 股表现仍值得期待。预计 A 股结构性机会将逐渐显现，在震荡中逐步走强，价格终究回归价值。同时随着国企改革的推进、部分国家重大战略的推进，我们看好中国经济的韧劲、结构优化以及内外环境的改善，坚信改革会持续、有力地推进，股市有望迎来大量的投资机会。

随着经济形势的稳定，各指数也将会迎来新的契机。安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将保持指数复制结合相对增强的投资策略，力争使投资者在获取大盘蓝筹股票收益的同时进一步有所增强。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证公司估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经历。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，报告期不存在需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,360,561.63	998,093.00
结算备付金		1,563,074.55	108,497.03
存出保证金		96,837.78	11,663.33
交易性金融资产	6.4.7.2	139,431,730.60	11,159,263.00
其中：股票投资		139,431,730.60	11,159,263.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		91,673.33	-
应收利息	6.4.7.5	3,104.08	275.68
应收股利		-	-
应收申购款		2,000.00	2,925.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		150,548,981.97	12,280,717.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		11,524.49	480.93
应付管理人报酬		125,090.58	10,462.84
应付托管费		25,018.13	2,092.57
应付销售服务费		252.55	166.29
应付交易费用	6.4.7.7	438,538.24	32,437.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	149,466.16	113,805.56
负债合计		749,890.15	159,445.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	138,221,324.06	12,043,152.21
未分配利润	6.4.7.10	11,577,767.76	78,119.45
所有者权益合计		149,799,091.82	12,121,271.66
负债和所有者权益总计		150,548,981.97	12,280,717.56

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，安信沪深增强 A 基金份额净值 1.0838 元，基金份额总额 137,491,886.27 份；安信沪深增强 C 基金份额净值 1.0831 元，基金份额总额 729,437.79 份。安信沪深 300 发起式份额总额合计为 138,221,324.06 份。

6.2 利润表

会计主体：安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		8,746,132.80
1.利息收入		29,016.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,016.66
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,766,673.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,957,229.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	1,190,555.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,442,427.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	41,362.90
减：二、费用		1,270,124.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	324,777.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,955.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,443.42
4. 交易费用	6.4.7.20	791,888.87
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	87,059.55

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,476,007.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,476,007.90

注：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 12 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,043,152.21	78,119.45	12,121,271.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,476,007.90	7,476,007.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	126,178,171.85	4,023,640.41	130,201,812.26
其中：1.基金申购款	136,651,589.81	4,852,159.46	141,503,749.27
2.基金赎回款	-10,473,417.96	-828,519.05	-11,301,937.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	138,221,324.06	11,577,767.76	149,799,091.82
---------------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘入领 _____	_____ 范瑛 _____	_____ 尚尔航 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2016 年 7 月 13 日下发的证监许可[2016]1591 号文“关于核准安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2016 年 9 月 5 日至 2016 年 9 月 23 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字 60962175_H60 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 12,612,278.84 元。经向中国证监会备案，《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 12 日正式生效。截至 2016 年 10 月 12 日止，安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 12,612,278.84 元，折合 12,612,278.84 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 1,309.48 元，折合 1,309.48 份基金份额。其中 A 类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 12,548,528.84 元，折合 12,548,528.84 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 1,286.11 元，折合 1,286.11 份基金份额。C 类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 63,750.00 元，折合 63,750.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 23.37 元，折合 23.37 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 12,613,588.32 元，折合 12,613,588.32 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股，并可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券

资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金各类资产投资比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：95%*沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

6.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	9,360,561.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,360,561.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,360,433.79	139,431,730.60	11,071,296.81
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	128,360,433.79	139,431,730.60	11,071,296.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,356.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	703.78
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	43.60
合计	3,104.08

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	438,538.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	438,538.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.20
预提费用	139,464.96
应付指数使用费	10,000.00
合计	149,466.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信沪深 300 增强 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,660,258.21	11,660,258.21
本期申购	135,495,939.37	135,495,939.37
本期赎回(以“-”号填列)	-9,664,311.31	-9,664,311.31
本期末	137,491,886.27	137,491,886.27

金额单位：人民币元

安信沪深 300 增强 C	
项目	本期

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	382,894.00	382,894.00
本期申购	1,155,650.44	1,155,650.44
本期赎回(以“-”号填列)	-809,106.65	-809,106.65
本期末	729,437.79	729,437.79

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信沪深 300 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	455,420.67	-379,686.19	75,734.48
本期利润	-3,951,070.88	11,394,204.76	7,443,133.88
本期基金份额交易产生的变动数	4,579,794.72	-581,520.70	3,998,274.02
其中：基金申购款	4,613,787.37	184,998.48	4,798,785.85
基金赎回款	-33,992.65	-766,519.18	-800,511.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,084,144.51	10,432,997.87	11,517,142.38

单位：人民币元

安信沪深 300 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,847.02	-12,462.05	2,384.97
本期利润	-15,348.41	48,222.43	32,874.02
本期基金份额交易产生的变动数	5,796.62	19,569.77	25,366.39
其中：基金申购款	22,620.30	30,753.31	53,373.61
基金赎回款	-16,823.68	-11,183.54	-28,007.22

本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,295.23	55,330.15	60,625.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,709.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,000.51
其他	307.11
合计	29,016.66

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	267,503,338.93
减：卖出股票成本总额	271,460,568.68
买卖股票差价收入	-3,957,229.75

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,190,555.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,190,555.80

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,442,427.19
——股票投资	11,442,427.19
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	11,442,427.19

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	41,362.90
合计	41,362.90

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	791,888.87
银行间市场交易费用	-
合计	791,888.87

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	49,588.57
银行划款费用	2,594.59
指数使用费	20,000.00
合计	87,059.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：1) 本基金管理人于 2013 年 12 月 2 日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2) 本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。

3) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

安信证券	21,889,491.65	3.34%
------	---------------	-------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
安信证券	15,570.71	3.34%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	324,777.57
其中：支付销售机构的客户维护费	6,047.02

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,955.49

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C	合计
中国银行	-	54.18	54.18
安信证券	-	9.55	9.55
合计	-	63.73	63.73

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

	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）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.23%	-

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末及上年度末未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,360,561.63	23,709.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	675	7,600.50	7,600.50	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

		日	3 日							
--	--	---	-----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事项	17.40	-	-	64,960	1,120,530.67	1,130,304.00	-
000061	农产品	2017年6月28日	重大事项	9.06	-	-	81,000	736,650.00	733,860.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	25,500	514,473.96	568,395.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事项	5.35	2017年7月26日	5.89	48,200	264,562.00	257,870.00	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事项	24.93	-	-	9,100	295,036.00	226,863.00	-
600050	中国联通	2017年4月	重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	6,900	47,674.41	51,543.00	-

		月 5 日								
000862	银星能源	2017 年 3 月 13 日	重大 事项	7.90	-	-	1,000	7,950.00	7,900.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大 事项	14.59	-	-	500	8,619.42	7,295.00	-
300486	东杰智能	2017 年 1 月 25 日	重大 事项	22.63	2017 年 8 月 9 日	20.38	300	8,468.40	6,789.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下

设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%（上年度末为 0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流

通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,360,561.63	-	-	-	9,360,561.63
结算备付金	1,563,074.55	-	-	-	1,563,074.55
存出保证金	96,837.78	-	-	-	96,837.78
交易性金融资产	-	-	-	139,431,730.60	139,431,730.60
应收证券清算款	-	-	-	91,673.33	91,673.33
应收利息	-	-	-	3,104.08	3,104.08
应收申购款	-	-	-	2,000.00	2,000.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,020,473.96	-	-	139,528,508.01	150,548,981.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,524.49	11,524.49
应付管理人报酬	-	-	-	125,090.58	125,090.58
应付托管费	-	-	-	25,018.13	25,018.13
应付销售服务费	-	-	-	252.55	252.55
应付交易费用	-	-	-	438,538.24	438,538.24
其他负债	-	-	-	149,466.16	149,466.16

负债总计	-	-	-	749,890.15	749,890.15
利率敏感度缺口	11,020,473.96	-	-	138,778,617.86	149,799,091.82
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	998,093.00	-	-	-	998,093.00
结算备付金	108,497.03	-	-	-	108,497.03
存出保证金	11,663.33	-	-	-	11,663.33
交易性金融资产	-	-	-	11,159,263.00	11,159,263.00
应收利息	-	-	-	275.68	275.68
应收申购款	-	-	-	2,925.52	2,925.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,118,253.36	-	-	11,162,464.20	12,280,717.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	480.93	480.93
应付管理人报酬	-	-	-	10,462.84	10,462.84
应付托管费	-	-	-	2,092.57	2,092.57
应付销售服务费	-	-	-	166.29	166.29
应付交易费用	-	-	-	32,437.71	32,437.71
其他负债	-	-	-	113,805.56	113,805.56
负债总计	-	-	-	159,445.90	159,445.90
利率敏感度缺口	1,118,253.36	-	-	11,003,018.30	12,121,271.66

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（上年度末本基金未持有交易性债券投资）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融资产，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票、债券、资产支持证券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融资产，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 主题指数。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	139,431,730.60	93.08	11,159,263.00	92.06
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	139,431,730.60	93.08	11,159,263.00	92.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）

		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1、沪深 300 指数上升 5%	7,841,086.54	586,819.54
	2、沪深 300 指数下降 5%	-7,841,086.54	-586,819.54

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的 比例（%）
1	权益投资	139,431,730.60	92.62
	其中：股票	139,431,730.60	92.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,923,636.18	7.26
7	其他各项资产	193,615.19	0.13
8	合计	150,548,981.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	985,364.00	0.66
B	采矿业	2,057,141.00	1.37
C	制造业	49,912,293.14	33.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	260,230.00	0.17
E	建筑业	5,755,411.58	3.84
F	批发和零售业	882,182.15	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,576,430.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,703,126.30	3.14
J	金融业	57,820,476.55	38.60
K	房地产业	7,484,200.44	5.00
L	租赁和商务服务业	784,440.00	0.52
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	136,358.00	0.09
S	综合	1,801,643.00	1.20
	合计	134,159,296.16	89.56

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	4,210,672.82	2.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,900.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	171,080.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	51,490.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	733,860.00	0.49
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	89,792.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	5,272,434.44	3.52

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600015	华夏银行	988,039	9,109,719.58	6.08
2	600016	民生银行	986,600	8,109,852.00	5.41
3	000725	京东方 A	1,944,600	8,089,536.00	5.40
4	601318	中国平安	161,700	8,021,937.00	5.36
5	000651	格力电器	194,800	8,019,916.00	5.35
6	600036	招商银行	331,339	7,922,315.49	5.29
7	601601	中国太保	205,746	6,968,617.02	4.65
8	601211	国泰君安	314,400	6,448,344.00	4.30
9	000063	中兴通讯	220,700	5,239,418.00	3.50
10	000001	平安银行	446,000	4,187,940.00	2.80
11	601628	中国人寿	126,000	3,399,480.00	2.27
12	000625	长安汽车	215,400	3,106,068.00	2.07
13	000338	潍柴动力	233,800	3,086,160.00	2.06
14	002466	天齐锂业	55,400	3,010,990.00	2.01
15	600519	贵州茅台	5,700	2,689,545.00	1.80
16	000895	双汇发展	104,700	2,486,625.00	1.66
17	002065	东华软件	108,200	2,357,678.00	1.57
18	000623	吉林敖东	101,370	2,320,359.30	1.55
19	002465	海格通信	195,700	2,101,818.00	1.40
20	000876	新希望	229,700	1,888,134.00	1.26
21	002310	东方园林	112,700	1,884,344.00	1.26
22	600340	华夏幸福	55,258	1,855,563.64	1.24
23	002081	金螳螂	166,950	1,833,111.00	1.22
24	600109	国金证券	155,200	1,818,944.00	1.21
25	000009	中国宝安	222,700	1,801,643.00	1.20
26	601668	中国建筑	179,800	1,740,464.00	1.16

27	600816	安信信托	106,494	1,447,253.46	0.97
28	000917	电广传媒	125,411	1,417,144.30	0.95
29	002074	国轩高科	43,500	1,372,425.00	0.92
30	002470	金正大	165,500	1,246,215.00	0.83
31	600606	绿地控股	152,200	1,190,204.00	0.79
32	000540	中天金融	167,100	1,161,345.00	0.78
33	600663	陆家嘴	47,582	1,124,838.48	0.75
34	002152	广电运通	129,450	1,075,729.50	0.72
35	600208	新湖中宝	238,100	1,071,450.00	0.72
36	600276	恒瑞医药	20,400	1,032,036.00	0.69
37	002714	牧原股份	36,200	985,364.00	0.66
38	600028	中国石化	138,200	819,526.00	0.55
39	600649	城投控股	77,492	814,440.92	0.54
40	600019	宝钢股份	105,000	704,550.00	0.47
41	601006	大秦铁路	74,900	628,411.00	0.42
42	601088	中国神华	25,500	568,395.00	0.38
43	600585	海螺水泥	24,500	556,885.00	0.37
44	601857	中国石油	61,100	469,859.00	0.31
45	000415	渤海金控	66,400	446,872.00	0.30
46	600009	上海机场	11,900	443,989.00	0.30
47	600309	万华化学	14,060	402,678.40	0.27
48	002500	山西证券	40,300	386,074.00	0.26
49	601607	上海医药	12,916	373,014.08	0.25
50	600637	东方明珠	15,900	344,553.00	0.23
51	601888	中国国旅	11,200	337,568.00	0.23
52	600031	三一重工	39,100	317,883.00	0.21
53	600741	华域汽车	12,900	312,696.00	0.21
54	600406	国电南瑞	17,300	305,345.00	0.20

55	601800	中国交建	18,722	297,492.58	0.20
56	600177	雅戈尔	26,320	266,358.40	0.18
57	600674	川投能源	26,500	260,230.00	0.17
58	600739	辽宁成大	14,400	259,632.00	0.17
59	601919	中远海控	48,200	257,870.00	0.17
60	600271	航天信息	12,300	253,872.00	0.17
61	600153	建发股份	19,299	249,536.07	0.17
62	600115	东方航空	36,200	246,160.00	0.16
63	000503	海虹控股	9,100	226,863.00	0.15
64	600688	上海石化	27,500	181,775.00	0.12
65	600362	江西铜业	9,481	159,849.66	0.11
66	601225	陕西煤业	21,100	149,177.00	0.10
67	601718	际华集团	16,100	141,519.00	0.09
68	600373	中文传媒	5,800	136,358.00	0.09
69	600685	中船防务	3,956	108,315.28	0.07
70	600050	中国联通	6,900	51,543.00	0.03
71	600188	兖州煤业	4,100	50,184.00	0.03
72	600485	信威集团	500	7,295.00	0.00

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000778	新兴铸管	234,300	1,569,810.00	1.05
2	600666	奥瑞德	64,960	1,130,304.00	0.75
3	000800	一汽轿车	89,000	905,130.00	0.60
4	000061	农产品	81,000	733,860.00	0.49

5	601258	庞大集团	61,100	171,080.00	0.11
6	600839	四川长虹	42,400	153,488.00	0.10
7	600875	东方电气	14,800	141,784.00	0.09
8	601928	凤凰传媒	9,200	89,792.00	0.06
9	600754	锦江股份	1,900	51,490.00	0.03
10	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
11	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
12	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
13	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
14	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
15	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
16	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
17	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
18	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
19	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
20	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
21	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
22	000862	银星能源	1,000	7,900.00	0.01
23	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
24	603305	旭升股份	675	7,600.50	0.01
25	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
26	300486	东杰智能	300	6,789.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	600015	华夏银行	14,971,240.44	123.51
2	601211	国泰君安	11,282,920.00	93.08
3	601166	兴业银行	10,983,500.00	90.61
4	600016	民生银行	9,637,816.00	79.51
5	000651	格力电器	9,165,637.00	75.62
6	601318	中国平安	8,925,606.55	73.64
7	601601	中国太保	8,235,256.24	67.94
8	000725	京东方 A	8,014,072.00	66.12
9	600036	招商银行	7,870,769.32	64.93
10	601288	农业银行	7,443,304.00	61.41
11	000415	渤海金控	7,237,254.00	59.71
12	000001	平安银行	7,151,514.98	59.00
13	601628	中国人寿	5,335,034.00	44.01
14	601186	中国铁建	5,220,137.00	43.07
15	600873	梅花生物	5,111,575.00	42.17
16	000063	中兴通讯	4,948,376.00	40.82
17	000402	金融街	4,916,215.00	40.56
18	600060	海信电器	4,846,106.00	39.98
19	600816	安信信托	4,745,104.62	39.15
20	601818	光大银行	4,532,277.00	37.39
21	002466	天齐锂业	4,053,457.00	33.44
22	600519	贵州茅台	4,005,723.29	33.05
23	000876	新希望	3,934,252.00	32.46
24	000338	潍柴动力	3,914,895.00	32.30
25	600104	上汽集团	3,905,215.00	32.22
26	002241	歌尔股份	3,550,266.53	29.29
27	000625	长安汽车	3,539,851.00	29.20

28	000895	双汇发展	3,439,262.61	28.37
29	601328	交通银行	3,219,159.00	26.56
30	600383	金地集团	3,102,617.00	25.60
31	000776	广发证券	3,066,525.00	25.30
32	600582	天地科技	2,832,247.00	23.37
33	600340	华夏幸福	2,767,103.94	22.83
34	002065	东华软件	2,692,567.00	22.21
35	000623	吉林敖东	2,645,249.00	21.82
36	601668	中国建筑	2,553,935.00	21.07
37	000686	东北证券	2,548,109.00	21.02
38	000009	中国宝安	2,528,540.00	20.86
39	000069	华侨城 A	2,339,164.00	19.30
40	002310	东方园林	2,295,104.00	18.93
41	000002	万科 A	2,273,339.00	18.75
42	000917	电广传媒	2,159,556.25	17.82
43	002465	海格通信	2,115,542.00	17.45
44	600028	中国石化	2,101,194.30	17.33
45	002081	金螳螂	2,096,442.00	17.30
46	002470	金正大	2,073,246.00	17.10
47	601390	中国中铁	2,072,902.00	17.10
48	002475	立讯精密	2,045,865.00	16.88
49	002074	国轩高科	2,040,511.00	16.83
50	600893	航发动力	2,005,477.00	16.55
51	600674	川投能源	1,990,214.00	16.42
52	002500	山西证券	1,972,337.00	16.27
53	600606	绿地控股	1,969,501.00	16.25
54	600900	长江电力	1,937,263.00	15.98
55	600208	新湖中宝	1,884,380.00	15.55

56	600663	陆家嘴	1,869,372.22	15.42
57	600109	国金证券	1,828,400.00	15.08
58	000538	云南白药	1,821,515.00	15.03
59	000540	中天金融	1,803,392.00	14.88
60	600188	兖州煤业	1,796,945.00	14.82
61	002142	宁波银行	1,792,954.00	14.79
62	000778	新兴铸管	1,708,444.00	14.09
63	601169	北京银行	1,646,234.00	13.58
64	600271	航天信息	1,645,090.00	13.57
65	600019	宝钢股份	1,639,760.00	13.53
66	601800	中国交建	1,633,009.71	13.47
67	300251	光线传媒	1,627,464.00	13.43
68	002202	金风科技	1,589,575.00	13.11
69	002183	怡亚通	1,570,800.80	12.96
70	000039	中集集团	1,565,979.00	12.92
71	000156	华数传媒	1,557,960.40	12.85
72	600649	城投控股	1,513,270.40	12.48
73	600362	江西铜业	1,467,133.20	12.10
74	600276	恒瑞医药	1,464,339.00	12.08
75	601688	华泰证券	1,454,333.04	12.00
76	600666	奥瑞德	1,451,722.00	11.98
77	600795	国电电力	1,446,825.00	11.94
78	000963	华东医药	1,423,459.00	11.74
79	600704	物产中大	1,417,336.00	11.69
80	000858	五粮液	1,368,600.00	11.29
81	600309	万华化学	1,352,963.00	11.16
82	600153	建发股份	1,327,795.73	10.95
83	000166	申万宏源	1,316,940.00	10.86

84	002568	百润股份	1,298,798.00	10.72
85	002024	苏宁云商	1,296,786.00	10.70
86	000800	一汽轿车	1,281,512.00	10.57
87	600030	中信证券	1,280,777.00	10.57
88	300017	网宿科技	1,276,316.00	10.53
89	600741	华域汽车	1,227,307.00	10.13
90	002152	广电运通	1,212,457.00	10.00
91	002714	牧原股份	1,194,560.00	9.86
92	000709	河钢股份	1,192,148.00	9.84
93	600518	康美药业	1,151,936.00	9.50
94	600688	上海石化	1,151,121.00	9.50
95	600018	上港集团	1,139,893.00	9.40
96	300070	碧水源	1,134,776.00	9.36
97	000423	东阿阿胶	1,124,687.00	9.28
98	600066	宇通客车	1,063,643.00	8.78
99	601006	大秦铁路	1,059,111.00	8.74
100	601899	紫金矿业	1,043,213.00	8.61
101	600038	中直股份	1,031,483.48	8.51
102	002027	分众传媒	1,010,067.00	8.33
103	600023	浙能电力	999,088.00	8.24
104	600585	海螺水泥	965,612.90	7.97
105	601607	上海医药	956,231.08	7.89
106	600839	四川长虹	942,006.00	7.77
107	000671	阳光城	913,405.00	7.54
108	300182	捷成股份	890,428.00	7.35
109	601888	中国国旅	874,270.00	7.21
110	002299	圣农发展	865,384.00	7.14
111	600332	白云山	844,115.00	6.96

112	600958	东方证券	842,053.00	6.95
113	600009	上海机场	832,242.00	6.87
114	600648	外高桥	790,293.00	6.52
115	600048	保利地产	782,450.00	6.46
116	002415	海康威视	770,064.00	6.35
117	601600	中国铝业	764,228.00	6.30
118	601088	中国神华	757,024.00	6.25
119	600031	三一重工	756,276.00	6.24
120	601336	新华保险	751,621.00	6.20
121	300124	汇川技术	737,253.00	6.08
122	000061	农产品	736,650.00	6.08
123	601398	工商银行	734,412.00	6.06
124	600588	用友网络	724,007.28	5.97
125	300133	华策影视	698,685.00	5.76
126	600739	辽宁成大	678,944.00	5.60
127	002304	洋河股份	664,982.00	5.49
128	601857	中国石油	662,226.00	5.46
129	600875	东方电气	661,952.00	5.46
130	000333	美的集团	659,127.00	5.44
131	000425	徐工机械	658,621.00	5.43
132	000830	鲁西化工	655,431.00	5.41
133	601155	新城控股	645,156.00	5.32
134	601333	广深铁路	637,571.00	5.26
135	600498	烽火通信	632,624.00	5.22
136	000826	启迪桑德	631,279.00	5.21
137	002007	华兰生物	629,025.00	5.19
138	600755	厦门国贸	628,258.00	5.18
139	600637	东方明珠	625,448.00	5.16

140	000966	长源电力	620,549.00	5.12
141	000900	现代投资	608,468.00	5.02
142	002236	大华股份	607,896.00	5.02
143	000157	中联重科	606,921.00	5.01
144	600039	四川路桥	600,706.00	4.96
145	000926	福星股份	600,123.00	4.95
146	600966	博汇纸业	595,821.85	4.92
147	000825	太钢不锈	591,831.00	4.88
148	600022	山东钢铁	583,667.00	4.82
149	600352	浙江龙盛	582,936.00	4.81
150	601618	中国中冶	574,506.00	4.74
151	000698	沈阳化工	565,536.00	4.67
152	600808	马钢股份	564,673.00	4.66
153	000059	华锦股份	563,131.00	4.65
154	601233	桐昆股份	559,206.30	4.61
155	600823	世茂股份	558,841.00	4.61
156	000759	中百集团	557,692.00	4.60
157	600231	凌钢股份	557,057.00	4.60
158	002386	天原集团	556,660.00	4.59
159	600348	阳泉煤业	555,259.00	4.58
160	600266	北京城建	554,524.00	4.57
161	001979	招商蛇口	554,338.00	4.57
162	600801	华新水泥	552,791.00	4.56
163	600166	福田汽车	551,789.00	4.55
164	600089	特变电工	549,748.00	4.54
165	600782	新钢股份	542,702.00	4.48
166	600325	华发股份	541,771.00	4.47
167	601898	中煤能源	540,819.00	4.46

168	600508	上海能源	540,793.00	4.46
169	601699	潞安环能	539,339.00	4.45
170	600685	中船防务	538,376.64	4.44
171	000898	鞍钢股份	535,822.00	4.42
172	600376	首开股份	534,841.00	4.41
173	000951	中国重汽	522,526.00	4.31
174	600665	天地源	520,549.00	4.29
175	601258	庞大集团	503,756.00	4.16
176	000793	华闻传媒	503,449.00	4.15
177	600690	青岛海尔	490,787.00	4.05
178	600373	中文传媒	488,543.00	4.03
179	600837	海通证券	488,394.00	4.03
180	000983	西山煤电	475,690.00	3.92
181	000768	中航飞机	449,445.00	3.71
182	002174	游族网络	446,881.00	3.69
183	300144	宋城演艺	436,275.59	3.60
184	601225	陕西煤业	427,465.00	3.53
185	600177	雅戈尔	426,673.00	3.52
186	002195	二三四五	423,668.00	3.50
187	300058	蓝色光标	418,718.00	3.45
188	601718	际华集团	417,226.00	3.44
189	000938	紫光股份	413,909.00	3.41
190	600221	海航控股	395,363.00	3.26
191	000977	浪潮信息	380,592.00	3.14
192	002456	欧菲光	362,935.00	2.99
193	600068	葛洲坝	361,033.00	2.98
194	601939	建设银行	352,222.00	2.91
195	601866	中远海发	342,250.00	2.82

196	600406	国电南瑞	340,158.00	2.81
197	002309	中利集团	339,535.00	2.80
198	000732	泰禾集团	331,949.00	2.74
199	600115	东方航空	326,890.00	2.70
200	000792	盐湖股份	323,143.00	2.67
201	600256	广汇能源	321,251.00	2.65
202	601928	凤凰传媒	298,566.00	2.46
203	002424	贵州百灵	296,554.00	2.45
204	000503	海虹控股	295,036.00	2.43
205	000555	神州信息	286,664.00	2.36
206	601555	东吴证券	286,141.00	2.36
207	300033	同花顺	285,164.00	2.35
208	002131	利欧股份	283,273.00	2.34
209	002230	科大讯飞	282,614.00	2.33
210	600697	欧亚集团	282,502.00	2.33
211	300072	三聚环保	280,402.56	2.31
212	601666	平煤股份	273,224.00	2.25
213	600170	上海建工	271,557.00	2.24
214	601919	中远海控	264,562.00	2.18
215	600703	三安光电	259,053.85	2.14
216	000627	天茂集团	254,766.00	2.10
217	600660	福耀玻璃	249,718.00	2.06
218	002739	万达电影	245,001.00	2.02

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	601166	兴业银行	11,652,091.00	96.13
2	601288	农业银行	7,982,280.00	65.85
3	000415	渤海金控	6,513,406.00	53.74
4	600015	华夏银行	6,064,092.00	50.03
5	601211	国泰君安	5,320,052.28	43.89
6	600873	梅花生物	4,955,847.92	40.89
7	601186	中国铁建	4,912,500.00	40.53
8	601818	光大银行	4,672,692.00	38.55
9	000402	金融街	4,396,000.00	36.27
10	600104	上汽集团	4,245,341.00	35.02
11	600060	海信电器	4,094,181.00	33.78
12	002241	歌尔股份	3,721,954.48	30.71
13	600816	安信信托	3,711,730.80	30.62
14	601328	交通银行	3,404,105.00	28.08
15	000001	平安银行	3,095,274.00	25.54
16	000776	广发证券	3,094,947.00	25.53
17	000651	格力电器	3,090,500.00	25.50
18	601318	中国平安	3,090,455.00	25.50
19	600383	金地集团	2,996,754.00	24.72
20	601601	中国太保	2,643,185.00	21.81
21	600582	天地科技	2,608,991.71	21.52
22	000069	华侨城 A	2,302,682.00	19.00
23	000686	东北证券	2,226,419.00	18.37
24	002475	立讯精密	2,151,193.66	17.75
25	000876	新希望	2,143,478.00	17.68
26	600900	长江电力	2,112,183.00	17.43
27	000002	万科 A	2,106,001.18	17.37

28	601390	中国中铁	2,033,758.35	16.78
29	601628	中国人寿	2,016,863.00	16.64
30	600893	航发动力	1,938,564.60	15.99
31	600016	民生银行	1,909,364.00	15.75
32	002142	宁波银行	1,864,737.60	15.38
33	002466	天齐锂业	1,839,325.00	15.17
34	600519	贵州茅台	1,792,616.00	14.79
35	600674	川投能源	1,784,901.00	14.73
36	601169	北京银行	1,741,023.00	14.36
37	000538	云南白药	1,729,963.00	14.27
38	600188	兖州煤业	1,705,577.00	14.07
39	600036	招商银行	1,647,257.00	13.59
40	300251	光线传媒	1,610,511.00	13.29
41	600795	国电电力	1,566,592.00	12.92
42	002202	金风科技	1,507,098.66	12.43
43	000039	中集集团	1,507,098.00	12.43
44	000963	华东医药	1,466,453.00	12.10
45	000858	五粮液	1,463,950.00	12.08
46	000156	华数传媒	1,461,678.08	12.06
47	601688	华泰证券	1,460,989.00	12.05
48	600704	物产中大	1,447,734.00	11.94
49	002500	山西证券	1,440,224.56	11.88
50	600028	中国石化	1,385,967.00	11.43
51	600271	航天信息	1,370,226.00	11.30
52	000338	潍柴动力	1,363,237.00	11.25
53	600518	康美药业	1,350,328.00	11.14
54	600030	中信证券	1,348,621.00	11.13
55	002183	怡亚通	1,330,955.80	10.98

56	000166	申万宏源	1,293,177.00	10.67
57	002024	苏宁云商	1,288,902.00	10.63
58	600362	江西铜业	1,274,091.00	10.51
59	000709	河钢股份	1,239,944.75	10.23
60	000423	东阿阿胶	1,199,464.00	9.90
61	300017	网宿科技	1,188,930.24	9.81
62	600018	上港集团	1,188,515.00	9.81
63	601800	中国交建	1,168,959.00	9.64
64	601668	中国建筑	1,128,751.00	9.31
65	600741	华域汽车	1,105,130.00	9.12
66	002027	分众传媒	1,094,904.00	9.03
67	000063	中兴通讯	1,081,915.00	8.93
68	000895	双汇发展	1,081,681.93	8.92
69	002568	百润股份	1,078,056.16	8.89
70	600153	建发股份	1,060,734.00	8.75
71	600066	宇通客车	1,053,794.00	8.69
72	600688	上海石化	1,050,645.00	8.67
73	600038	中直股份	1,044,057.18	8.61
74	601398	工商银行	1,038,987.00	8.57
75	600019	宝钢股份	1,033,573.00	8.53
76	600023	浙能电力	1,015,845.00	8.38
77	600309	万华化学	1,010,650.80	8.34
78	601899	紫金矿业	1,010,321.00	8.34
79	300070	碧水源	1,004,749.00	8.29
80	600048	保利地产	947,980.00	7.82
81	000671	阳光城	927,143.00	7.65
82	002470	金正大	925,252.00	7.63
83	002415	海康威视	917,157.00	7.57

84	600606	绿地控股	916,970.00	7.56
85	300182	捷成股份	891,520.04	7.36
86	601336	新华保险	854,439.00	7.05
87	600958	东方证券	842,121.00	6.95
88	300124	汇川技术	839,779.00	6.93
89	002074	国轩高科	829,733.00	6.85
90	600663	陆家嘴	827,141.00	6.82
91	002299	圣农发展	821,392.00	6.78
92	600340	华夏幸福	807,092.00	6.66
93	600648	外高桥	798,831.00	6.59
94	600332	白云山	795,475.00	6.56
95	000540	中天金融	782,241.00	6.45
96	600208	新潮中宝	772,180.00	6.37
97	601006	大秦铁路	770,241.00	6.35
98	000009	中国宝安	759,375.00	6.26
99	000917	电广传媒	750,306.00	6.19
100	600839	四川长虹	732,608.00	6.04
101	002304	洋河股份	727,540.00	6.00
102	300133	华策影视	726,049.00	5.99
103	601607	上海医药	711,252.00	5.87
104	000333	美的集团	709,858.00	5.86
105	601600	中国铝业	703,510.00	5.80
106	600588	用友网络	680,334.76	5.61
107	600649	城投控股	668,221.00	5.51
108	601155	新城控股	639,004.00	5.27
109	000830	鲁西化工	636,447.00	5.25
110	002236	大华股份	627,127.00	5.17
111	600755	厦门国贸	619,468.00	5.11

112	002007	华兰生物	611,885.00	5.05
113	000900	现代投资	609,290.00	5.03
114	600498	烽火通信	607,088.00	5.01
115	600837	海通证券	605,385.00	4.99
116	600352	浙江龙盛	594,956.00	4.91
117	000425	徐工机械	592,756.00	4.89
118	001979	招商蛇口	588,862.00	4.86
119	000157	中联重科	588,354.00	4.85
120	601888	中国国旅	587,368.08	4.85
121	000926	福星股份	579,560.00	4.78
122	600966	博汇纸业	575,006.10	4.74
123	000826	启迪桑德	574,622.52	4.74
124	600022	山东钢铁	572,812.00	4.73
125	601333	广深铁路	566,468.00	4.67
126	000793	华闻传媒	559,961.00	4.62
127	000825	太钢不锈	559,509.00	4.62
128	000966	长源电力	557,548.00	4.60
129	600039	四川路桥	551,976.00	4.55
130	000059	华锦股份	549,811.00	4.54
131	600231	凌钢股份	545,620.90	4.50
132	000759	中百集团	545,311.00	4.50
133	600376	首开股份	542,903.57	4.48
134	000898	鞍钢股份	541,723.00	4.47
135	600808	马钢股份	540,774.00	4.46
136	600276	恒瑞医药	539,978.00	4.45
137	000698	沈阳化工	537,872.00	4.44
138	600823	世茂股份	537,311.00	4.43
139	601618	中国中冶	536,701.00	4.43

140	601898	中煤能源	531,667.00	4.39
141	600325	华发股份	531,167.00	4.38
142	600782	新钢股份	530,890.00	4.38
143	002065	东华软件	527,707.00	4.35
144	600348	阳泉煤业	527,171.00	4.35
145	600508	上海能源	527,124.00	4.35
146	600801	华新水泥	522,626.34	4.31
147	600089	特变电工	522,348.00	4.31
148	600266	北京城建	521,497.00	4.30
149	601233	桐昆股份	521,128.96	4.30
150	002386	天原集团	517,056.00	4.27
151	600166	福田汽车	514,181.00	4.24
152	600690	青岛海尔	512,008.00	4.22
153	000951	中国重汽	510,719.00	4.21
154	000625	长安汽车	506,004.00	4.17
155	601699	潞安环能	494,084.00	4.08
156	600875	东方电气	490,423.00	4.05
157	600031	三一重工	483,900.00	3.99
158	600665	天地源	479,854.00	3.96
159	601939	建设银行	474,326.00	3.91
160	600585	海螺水泥	471,627.00	3.89
161	300144	宋城演艺	461,134.36	3.80
162	000983	西山煤电	458,672.00	3.78
163	000623	吉林敖东	457,726.00	3.78
164	600009	上海机场	439,402.00	3.63
165	002081	金螳螂	437,767.00	3.61
166	002174	游族网络	430,994.76	3.56
167	600739	辽宁成大	419,354.00	3.46

168	002195	二三四五	409,977.00	3.38
169	000938	紫光股份	402,578.91	3.32
170	300058	蓝色光标	399,924.00	3.30
171	600221	海航控股	390,415.00	3.22
172	600685	中船防务	376,664.00	3.11
173	601088	中国神华	375,118.00	3.09
174	600373	中文传媒	372,303.00	3.07
175	600068	葛洲坝	369,522.00	3.05
176	000768	中航飞机	364,951.00	3.01
177	002456	欧菲光	361,933.00	2.99
178	601555	东吴证券	359,871.67	2.97
179	000977	浪潮信息	357,747.00	2.95
180	600660	福耀玻璃	350,542.00	2.89
181	002309	中利集团	347,046.00	2.86
182	600666	奥瑞德	330,772.00	2.73
183	601225	陕西煤业	329,519.00	2.72
184	002424	贵州百灵	316,885.00	2.61
185	601866	中远海发	314,235.00	2.59
186	600256	广汇能源	311,514.00	2.57
187	000732	泰禾集团	311,452.00	2.57
188	601258	庞大集团	309,589.00	2.55
189	000792	盐湖股份	301,332.00	2.49
190	600637	东方明珠	296,636.00	2.45
191	300033	同花顺	295,585.00	2.44
192	002310	东方园林	292,578.00	2.41
193	000800	一汽轿车	288,467.00	2.38
194	300072	三聚环保	286,956.44	2.37
195	600703	三安光电	284,724.00	2.35

196	601718	际华集团	284,145.00	2.34
197	002131	利欧股份	280,105.00	2.31
198	600697	欧亚集团	274,763.00	2.27
199	002230	科大讯飞	271,859.00	2.24
200	000627	天茂集团	268,978.00	2.22
201	601666	平煤股份	264,695.00	2.18
202	600170	上海建工	264,230.00	2.18
203	601857	中国石油	263,244.00	2.17
204	002739	万达电影	261,283.00	2.16
205	002714	牧原股份	257,131.00	2.12
206	000555	神州信息	252,039.60	2.08

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	388,290,609.09
卖出股票收入（成交）总额	267,503,338.93

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,837.78
2	应收证券清算款	91,673.33
3	应收股利	-
4	应收利息	3,104.08
5	应收申购款	2,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	193,615.19

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600666	奥瑞德	1,130,304.00	0.75	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
安 信 沪 深 300 增 强 A	54	2,546,146.04	135,941,512.46	98.87%	1,550,373.81	1.13%
安 信 沪 深 300 增 强 C	63	11,578.38	0.00	0.00%	729,437.79	100.00%
合计	117	1,181,378.84	135,941,512.46	98.35%	2,279,811.60	1.65%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	安信沪深 300 增强A	-	0.0000%
	安信沪深 300 增强C	-	0.0000%
	合计	-	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	安信沪深 300 增强 A	0
	安信沪深 300 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	安信沪深 300 增强 A	0
	安信沪深 300 增强 C	0
	合计	0

8.4 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	7.23	10,000,000.00	7.23	3 年
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	10,000,000.00	7.23	10,000,000.00	7.23	3 年

§ 9 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）基金 份额总额	12,550,364.95	63,773.37
本报告期期初基金份额总额	11,660,258.21	382,894.00
本报告期基金总申购份额	135,495,939.37	1,155,650.44
减：本报告期基金总赎回份额	9,664,311.31	809,106.65
本报告期期末基金份额总额	137,491,886.27	729,437.79

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
长江证券	2	633,584,534.22	96.66%	450,671.50	96.66%	-
安信证券	2	21,889,491.65	3.34%	15,570.71	3.34%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于安信基金管理有限责任公司参加代销机构费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017年1月13日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下鼎龙股份估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017年1月14日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下先导智能估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017年1月17日
4	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	上海证券报	2017年1月21日
5	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机	上海证券报	2017年1月25日

	构的公告		
6	关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告	上海证券报	2017 年 2 月 18 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下东方网力估值调整的公告	证券时报	2017 年 3 月 7 日
8	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台易购通渠道部分银行卡暂停开户及增卡业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 3 月 8 日
9	安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 3 月 15 日
10	关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 3 月 24 日
11	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加张家港农村商业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 3 月 30 日
12	安信基金管理有限责任公司关于临时暂停 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 4 月 13 日
13	安信基金管理有限责任公司关于恢复 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 4 月 18 日
14	关于安信基金管理有限责任公司	上海证券报、中国证券报、	2017 年 4 月 18 日

	从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告	证券时报	
15	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	中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 22 日
16	关于暂停安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 27 日
17	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
18	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加上海陆金所资产管理有限公司基金认购、申购、定投进行费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 3 日
19	安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 18 日
20	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加武汉市伯嘉基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 25 日
21	安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 26 日
22	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持国电南瑞（600406）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 2 日

	估值调整的公告		
23	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台增加中国民生银行股份有限公司厦门分行第三方支付业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
24	安信基金管理有限责任公司关于增加基金直销账户的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
25	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20170101-20170420	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	7.23%
	2	20170421-20170630	-	58,335,756.23	-	58,335,756.23	42.20%
	3	20170421-20170630	-	67,605,756.23	-	67,605,756.23	48.91%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 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 8 月 24 日