

安信沪深 300 指数增强型发起式  
证券投资基金  
2017 年年度报告摘要

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## §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 2018 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	71,894,975.47 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	69,257,923.42 份	2,637,052.05 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。
--------	--

### 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年 10 月 12 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	安信沪深增强 A	安信沪深增强 C	安信沪深增强 A	安信沪深增强 C
本期已实现收益	24,586,539.12	342,537.74	476,519.06	10,420.88
本期利润	29,764,751.79	168,643.18	132,836.38	-17,026.82
加权平均基金份额本期利润	0.2964	0.1654	0.0109	-0.0856
本期基金份额净	24.67%	24.27%	0.65%	0.62%

值增长率				
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2313	0.2268	0.0065	0.0062
期末基金资产净值	86,902,629.49	3,297,290.99	11,735,992.69	385,278.97
期末基金份额净值	1.2548	1.2504	1.0065	1.0062

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。

### 3.2 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

安信沪深增强 A

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
过去三个月	9.41%	0.84%	5.21%	0.76%	4.20%	0.08%
过去六个月	15.78%	0.73%	10.25%	0.66%	5.53%	0.07%
过去一年	24.67%	0.68%	22.43%	0.61%	2.24%	0.07%
自基金合同生效起至今	25.48%	0.67%	22.97%	0.62%	2.51%	0.05%

安信沪深增强 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
过去三个月	9.27%	0.84%	5.21%	0.76%	4.06%	0.08%
过去六个月	15.45%	0.74%	10.25%	0.66%	5.20%	0.08%

过去一年	24.27%	0.68%	22.43%	0.61%	1.84%	0.07%
自基金合同生效起至今	25.04%	0.67%	22.97%	0.62%	2.07%	0.05%

注：业绩比较基准收益率=95%×沪深 300 指数收益率+1.5%。本基金为指数增强基金，标的指数为沪深 300 指数，因此业绩比较基准以沪深 300 指数收益率为主要组成部分。

### 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

安信沪深增强A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



安信沪深增强C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

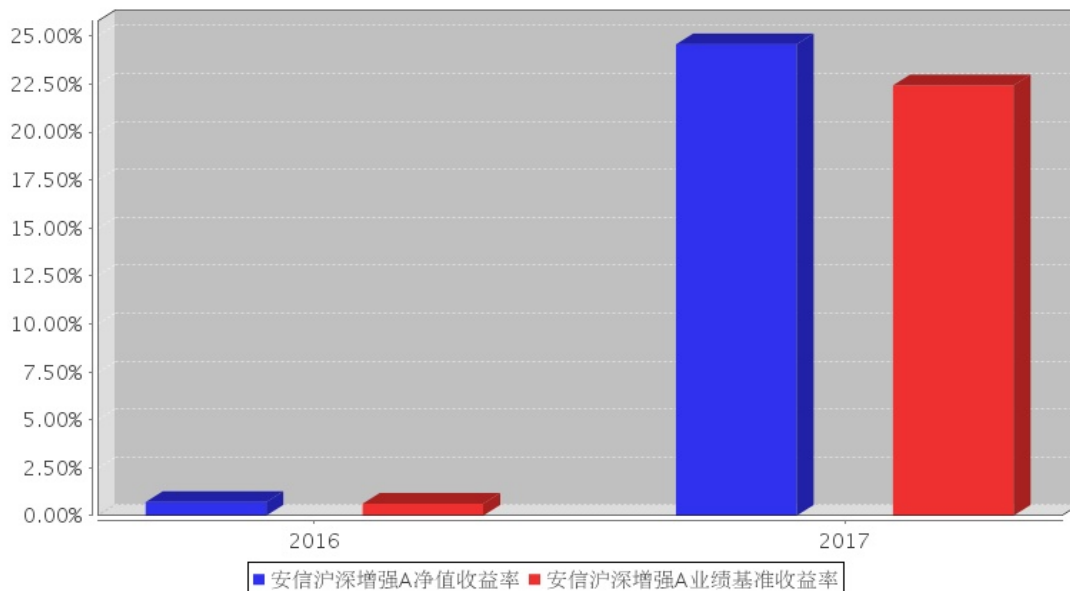


注：1、本基金合同生效日为 2016 年 10 月 12 日。

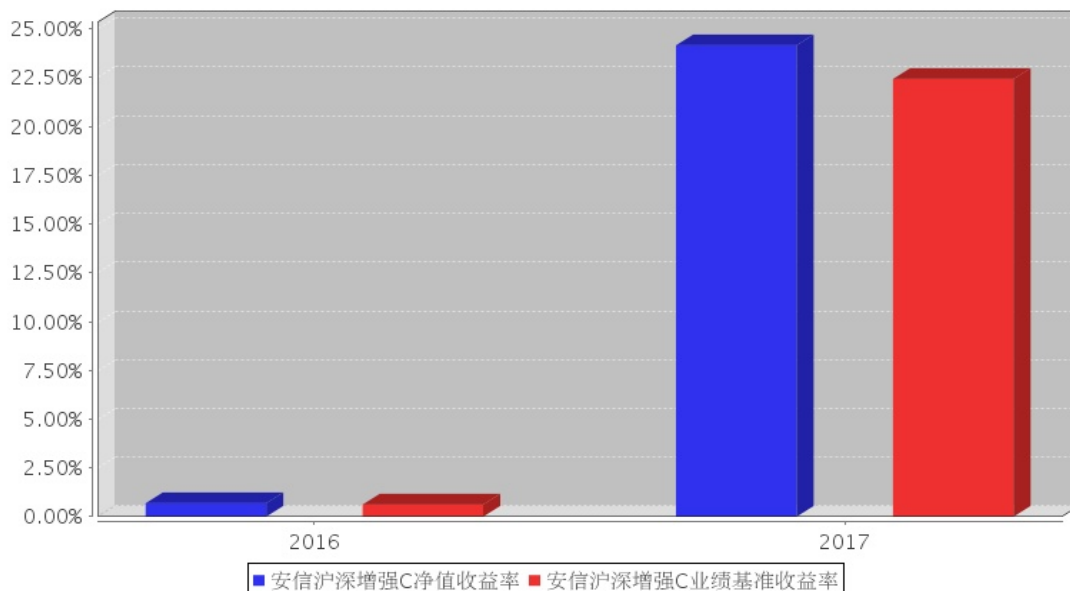
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信沪深增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信沪深增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2016 年 10 月 12 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

## §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 5.0625 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 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 38 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；从 2017 年 7 月 3 日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 20 日起管理安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 12 月 6 日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金；从 2017 年 12 月 28 日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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	-	15.0 年	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、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信基金稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理助理	2016 年 10 月 24 日	-	4.0 年	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 公平交易制度和控制方法

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 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。

### 4.3.3 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，A 股市场结构性牛市突出，一系列新特征新逻辑凸显。从贵州茅台借护城河之力一骑绝尘，到科大讯飞凭新兴产业的科技实力大力发展，再到传统的大盘股如煤钢产业，依靠改革与转型之力亦迅速成长为重要投资标的，这些都是今年 A 股市场的重要特征。上半年，在补库存、房地产和基建投资拉动下经济回暖，工业企业利润增速有所抬升。A 股行业指数涨幅出现较大分化，盈利增长确定性较高的家电、食品饮料涨幅居前，而军工、农林牧渔、计算机等行业则跌幅较深，整体市场风格偏向稳定的消费板块。下半年，环保限产带来的供给收缩刺激上游

行业盈利大幅改善，资源品行业涨幅居前，结构上继续出现分化，大盘股、消费股与优质成长股表现较好，小盘股、概念股表现依然低迷。其中白酒、家电、创新药、地产以及部分周期行业表现相对抢眼。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。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，在控制跟踪误差的基础上，积极获取超额收益。

#### 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 1.2548 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.67%；截至本报告期末安信沪深增强 C 基金份额净值为 1.2504 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.27%；同期业绩比较基准收益率为 22.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新公布的经济数据和进出口数据（PMI 微降 0.2 个百分点，新出口订单和进口指数分别上升 1.1 和 0.2 个百分点）都说明经济的韧性较强，其中高科技制造业和消费类行业改善最为明显，PMI 分别上升 0.6 和 2.3 个百分点。2017 年 12 月份市场已经企稳，不确定性减弱，年底机构调仓换股也顺势完成，中央经济工作会议的召开指明了 2018 年的经济发展方向，重点支持制造业的发展和推动消费对经济的基础性作用，2018 年一季度 CPI 大概率上行，虽然市场全面大反弹的可能性较小，但是 2018 年 1 月份随着资金的回补，国家政策支持制造业和消费方向以及通胀预期的概念板块可能获得资金的青睐。

#### 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

基金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，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。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。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，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### **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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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，且基金合同生效未满 3 年，故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 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容, 应阅读年度报告正文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,448,317.02	998,093.00
结算备付金	977,794.93	108,497.03
存出保证金	20,449.56	11,663.33
交易性金融资产	88,055,837.43	11,159,263.00
其中：股票投资	84,261,537.43	11,159,263.00
基金投资	-	-
债券投资	3,794,300.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	261,922.65	-
应收利息	86,887.82	275.68
应收股利	-	-
应收申购款	36,982.60	2,925.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	90,888,192.01	12,280,717.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	80,676.98	480.93
应付管理人报酬	127,453.16	10,462.84
应付托管费	25,490.64	2,092.57
应付销售服务费	1,534.16	166.29
应付交易费用	313,091.29	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	140,025.30	113,805.56
负债合计	688,271.53	159,445.90
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	71,894,975.47	12,043,152.21
未分配利润	18,304,945.01	78,119.45
所有者权益合计	90,199,920.48	12,121,271.66
负债和所有者权益总计	90,888,192.01	12,280,717.56

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，安信沪深增强 A 基金份额净值 1.2548 元，基金份额总额 69,257,923.42 份；安信沪深增强 C 基金份额净值 1.2504 元，基金份额总额 2,637,052.05 份。安信沪深 300 发起式份额总额合计为 71,894,975.47 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元



项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	33,565,812.44	317,450.03
1.利息收入	156,548.96	7,296.77
其中：存款利息收入	55,037.28	7,296.77
债券利息收入	101,511.68	-
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）	28,172,680.86	676,671.72
其中：股票投资收益	26,011,590.13	676,376.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,240.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,153,850.73	295.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,004,318.11	-371,130.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	232,264.51	4,611.92
<b>减：二、费用</b>	3,632,417.47	201,640.47
1. 管理人报酬	1,122,513.77	27,751.66
2. 托管费	224,502.73	5,550.33
3. 销售服务费	5,748.33	221.57
4. 交易费用	2,126,983.75	53,545.75
5. 利息支出	-	-

其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	152,668.89	114,571.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>29,933,394.97</b>	<b>115,809.56</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>29,933,394.97</b>	<b>115,809.56</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	29,933,394.97	29,933,394.97
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）	59,851,823.26	-11,706,569.41	48,145,253.85
其中：1. 基金申购款	179,233,607.63	11,140,709.83	190,374,317.46
2. 基金赎回款	-119,381,784.37	-22,847,279.24	-142,229,063.61
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）	71,894,975.47	18,304,945.01	90,199,920.48
项目	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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）	12,614,138.32	-	12,614,138.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,809.56	115,809.56
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）	-570,986.11	-37,690.11	-608,676.22
其中：1. 基金申购款	573,332.33	30,704.77	604,037.10
2. 基金赎回款	-1,144,318.44	-68,394.88	-1,212,713.32
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）	12,043,152.21	78,119.45	12,121,271.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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\_H66 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 12,612,828.84 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 12,612,828.84 元，折合 12,612,828.84 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 12,549,078.84 元，折合 12,549,078.84 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 12,614,138.32 元，折合 12,614,138.32 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）

#### 7.4.2 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

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 税项

#### 7.4.5.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

#### 7.4.5.2 企业所得税

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。

#### 7.4.5.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《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]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后

月份的增值税应纳税额中抵减；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；存款利息收入不征收增值税。

#### 7.4.5.4 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、债券的利息及储蓄利息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，暂减按 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。

#### 7.4.6 关联方关系

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、根据本基金管理人子公司安信乾盛股东会的有关决议，安信乾盛将其持有 100% 股权子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司进行解散并清算注销，上述注销登记手续已于 2017 年 11 月 30 日在深圳市场监督管理局办理完毕。

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。

## 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.7.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
安信证券	21,889,491.65	1.33%	51,050.00	0.11%

#### 7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.7.1.5 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 12 月 31 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	1.32%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 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	36.32	0.11%	36.32	0.11%

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。

## 7.4.7.2 关联方报酬

### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合同生效 日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,122,513.77	27,751.66
其中：支付销售机构的 客户维护费	19,651.41	3,122.69

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

### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合同生效 日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	224,502.73	5,550.33

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

### 7.4.7.2.3 销售服务费

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 12 月 31 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	-	292.04	292.04
安信基金	-	24.37	24.37
安信证券	-	75.81	75.81
合计	-	392.22	392.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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	-	13.98	13.98
安信证券	-	5.60	5.60
合计	-	19.58	19.58

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.50%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.7.4.1 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 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
		安信沪深增强 A
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	13.91%	-
项目	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日
		安信沪深增强 A
基金合同生效日（2016-10-12）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	83.03%	-

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。

#### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 10 月 12 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行	1,448,317.02	41,632.63	998,093.00	6,904.90
------	--------------	-----------	------------	----------

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。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.8 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 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

7.4.12.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

002466	天齐 锂业	2017 年 12 月 26 日	2018 年 1 月 3 日	配股未 上市	11.06	53.21	1,125	12,442.50	59,861.25	-
--------	----------	------------------------	-------------------------	-----------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

#### 7.4.8.2 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
000540	中天 金融	2017 年 8 月 21 日	重大 事项	7.35	-	-	227,500	1,629,070.17	1,672,125.00	-
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	-
600309	万华 化学	2017 年 12 月 5 日	重大 事项	37.94	-	-	29,360	1,005,116.91	1,113,918.40	-
000900	现代 投资	2017 年 10 月 27 日	重大 事项	6.25	-	-	35,400	219,703.28	221,250.00	-
600332	白云 山	2017 年 10 月	重大 事项	32.14	2018 年 1 月 8 日	30.15	6,500	179,906.81	208,910.00	-

		31 日								
300730	科创 信息	2017 年 12 月 25 日	价格 异常 波动	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣 健康	2017 年 12 月 28 日	价格 异常 波动	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
600485	信威 集团	2016 年 12 月 26 日	重大 事项	14.59	-	-	500	8,619.42	7,295.00	-

### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 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，无抵押债券。

#### 7.4.8.3.2 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，无抵押债券。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	84,261,537.43	92.71

	其中：股票	84,261,537.43	92.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,794,300.00	4.17
	其中：债券	3,794,300.00	4.17
	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	2,426,111.95	2.67
8	其他各项资产	406,242.63	0.45
9	合计	90,888,192.01	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	718,896.00	0.80
B	采矿业	2,634,487.48	2.92
C	制造业	29,353,577.42	32.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	229,050.00	0.25
E	建筑业	2,038,620.00	2.26
F	批发和零售业	3,279,898.92	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,660,911.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	828,827.00	0.92

J	金融业	27,393,534.62	30.37
K	房地产业	4,438,256.40	4.92
L	租赁和商务服务业	2,111,650.00	2.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,298,121.00	1.44
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	695,833.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	76,681,662.84	85.01

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	798,637.00	0.89
C	制造业	4,704,676.56	5.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	239,192.76	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,096,383.55	1.22
J	金融业	-	-
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	32,323.20	0.04
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	692,518.32	0.77
	合计	7,579,874.59	8.40

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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前十名股票投资明细

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	000725	京东方 A	711,100	4,117,269.00	4.56
2	601318	中国平安	57,300	4,009,854.00	4.45
3	000651	格力电器	91,000	3,976,700.00	4.41
4	600519	贵州茅台	5,100	3,557,199.00	3.94
5	600036	招商银行	119,139	3,457,413.78	3.83
6	601601	中国太保	61,446	2,545,093.32	2.82
7	000538	云南白药	21,400	2,178,306.00	2.41
8	601166	兴业银行	110,500	1,877,395.00	2.08
9	002024	苏宁云商	152,700	1,876,683.00	2.08
10	600837	海通证券	139,200	1,791,504.00	1.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。



### 8.3.2 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前十名股票投资明细

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	600666	奥瑞德	64,960	1,130,304.00	1.25
2	000009	中国宝安	95,784	692,518.32	0.77
3	600971	恒源煤电	59,400	619,542.00	0.69
4	600282	南钢股份	123,800	599,192.00	0.66
5	000761	本钢板材	115,000	598,000.00	0.66
6	000825	太钢不锈	115,300	571,888.00	0.63
7	000786	北新建材	22,500	506,250.00	0.56
8	002195	二三四五	86,600	505,744.00	0.56
9	000917	电广传媒	50,100	453,906.00	0.50
10	002152	广电运通	49,940	371,553.60	0.41

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	000651	格力电器	24,542,969.00	202.48
2	601166	兴业银行	21,852,185.00	180.28
3	600015	华夏银行	19,139,470.44	157.90
4	601288	农业银行	17,749,727.00	146.43
5	600030	中信证券	17,212,494.22	142.00
6	600016	民生银行	16,210,379.00	133.73
7	601318	中国平安	15,390,277.55	126.97
8	000725	京东方 A	15,386,732.00	126.94

9	600036	招商银行	14,792,637.32	122.04
10	601211	国泰君安	14,738,743.00	121.59
11	601601	中国太保	14,154,805.24	116.78
12	000338	潍柴动力	13,745,710.00	113.40
13	000858	五 粮 液	10,123,265.00	83.52
14	600519	贵州茅台	10,118,166.29	83.47
15	000001	平安银行	9,692,795.98	79.97
16	601328	交通银行	9,684,766.00	79.90
17	000063	中兴通讯	9,250,618.00	76.32
18	000333	美的集团	9,244,119.00	76.26
19	000415	渤海金控	8,916,226.00	73.56
20	600837	海通证券	8,674,552.00	71.56
21	002466	天齐锂业	8,193,311.68	67.59
22	601818	光大银行	8,087,245.00	66.72
23	000402	金 融 街	7,933,283.00	65.45
24	601628	中国人寿	7,662,266.00	63.21
25	000776	广发证券	7,620,100.00	62.87
26	002304	洋河股份	7,106,525.00	58.63
27	600606	绿地控股	7,052,398.00	58.18
28	600340	华夏幸福	7,049,988.94	58.16
29	601186	中国铁建	6,970,513.00	57.51
30	000009	中国宝安	6,399,946.72	52.80
31	000538	云南白药	6,252,556.00	51.58
32	600816	安信信托	6,216,227.62	51.28
33	002310	东方园林	6,165,787.00	50.87
34	600104	上汽集团	6,059,469.00	49.99
35	000895	双汇发展	6,018,995.61	49.66
36	601336	新华保险	5,986,330.88	49.39

37	000876	新希望	5,903,554.00	48.70
38	002202	金风科技	5,900,035.06	48.68
39	600060	海信电器	5,819,190.00	48.01
40	002027	分众传媒	5,797,346.00	47.83
41	002024	苏宁云商	5,476,179.00	45.18
42	600873	梅花生物	5,111,575.00	42.17
43	002081	金螳螂	5,043,001.00	41.60
44	000069	华侨城 A	4,991,519.00	41.18
45	000709	河钢股份	4,967,896.00	40.98
46	002065	东华软件	4,576,491.76	37.76
47	000423	东阿阿胶	4,562,544.00	37.64
48	002008	大族激光	4,550,174.00	37.54
49	000917	电广传媒	4,431,535.25	36.56
50	002465	海格通信	4,384,440.00	36.17
51	000623	吉林敖东	4,343,123.00	35.83
52	601398	工商银行	4,333,977.00	35.76
53	600208	新湖中宝	4,320,897.00	35.65
54	000625	长安汽车	4,225,023.00	34.86
55	601668	中国建筑	4,194,164.00	34.60
56	600585	海螺水泥	4,110,117.90	33.91
57	600900	长江电力	4,022,553.00	33.19
58	000686	东北证券	3,825,298.00	31.56
59	601390	中国中铁	3,789,847.00	31.27
60	600383	金地集团	3,754,618.00	30.98
61	600663	陆家嘴	3,728,524.26	30.76
62	002142	宁波银行	3,649,746.00	30.11
63	002241	歌尔股份	3,608,253.53	29.77
64	600019	宝钢股份	3,539,103.32	29.20

65	600028	中国石化	3,519,944.30	29.04
66	000157	中联重科	3,343,023.00	27.58
67	300144	宋城演艺	3,289,841.59	27.14
68	600109	国金证券	3,260,882.78	26.90
69	000540	中天金融	3,258,279.00	26.88
70	601225	陕西煤业	3,245,975.00	26.78
71	600518	康美药业	3,234,683.00	26.69
72	600958	东方证券	3,217,609.00	26.55
73	600674	川投能源	3,148,028.00	25.97
74	000983	西山煤电	3,137,469.00	25.88
75	600188	兖州煤业	3,113,011.68	25.68
76	000793	华闻传媒	3,095,358.00	25.54
77	600276	恒瑞医药	3,046,062.00	25.13
78	000100	TCL 集团	2,953,761.00	24.37
79	002152	广电运通	2,923,341.80	24.12
80	600362	江西铜业	2,861,821.20	23.61
81	000060	中金岭南	2,841,005.00	23.44
82	600582	天地科技	2,832,247.00	23.37
83	601688	华泰证券	2,750,723.04	22.69
84	000839	中信国安	2,635,513.00	21.74
85	002500	山西证券	2,624,860.00	21.65
86	600704	物产中大	2,623,351.99	21.64
87	601088	中国神华	2,592,442.00	21.39
88	600971	恒源煤电	2,542,769.00	20.98
89	600309	万华化学	2,495,471.20	20.59
90	002252	上海莱士	2,494,392.00	20.58
91	600048	保利地产	2,466,909.00	20.35
92	600271	航天信息	2,465,161.00	20.34

93	002470	金正大	2,425,367.00	20.01
94	600741	华域汽车	2,414,085.00	19.92
95	000825	太钢不锈	2,408,538.00	19.87
96	601800	中国交建	2,332,866.71	19.25
97	600739	辽宁成大	2,273,702.00	18.76
98	000002	万科A	2,273,339.00	18.75
99	601169	北京银行	2,254,095.00	18.60
100	000627	天茂集团	2,235,495.00	18.44
101	000671	阳光城	2,229,833.00	18.40
102	000425	徐工机械	2,218,176.00	18.30
103	600516	方大炭素	2,215,965.96	18.28
104	002475	立讯精密	2,197,007.00	18.13
105	601099	太平洋	2,191,041.00	18.08
106	601155	新城控股	2,180,968.00	17.99
107	601699	潞安环能	2,152,133.00	17.76
108	000761	本钢板材	2,151,935.99	17.75
109	002714	牧原股份	2,145,383.00	17.70
110	002074	国轩高科	2,040,511.00	16.83
111	601788	光大证券	2,033,893.32	16.78
112	002508	老板电器	2,016,557.00	16.64
113	600893	航发动力	2,005,477.00	16.55
114	600153	建发股份	1,984,997.73	16.38
115	601006	大秦铁路	1,966,709.00	16.23
116	600089	特变电工	1,964,920.00	16.21
117	600018	上港集团	1,962,855.00	16.19
118	600755	厦门国贸	1,918,873.00	15.83
119	000778	新兴铸管	1,875,602.00	15.47
120	002183	怡亚通	1,833,372.80	15.13

121	601857	中国石油	1,810,956.00	14.94
122	600348	阳泉煤业	1,797,880.00	14.83
123	601899	紫金矿业	1,796,388.00	14.82
124	600066	宇通客车	1,788,388.00	14.75
125	600782	新钢股份	1,785,995.00	14.73
126	601766	中国中车	1,747,129.00	14.41
127	000059	华锦股份	1,743,646.00	14.39
128	600688	上海石化	1,742,674.00	14.38
129	000898	鞍钢股份	1,738,446.00	14.34
130	000963	华东医药	1,737,037.00	14.33
131	600031	三一重工	1,736,342.00	14.32
132	300017	网宿科技	1,725,565.00	14.24
133	600068	葛洲坝	1,724,049.00	14.22
134	000166	申万宏源	1,712,264.00	14.13
135	600808	马钢股份	1,702,744.00	14.05
136	300251	光线传媒	1,701,167.00	14.03
137	600009	上海机场	1,700,581.00	14.03
138	600637	东方明珠	1,669,045.00	13.77
139	601888	中国国旅	1,646,481.00	13.58
140	600023	浙能电力	1,617,786.00	13.35
141	000698	沈阳化工	1,616,866.00	13.34
142	000900	现代投资	1,590,587.00	13.12
143	600050	中国联通	1,582,947.00	13.06
144	000039	中集集团	1,565,979.00	12.92
145	600170	上海建工	1,559,847.00	12.87
146	000156	华数传媒	1,557,960.40	12.85
147	000830	鲁西化工	1,556,387.00	12.84
148	002195	二三四五	1,542,384.00	12.72

149	600690	青岛海尔	1,540,548.00	12.71
150	600221	海航控股	1,538,176.00	12.69
151	600022	山东钢铁	1,517,748.00	12.52
152	600649	城投控股	1,513,270.40	12.48
153	600325	华发股份	1,512,772.00	12.48
154	002558	巨人网络	1,499,104.00	12.37
155	300070	碧水源	1,487,579.00	12.27
156	601666	平煤股份	1,484,048.00	12.24
157	601607	上海医药	1,470,872.08	12.13
158	600666	奥瑞德	1,451,722.00	11.98
159	600795	国电电力	1,446,825.00	11.94
160	601233	桐昆股份	1,442,970.30	11.90
161	000786	北新建材	1,438,581.00	11.87
162	000959	首钢股份	1,409,222.44	11.63
163	601618	中国中冶	1,403,346.00	11.58
164	600282	南钢股份	1,402,530.00	11.57
165	300027	华谊兄弟	1,388,421.00	11.45
166	600720	祁连山	1,356,081.00	11.19
167	002568	百润股份	1,298,798.00	10.72
168	000800	一汽轿车	1,281,512.00	10.57
169	000926	福星股份	1,250,646.00	10.32
170	601989	中国重工	1,200,891.00	9.91
171	600231	凌钢股份	1,183,494.00	9.76
172	000488	晨鸣纸业	1,175,714.00	9.70
173	600039	四川路桥	1,171,065.00	9.66
174	600705	中航资本	1,133,579.54	9.35
175	600308	华泰股份	1,130,957.00	9.33
176	600029	南方航空	1,126,686.00	9.30

177	002352	顺丰控股	1,121,758.00	9.25
178	600966	博汇纸业	1,101,005.85	9.08
179	600038	中直股份	1,099,829.48	9.07
180	002299	圣农发展	1,067,499.00	8.81
181	600332	白云山	1,035,093.00	8.54
182	300124	汇川技术	1,016,044.00	8.38
183	000966	长源电力	979,544.00	8.08
184	002415	海康威视	943,176.00	7.78
185	600839	四川长虹	942,006.00	7.77
186	600859	王府井	938,850.00	7.75
187	601600	中国铝业	938,616.00	7.74
188	600335	国机汽车	934,513.00	7.71
189	601898	中煤能源	927,199.00	7.65
190	600823	世茂股份	919,032.00	7.58
191	600057	象屿股份	906,962.00	7.48
192	600642	申能股份	902,468.00	7.45
193	600694	大商股份	895,373.00	7.39
194	600373	中文传媒	891,581.00	7.36
195	300182	捷成股份	890,428.00	7.35
196	600123	兰花科创	872,118.00	7.19
197	600522	中天科技	855,413.00	7.06
198	000826	启迪桑德	845,667.00	6.98
199	600327	大东方	843,359.00	6.96
200	600338	西藏珠峰	831,171.00	6.86
201	601992	金隅股份	812,746.00	6.71
202	600648	外高桥	790,293.00	6.52
203	600177	雅戈尔	778,815.00	6.43
204	600418	江淮汽车	768,928.00	6.34



205	300133	华策影视	763,029.00	6.29
206	600697	欧亚集团	752,331.90	6.21
207	000732	泰禾集团	737,678.00	6.09
208	000061	农产品	736,650.00	6.08
209	001979	招商蛇口	734,804.00	6.06
210	600588	用友网络	724,007.28	5.97
211	002236	大华股份	691,961.00	5.71
212	600508	上海能源	686,369.00	5.66
213	600997	开滦股份	676,381.00	5.58
214	601117	中国化学	674,647.00	5.57
215	002839	张家港行	668,153.00	5.51
216	002309	中利集团	665,698.00	5.49
217	600366	宁波韵升	662,837.00	5.47
218	600875	东方电气	661,952.00	5.46
219	600219	南山铝业	661,450.00	5.46
220	600685	中船防务	658,145.64	5.43
221	000612	焦作万方	650,551.00	5.37
222	601333	广深铁路	637,571.00	5.26
223	600498	烽火通信	632,624.00	5.22
224	000422	湖北宜化	631,618.00	5.21
225	002007	华兰生物	629,025.00	5.19
226	600256	广汇能源	600,036.00	4.95
227	002831	裕同科技	586,659.00	4.84
228	600352	浙江龙盛	582,936.00	4.81
229	000550	江铃汽车	580,476.00	4.79
230	000589	黔轮胎 A	574,500.00	4.74
231	600392	盛和资源	572,658.00	4.72
232	000768	中航飞机	568,478.00	4.69

233	600708	光明地产	560,384.00	4.62
234	000759	中百集团	557,692.00	4.60
235	002386	天原集团	556,660.00	4.59
236	600266	北京城建	554,524.00	4.57
237	600801	华新水泥	552,791.00	4.56
238	600166	福田汽车	551,789.00	4.55
239	600827	百联股份	544,845.28	4.49
240	601718	际华集团	541,864.00	4.47
241	000938	紫光股份	539,574.00	4.45
242	600020	中原高速	538,598.00	4.44
243	600100	同方股份	537,392.00	4.43
244	600376	首开股份	534,841.00	4.41
245	601669	中国电建	527,303.00	4.35
246	000951	中国重汽	522,526.00	4.31
247	600665	天地源	520,549.00	4.29
248	600810	神马股份	519,795.00	4.29
249	002456	欧菲科技	510,440.00	4.21
250	000977	浪潮信息	503,926.00	4.16
251	601258	庞大集团	503,756.00	4.16
252	600475	华光股份	493,022.00	4.07
253	600291	西水股份	477,588.00	3.94
254	600449	宁夏建材	471,851.00	3.89
255	002087	新野纺织	468,811.00	3.87
256	600126	杭钢股份	452,886.00	3.74
257	600660	福耀玻璃	452,176.00	3.73
258	002174	游族网络	446,881.00	3.69
259	600051	宁波联合	445,090.00	3.67
260	600804	鹏博士	439,958.00	3.63

261	000792	盐湖股份	439,216.00	3.62
262	600415	小商品城	436,310.00	3.60
263	002131	利欧股份	430,309.00	3.55
264	000708	大冶特钢	424,650.00	3.50
265	300058	蓝色光标	418,718.00	3.45
266	000555	神州信息	415,460.00	3.43
267	002230	科大讯飞	412,887.00	3.41
268	600122	宏图高科	407,996.00	3.37
269	001896	豫能控股	394,610.00	3.26
270	601998	中信银行	393,353.00	3.25
271	300072	三聚环保	375,061.56	3.09
272	300033	同花顺	373,356.00	3.08
273	600657	信达地产	372,168.00	3.07
274	000568	泸州老窖	369,301.00	3.05
275	600011	华能国际	367,937.00	3.04
276	601939	建设银行	352,222.00	2.91
277	600067	冠城大通	347,003.00	2.86
278	601866	中远海发	342,250.00	2.82
279	600115	东方航空	340,640.00	2.81
280	600406	国电南瑞	340,158.00	2.81
281	600565	迪马股份	331,213.00	2.73
282	000543	皖能电力	323,335.00	2.67
283	600569	安阳钢铁	316,745.00	2.61
284	601877	正泰电器	311,572.00	2.57
285	000539	粤电力 A	307,666.00	2.54
286	600361	华联综超	307,123.00	2.53
287	000961	中南建设	298,719.00	2.46
288	601928	凤凰传媒	298,566.00	2.46

289	600037	歌华有线	297,847.00	2.46
290	002424	贵州百灵	296,554.00	2.45
291	000503	海虹控股	295,036.00	2.43
292	601555	东吴证券	286,141.00	2.36
293	603160	汇顶科技	281,899.00	2.33
294	600682	南京新百	274,841.00	2.27
295	600743	华远地产	268,130.00	2.21
296	601111	中国国航	266,291.00	2.20
297	002092	中泰化学	264,836.00	2.18
298	601919	中远海控	264,562.00	2.18
299	600098	广州发展	263,804.00	2.18
300	600703	三安光电	259,053.85	2.14
301	603858	步长制药	255,901.00	2.11
302	600909	华安证券	252,091.00	2.08
303	002739	万达电影	245,001.00	2.02
304	002292	奥飞娱乐	243,368.00	2.01

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。

#### 8.4.2 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	000651	格力电器	22,197,893.28	183.13
2	601166	兴业银行	20,620,235.00	170.12
3	600015	华夏银行	18,483,166.00	152.49
4	600030	中信证券	17,970,143.00	148.25
5	601288	农业银行	17,254,847.00	142.35
6	601318	中国平安	16,429,873.61	135.55

7	600016	民生银行	16,280,746.82	134.32
8	601211	国泰君安	15,086,820.26	124.47
9	000725	京东方 A	14,478,949.00	119.45
10	600036	招商银行	14,222,548.00	117.34
11	601601	中国太保	13,761,767.98	113.53
12	000338	潍柴动力	12,210,912.00	100.74
13	000858	五 粮 液	12,022,893.00	99.19
14	000333	美的集团	11,199,912.00	92.40
15	000063	中兴通讯	10,606,002.00	87.50
16	002466	天齐锂业	9,490,954.00	78.30
17	000001	平安银行	9,330,764.00	76.98
18	600519	贵州茅台	8,449,807.00	69.71
19	601328	交通银行	8,132,493.00	67.09
20	000415	渤海金控	8,001,288.00	66.01
21	002304	洋河股份	7,335,883.50	60.52
22	601818	光大银行	6,969,383.00	57.50
23	000402	金 融 街	6,829,986.00	56.35
24	600340	华夏幸福	6,818,246.16	56.25
25	601628	中国人寿	6,805,092.00	56.14
26	000776	广发证券	6,796,626.00	56.07
27	601186	中国铁建	6,639,468.00	54.78
28	600837	海通证券	6,431,705.15	53.06
29	600104	上汽集团	6,371,681.00	52.57
30	600606	绿地控股	5,898,027.00	48.66
31	600816	安信信托	5,852,372.60	48.28
32	000009	中国宝安	5,753,496.50	47.47
33	002008	大族激光	5,363,883.00	44.25
34	000895	双汇发展	5,268,119.11	43.46

35	002027	分众传媒	5,235,912.40	43.20
36	002310	东方园林	5,220,299.00	43.07
37	002202	金风科技	5,204,825.66	42.94
38	000876	新希望	5,171,133.00	42.66
39	601336	新华保险	5,123,842.00	42.27
40	600060	海信电器	5,039,437.00	41.58
41	600873	梅花生物	4,955,847.92	40.89
42	002065	东华软件	4,762,202.00	39.29
43	000423	东阿阿胶	4,546,388.00	37.51
44	601668	中国建筑	4,505,114.00	37.17
45	002081	金螳螂	4,460,579.00	36.80
46	600900	长江电力	4,301,858.00	35.49
47	000538	云南白药	4,269,832.00	35.23
48	000709	河钢股份	4,175,522.75	34.45
49	000625	长安汽车	4,115,929.00	33.96
50	600663	陆家嘴	3,826,006.78	31.56
51	002241	歌尔股份	3,779,717.48	31.18
52	000623	吉林敖东	3,737,188.10	30.83
53	600208	新湖中宝	3,726,523.00	30.74
54	000917	电广传媒	3,725,014.60	30.73
55	601390	中国中铁	3,721,254.35	30.70
56	002024	苏宁云商	3,698,921.00	30.52
57	600383	金地集团	3,614,809.00	29.82
58	002142	宁波银行	3,494,990.90	28.83
59	000069	华侨城 A	3,477,510.00	28.69
60	600518	康美药业	3,423,095.00	28.24
61	601398	工商银行	3,397,438.00	28.03
62	002465	海格通信	3,370,767.00	27.81

63	600276	恒瑞医药	3,349,068.10	27.63
64	600958	东方证券	3,331,995.46	27.49
65	600109	国金证券	3,283,377.00	27.09
66	000686	东北证券	3,247,825.00	26.79
67	000100	TCL 集团	3,205,847.00	26.45
68	000983	西山煤电	3,132,337.00	25.84
69	600019	宝钢股份	3,092,411.00	25.51
70	600188	兖州煤业	3,073,507.00	25.36
71	000793	华闻传媒	3,073,259.00	25.35
72	600028	中国石化	2,985,110.00	24.63
73	600674	川投能源	2,959,278.00	24.41
74	000839	中信国安	2,810,003.00	23.18
75	601688	华泰证券	2,800,000.00	23.10
76	600585	海螺水泥	2,683,513.00	22.14
77	600704	物产中大	2,659,596.00	21.94
78	002152	广电运通	2,646,435.00	21.83
79	600362	江西铜业	2,643,941.00	21.81
80	002500	山西证券	2,616,978.56	21.59
81	600582	天地科技	2,608,991.71	21.52
82	002470	金正大	2,605,478.00	21.50
83	600741	华域汽车	2,593,567.00	21.40
84	600048	保利地产	2,541,871.00	20.97
85	300144	宋城演艺	2,536,941.36	20.93
86	601155	新城控股	2,436,657.00	20.10
87	002252	上海莱士	2,416,488.00	19.94
88	601169	北京银行	2,372,441.00	19.57
89	000157	中联重科	2,342,739.00	19.33
90	000671	阳光城	2,327,579.00	19.20

91	601225	陕西煤业	2,326,426.00	19.19
92	002475	立讯精密	2,306,092.66	19.03
93	002714	牧原股份	2,295,697.00	18.94
94	000060	中金岭南	2,293,157.16	18.92
95	600516	方大炭素	2,292,514.00	18.91
96	002074	国轩高科	2,250,492.00	18.57
97	601699	潞安环能	2,247,868.00	18.54
98	000425	徐工机械	2,212,224.00	18.25
99	601099	太平洋	2,200,547.00	18.15
100	600271	航天信息	2,174,985.00	17.94
101	601800	中国交建	2,151,228.46	17.75
102	601088	中国神华	2,109,855.94	17.41
103	000002	万科A	2,106,001.18	17.37
104	601788	光大证券	2,014,147.64	16.62
105	600782	新钢股份	1,985,764.00	16.38
106	002508	老板电器	1,961,907.54	16.19
107	600893	航发动力	1,938,564.60	15.99
108	600755	厦门国贸	1,896,166.00	15.64
109	601766	中国中车	1,870,374.00	15.43
110	000540	中天金融	1,855,269.00	15.31
111	000898	鞍钢股份	1,840,533.00	15.18
112	600971	恒源煤电	1,838,882.00	15.17
113	601899	紫金矿业	1,827,335.00	15.08
114	600808	马钢股份	1,795,691.00	14.81
115	600348	阳泉煤业	1,791,944.00	14.78
116	601006	大秦铁路	1,787,427.00	14.75
117	000825	太钢不锈	1,774,807.00	14.64
118	000778	新兴铸管	1,773,903.00	14.63



119	000963	华东医药	1,767,768.00	14.58
120	600066	宇通客车	1,763,511.00	14.55
121	600153	建发股份	1,759,226.00	14.51
122	000059	华锦股份	1,730,546.00	14.28
123	600018	上港集团	1,720,108.00	14.19
124	000166	申万宏源	1,694,035.00	13.98
125	300251	光线传媒	1,681,358.00	13.87
126	600688	上海石化	1,663,149.00	13.72
127	300017	网宿科技	1,651,775.23	13.63
128	600068	葛洲坝	1,631,191.00	13.46
129	600023	浙能电力	1,622,544.00	13.39
130	600309	万华化学	1,602,583.80	13.22
131	000830	鲁西化工	1,593,105.00	13.14
132	000698	沈阳化工	1,581,541.00	13.05
133	002183	怡亚通	1,573,737.80	12.98
134	600690	青岛海尔	1,570,397.00	12.96
135	600795	国电电力	1,566,592.00	12.92
136	600739	辽宁成大	1,563,812.00	12.90
137	600170	上海建工	1,536,846.00	12.68
138	601666	平煤股份	1,536,788.00	12.68
139	000761	本钢板材	1,534,268.00	12.66
140	600022	山东钢铁	1,532,616.00	12.64
141	600221	海航控股	1,528,431.00	12.61
142	600089	特变电工	1,508,991.00	12.45
143	000039	中集集团	1,507,098.00	12.43
144	000627	天茂集团	1,475,398.00	12.17
145	600325	华发股份	1,474,612.00	12.17
146	600649	城投控股	1,472,422.68	12.15

147	601857	中国石油	1,463,286.00	12.07
148	000156	华数传媒	1,461,678.08	12.06
149	002558	巨人网络	1,451,558.00	11.98
150	600031	三一重工	1,451,404.00	11.97
151	601233	桐昆股份	1,435,627.96	11.84
152	601888	中国国旅	1,432,612.08	11.82
153	600009	上海机场	1,416,978.00	11.69
154	000959	首钢股份	1,387,194.84	11.44
155	600637	东方明珠	1,386,024.00	11.43
156	601618	中国中冶	1,362,343.00	11.24
157	000900	现代投资	1,354,355.00	11.17
158	600720	祁连山	1,345,666.00	11.10
159	300027	华谊兄弟	1,321,191.00	10.90
160	300070	碧水源	1,315,551.00	10.85
161	000488	晨鸣纸业	1,276,147.35	10.53
162	601607	上海医药	1,251,729.00	10.33
163	000926	福星股份	1,229,277.00	10.14
164	600231	凌钢股份	1,219,339.90	10.06
165	000800	一汽轿车	1,203,160.00	9.93
166	600705	中航资本	1,195,051.00	9.86
167	600308	华泰股份	1,155,531.00	9.53
168	600039	四川路桥	1,118,192.00	9.23
169	600966	博汇纸业	1,117,095.10	9.22
170	300124	汇川技术	1,114,756.00	9.20
171	600038	中直股份	1,107,450.18	9.14
172	002415	海康威视	1,087,120.00	8.97
173	002568	百润股份	1,078,056.16	8.89
174	002352	顺丰控股	1,076,545.00	8.88

175	002299	圣农发展	1,047,081.00	8.64
176	600642	申能股份	998,297.00	8.24
177	002195	二三四五	972,538.00	8.02
178	600859	王府井	961,171.00	7.93
179	600335	国机汽车	952,397.00	7.86
180	000786	北新建材	942,171.00	7.77
181	601898	中煤能源	917,953.00	7.57
182	600029	南方航空	907,876.00	7.49
183	600694	大商股份	905,200.00	7.47
184	000966	长源电力	902,988.00	7.45
185	601600	中国铝业	897,876.00	7.41
186	300182	捷成股份	891,520.04	7.36
187	600123	兰花科创	888,946.00	7.33
188	600839	四川长虹	885,527.00	7.31
189	600823	世茂股份	869,660.00	7.17
190	600057	象屿股份	861,454.00	7.11
191	600327	大东方	822,576.00	6.79
192	600050	中国联通	811,146.00	6.69
193	600332	白云山	806,459.00	6.65
194	600648	外高桥	798,831.00	6.59
195	600373	中文传媒	789,617.00	6.51
196	300133	华策影视	780,742.00	6.44
197	000826	启迪桑德	769,966.52	6.35
198	001979	招商蛇口	763,605.00	6.30
199	600697	欧亚集团	730,732.00	6.03
200	600418	江淮汽车	725,088.00	5.98
201	002236	大华股份	723,749.00	5.97
202	000061	农产品	722,722.00	5.96

203	000732	泰禾集团	708,166.00	5.84
204	600997	开滦股份	706,174.00	5.83
205	600588	用友网络	680,334.76	5.61
206	600338	西藏珠峰	678,572.00	5.60
207	600508	上海能源	673,250.00	5.55
208	002309	中利集团	672,524.00	5.55
209	002839	张家港行	654,630.00	5.40
210	000422	湖北宜化	645,294.00	5.32
211	601117	中国化学	643,597.00	5.31
212	600282	南钢股份	642,284.00	5.30
213	600875	东方电气	634,060.00	5.23
214	002007	华兰生物	611,885.00	5.05
215	600177	雅戈尔	607,654.00	5.01
216	600498	烽火通信	607,088.00	5.01
217	600685	中船防务	604,938.32	4.99
218	600522	中天科技	596,091.00	4.92
219	600352	浙江龙盛	594,956.00	4.91
220	600256	广汇能源	583,562.00	4.81
221	600392	盛和资源	577,539.12	4.76
222	000550	江铃汽车	574,315.00	4.74
223	000589	黔轮胎 A	570,059.00	4.70
224	601992	金隅股份	568,823.00	4.69
225	601333	广深铁路	566,468.00	4.67
226	600020	中原高速	564,026.00	4.65
227	601718	际华集团	552,219.00	4.56
228	600708	光明地产	548,197.00	4.52
229	600660	福耀玻璃	546,427.00	4.51
230	000759	中百集团	545,311.00	4.50

231	600376	首开股份	542,903.57	4.48
232	600810	神马股份	536,870.00	4.43
233	601669	中国电建	535,746.00	4.42
234	600291	西水股份	529,742.00	4.37
235	600801	华新水泥	522,626.34	4.31
236	600266	北京城建	521,497.00	4.30
237	000938	紫光股份	519,246.91	4.28
238	002386	天原集团	517,056.00	4.27
239	600166	福田汽车	514,181.00	4.24
240	601989	中国重工	512,579.00	4.23
241	000951	中国重汽	510,719.00	4.21
242	002456	欧菲科技	504,554.00	4.16
243	600449	宁夏建材	499,725.00	4.12
244	600475	华光股份	486,979.00	4.02
245	601258	庞大集团	483,521.00	3.99
246	600665	天地源	479,854.00	3.96
247	000768	中航飞机	476,735.00	3.93
248	000977	浪潮信息	474,593.00	3.92
249	601939	建设银行	474,326.00	3.91
250	002087	新野纺织	467,560.00	3.86
251	600126	杭钢股份	455,948.00	3.76
252	600051	宁波联合	449,179.00	3.71
253	600804	鹏博士	433,543.00	3.58
254	002174	游族网络	430,994.76	3.56
255	000708	大冶特钢	414,879.00	3.42
256	600011	华能国际	414,800.00	3.42
257	002131	利欧股份	414,536.00	3.42
258	600827	百联股份	414,449.00	3.42

259	000792	盐湖股份	408,587.00	3.37
260	002831	裕同科技	401,685.00	3.31
261	300058	蓝色光标	399,924.00	3.30
262	600122	宏图高科	395,678.00	3.26
263	002230	科大讯飞	392,047.00	3.23
264	000568	泸州老窖	389,013.00	3.21
265	600366	宁波韵升	383,924.00	3.17
266	000555	神州信息	383,154.60	3.16
267	600219	南山铝业	379,646.00	3.13
268	600657	信达地产	372,766.00	3.08
269	001896	豫能控股	370,084.02	3.05
270	600115	东方航空	370,076.00	3.05
271	000503	海虹控股	367,584.00	3.03
272	300033	同花顺	366,780.00	3.03
273	300072	三聚环保	364,803.44	3.01
274	601919	中远海控	361,619.00	2.98
275	601555	东吴证券	359,871.67	2.97
276	600406	国电南瑞	355,060.00	2.93
277	000612	焦作万方	352,130.00	2.91
278	600067	冠城大通	350,308.00	2.89
279	600666	奥瑞德	330,772.00	2.73
280	600569	安阳钢铁	327,985.00	2.71
281	601877	正泰电器	325,731.00	2.69
282	002424	贵州百灵	316,885.00	2.61
283	601866	中远海发	314,235.00	2.59
284	600361	华联综超	313,999.00	2.59
285	600565	迪马股份	308,889.00	2.55
286	601111	中国国航	305,768.00	2.52

287	300699	光威复材	303,666.64	2.51
288	000543	皖能电力	303,198.00	2.50
289	601928	凤凰传媒	301,908.00	2.49
290	600100	同方股份	298,645.00	2.46
291	000539	粤电力 A	298,438.00	2.46
292	600743	华远地产	285,933.00	2.36
293	600703	三安光电	284,724.00	2.35
294	000961	中南建设	276,837.00	2.28
295	000877	天山股份	276,565.00	2.28
296	002092	中泰化学	268,070.00	2.21
297	002916	深南电路	262,208.10	2.16
298	002739	万达电影	261,283.00	2.16
299	601958	金钼股份	252,915.00	2.09
300	601998	中信银行	252,525.00	2.08
301	600098	广州发展	249,579.00	2.06
302	603160	汇顶科技	242,700.00	2.00

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。

### 8.4.3 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	845,573,758.08
卖出股票收入（成交）总额	803,502,874.39

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,794,300.00	4.21

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	3,794,300.00	4.21

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019563	17 国债 09	38,000	3,794,300.00	4.21

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。



## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券（600837），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。

海通证券股份有限公司（下称海通证券，股票代码：600837）于 2017 年 5 月 23 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）行政处罚事先告知书（处罚字【2017】59 号），海通证券存在为“富安达——信拓城一号”开立信用账户出具不实说明的违法违规行为，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告【2011】31 号）第十一条的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款”所述行为，据此，证监会决定：责令海通证券改正，给予警告，没收违法所得 509,653.15 元，并处罚款 2,548,265.75 元，对左秀海、徐晓啸、朱元灏给予警告，并分别处以 10 万元罚款。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	20,449.56

2	应收证券清算款	261,922.65
3	应收股利	-
4	应收利息	86,887.82
5	应收申购款	36,982.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	406,242.63

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 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	1.25	重大事项

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	367	188,713.69	67,079,382.25	96.85	2,178,541.17	3.15
安信沪深 300 增强 C	383	6,885.25	-	-	2,637,052.05	100.00
合计	750	95,859.97	67,079,382.25	93.30	4,815,593.22	6.70

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）。

### 9.2 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	-	-
	安信沪深 300 增强 C	-	-
	合计	-	-

注：管理人的从业人员持有基金占基金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）。

### 9.3 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

## 9.4 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	13.91	10,000,000.00	13.91	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	13.91	10,000,000.00	13.91	-

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信沪深增强 A	安信沪深增 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	173,240,690.95	5,992,916.68
减:本报告期基金总赎回份额	115,643,025.74	3,738,758.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	69,257,923.42	2,637,052.05

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

- 1、本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。
- 2、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本报告期应支付的报酬为人民币 30,000.00 元。

### 11.6 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
长江证券	2	1,041,598,094.98	63.28%	740,898.06	62.92%	-
国泰君安	2	326,722,725.61	19.85%	238,932.85	20.29%	-
中投证券	2	152,581,165.64	9.27%	108,533.08	9.22%	-
渤海证券	1	103,335,257.25	6.28%	73,502.83	6.24%	-
安信证券	2	21,889,491.65	1.33%	15,570.71	1.32%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	8,989,800.00	44.55%	-	-	-	-
国泰君安	7,494,750.00	37.14%	-	-	-	-
中投证券	3,694,450.00	18.31%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	13.91
	2	20170421-20171231	-	67,605,756.23	37,050,000.00	30,555,756.23	42.50
	3	20170421-20171220	-	67,605,756.23	67,605,756.23	-	-
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



安信基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日