

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金 (原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金) 2019 年第 2 季度报告

2019 年 06 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 18 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成。安信新起点灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2019 年 3 月 26 日至 2019 年 4 月 22 日，会议审议通过了《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，权益登记日为 2019 年 3 月 25 日。2019 年 4 月 25 日，本基金管理人发布《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，该决议自 2019 年 4 月 24 日起生效。依据中国证监会 2019 年 3 月 13 日《关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019]375 号）及上述基金份额持有人大会决议，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、基金估值、基金费用、收益分配等事项，并更名为“安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金”。自 2019 年 5 月 7 日起，由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金》生效，原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

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。

本报告中财务资料未经审计。

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金报告期自 2019 年 5 月 7 日起至 6 月 30 日止，原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 5 月 6 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	安信量化沪深 300 增强
基金主代码	003957
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2019 年 05 月 7 日	
报告期末基金份额总额	34,202,520.01 份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，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，力争实现基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*90%+商业银行活期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	628,537.35 份	33,573,982.66 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	安信新起点混合
基金主代码	003957
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 03 月 16 日
报告期末基金份额总额	61,360,856.00 份
投资目标	本基金将以严格风险管理与控制为前提，通过积极主动的资产配置和灵活多样的投资策略，力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金通过分析宏观指标和政策，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。固定收益投资方面，本基金在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属

	配置、久期配置、信用配置、回购、可转换债券等投资策略，配置流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种。股票投资方面，遵循自上而下和自下而上相结合原则，挖掘增长潜力巨大、同时符合资本市场阶段偏好的标的，同时，灵活运用多种低风险投资策略与事情驱动策略，把握市场定价偏差带来的投资机会。此外，本基金将合理利用权证、股指期货、国债期货等衍生工具，实现基金资产保值增值。	
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中债总指数（全价）收益率	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信新起点混合 A	安信新起点混合 C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	586,304.23 份	60,774,551.77 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 5 月 7 日 - 2019 年 6 月 30 日)	
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	21,357.80	1,235,902.57
2. 本期利润	40,135.37	2,090,967.91
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0647	0.0526
4. 期末基金资产净值	703,779.97	37,278,477.95
5. 期末基金份额净值	1.1197	1.1103

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 4 月 1 日 - 2019 年 5 月 6 日)	
	安信新起点混合 A	安信新起点混合 C
1. 本期已实现收益	17,573.86	1,876,949.94
2. 本期利润	-27,129.24	-2,583,091.53
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0462	-0.0409
4. 期末基金资产净值	619,065.47	63,653,910.66
5. 期末基金份额净值	1.0559	1.0474

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信量化沪深 300 增强 A

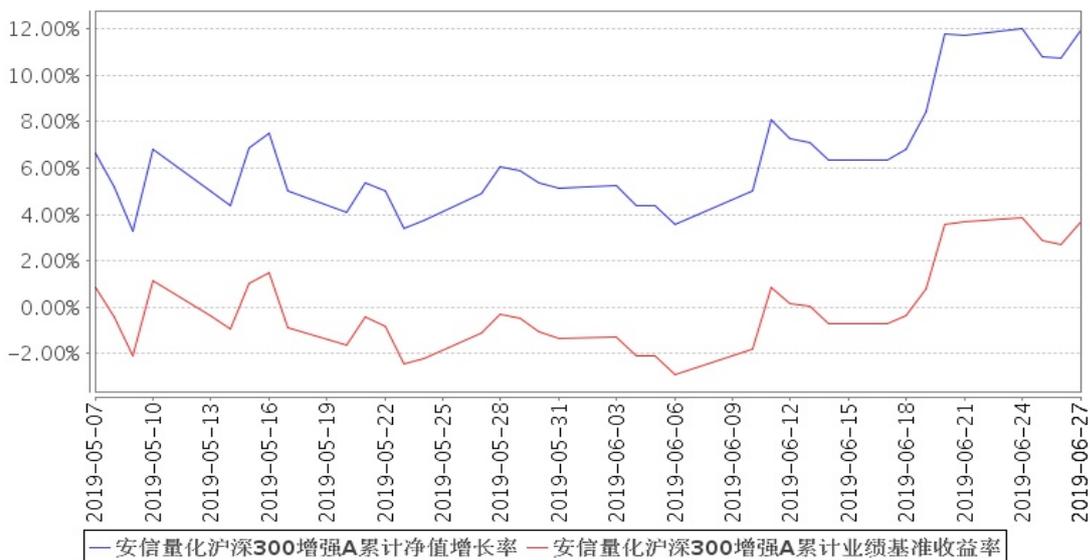
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型以来	6.04%	1.32%	3.47%	1.22%	2.57%	0.10%

安信量化沪深 300 增强 C

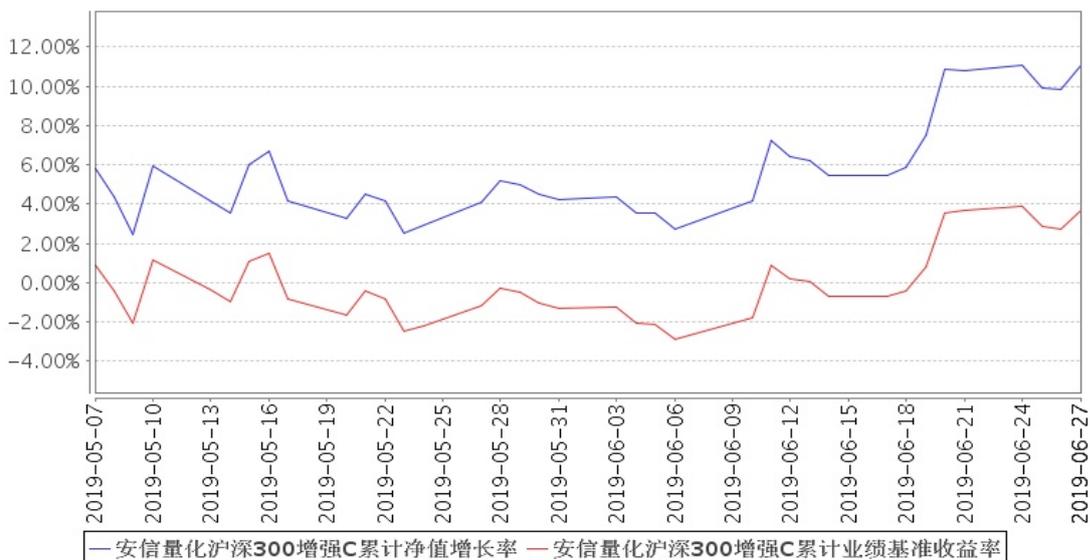
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型以来	6.01%	1.32%	3.47%	1.22%	2.54%	0.10%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信量化沪深300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



安信量化沪深300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 2019 年 5 月 7 日由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 7 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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信新起点混合 A

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④

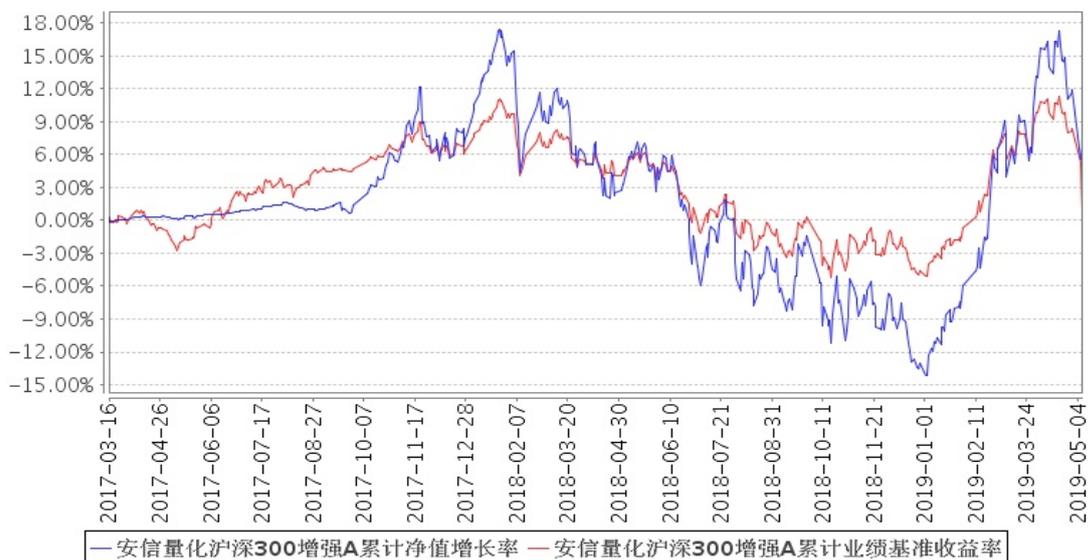
	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
自2019年4月1日起至2019年5月6日	-4.19%	1.76%	-3.01%	0.87%	-1.18%	0.89%

安信新起点混合C

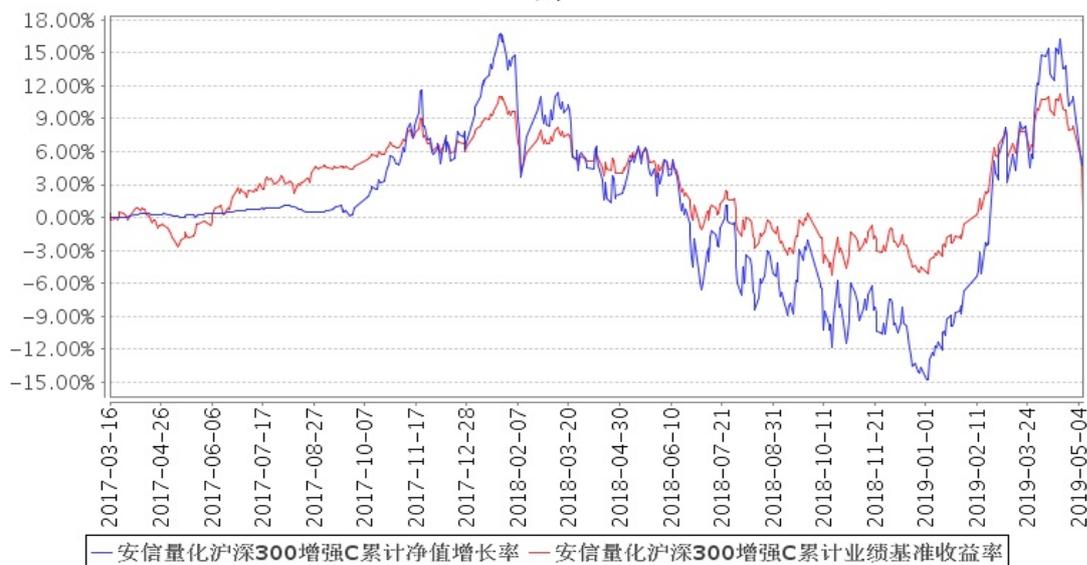
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自2019年4月1日起至2019年5月6日	-4.22%	1.76%	-3.01%	0.87%	-1.21%	0.89%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信量化沪深300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



安信量化沪深300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2017年3月16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、本基金自2019年5月7日起，由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐黄玮	本基金的基金经理	2019年5月7日	-	12年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金、安信中证500指数增强型证券投资

					资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐黄玮	本基金的基金经理	2017 年 11 月 1 日	-	12 年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。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不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年二季度宏观经济仍处于回落区间，行业景气度多数下行，包商事件对市场情绪有影响，且在整个运作期中美贸易压力有所升温，市场悲观情绪较重，风险偏好降低。经济下行压力和美国降息预期继续催生市场对宽松政策的期待，货币政策中性偏宽松，市场流动性相对充裕，中美贸易谈判和金融供给侧改革的进展仍需继续观察。

本基金运用量化多因子模型，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素，以自下而上为主，自上而下为辅，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的，并积极把握指数分红、指数成分调整、新股等确定性增强机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.1197 元，自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日止，基金份额净值增长率为 6.04%；截至 2019 年 6 月 30 日，安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.1103 元，自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日止，基金份额净值增长率为 6.01%；同期业绩比较基准收益率为 3.47%。

截至 2019 年 5 月 6 日，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.0559 元，自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 6 日止，基金份额净值增长率为-4.19%；截至 2019 年 5 月 6 日，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.0474 元，自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 6 日止，基金份额净值增长率为-4.22%；同期业绩比较基准收益率为-3.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型后：

自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日止，安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2019 年 5 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日。

转型前：

无。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	33,472,515.11	87.41
	其中：股票	33,472,515.11	87.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,760,749.88	4.60
	其中：债券	1,760,749.88	4.60
	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	1,000,000.00	2.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,734,208.75	4.53
8	其他资产	326,884.17	0.85
9	合计	38,294,357.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	509,575.00	1.34
B	采矿业	805,655.00	2.12
C	制造业	12,995,608.86	34.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,606.00	1.99
E	建筑业	1,005,244.00	2.65
F	批发和零售业	651,280.00	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	781,057.00	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,166,734.50	3.07
J	金融业	11,804,300.49	31.08
K	房地产业	1,762,975.00	4.64
L	租赁和商务服务业	354,460.20	0.93
M	科学研究和技术服务业	34,672.00	0.09
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	292,999.30	0.77
R	文化、体育和娱乐业	108,555.00	0.29

S	综合		
	合计	33,027,722.35	86.96

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	387,281.00	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,511.76	0.15
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		
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		
	合计	444,792.76	1.17

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	33,800	2,995,018.00	7.89
2	600519	贵州茅台	1,600	1,574,400.00	4.15
3	600036	招商银行	33,200	1,194,536.00	3.14

4	600030	中信证券	34,300	816,683.00	2.15
5	601166	兴业银行	44,481	813,557.49	2.14
6	000333	美的集团	15,050	780,493.00	2.05
7	000651	格力电器	14,000	770,000.00	2.03
8	000858	五粮液	5,800	684,110.00	1.80
9	600887	伊利股份	19,156	640,001.96	1.69
10	601288	农业银行	171,500	617,400.00	1.63

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600549	厦门钨业	7,400	105,894.00	0.28
2	002371	北方华创	1,100	76,175.00	0.20
3	002675	东诚药业	6,900	75,348.00	0.20
4	600132	重庆啤酒	1,400	66,024.00	0.17
5	300450	先导智能	1,900	63,840.00	0.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,751,750.00	4.61
	其中:政策性金融债	1,751,750.00	4.61
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)	8,999.88	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,760,749.88	4.64

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108901	农发1801	17,500	1,751,750.00	4.61
2	113028	环境转债	90	8,999.88	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1907	IF1907	2	2,283,000.00	2,100.00	-
公允价值变动总额合计(元)					2,100.00
股指期货投资本期收益(元)					-139,440.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					252,840.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以套期保值为目的，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行（股票代码：601166），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。

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件，未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试，不具备任职资格”的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于2018年10月25日前整改，健全基金托管业务内部控制制度，加强从业人员管理，并于2018年10月25日前提提交整改报告。

兴业银行股份有限公司于2018年8月21日因违规经营被深圳市消委会监管（约见）谈话，责令改正。

兴业银行股份有限公司于2018年9月12日因违规经营被上海证监局责令整改。

兴业银行股份有限公司于2019年3月31日因未依法履行职责被鼓东市场监管局罚款（鼓市场监管字[2018]108号）。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	261,681.15
2	应收证券清算款	29,044.16
3	应收股利	-
4	应收利息	32,256.31
5	应收申购款	3,902.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,884.17

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.1.1.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

1.1.1.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	58,245,529.56	90.25
	其中：股票	58,245,529.56	90.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,657,893.39	5.67
	其中：债券	3,657,893.39	5.67
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,457,444.10	2.26
8	其他资产	1,174,275.80	1.82
9	合计	64,535,142.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	476,974.00	0.74
B	采矿业	1,696,336.00	2.64
C	制造业	23,224,258.34	36.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,171,723.00	1.82
E	建筑业	2,177,057.40	3.39

F	批发和零售业	1,063,602.00	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,689,010.40	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,495,254.28	2.33
J	金融业	21,066,151.14	32.78
K	房地产业	2,905,557.00	4.52
L	租赁和商务服务业	543,883.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	169,665.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	56,836.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	403,550.00	0.63
R	文化、体育和娱乐业	105,672.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	58,245,529.56	90.62

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	59,100	4,798,920.00	7.47
2	600519	贵州茅台	3,000	2,718,000.00	4.23
3	600036	招商银行	62,800	2,129,548.00	3.31
4	000651	格力电器	25,200	1,298,556.00	2.02
5	000333	美的集团	25,650	1,258,645.50	1.96
6	601166	兴业银行	64,881	1,254,798.54	1.95
7	600030	中信证券	52,700	1,092,998.00	1.70
8	601288	农业银行	267,100	974,915.00	1.52
9	601668	中国建筑	166,260	962,645.40	1.50
10	600887	伊利股份	31,756	952,680.00	1.48

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,631,815.00	5.65
	其中:政策性金融债	3,631,815.00	5.65
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)	26,078.39	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,657,893.39	5.69

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108901	农发1801	36,300	3,631,815.00	5.65
2	113026	核能转债	220	21,999.71	0.03
3	127012	招路转债	41	4,078.68	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1905	IF1905	1	1,098,180.00	-128,400.00	-
IF1906	IF1906	1	1,093,380.00	-122,340.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-250,740.00
股指期货投资本期收益(元)					254,854.37

股指期货投资本期公允价值变动(元)	-392,040.00
-------------------	-------------

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,以套期保值为目的,结合股指期货的估值定价模型,与需要作风险对冲的现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,实现基金资产增值保值。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金以套期保值为目的进行国债期货投资,将构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险,实现基金资产保值增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行(股票代码:601166)、农业银行(股票代码:601288),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。

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件,未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试,不具备任职资格”的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于2018年10月25日前整改,健全基金托管业务内部控制制度,加强从业人员管理,并于2018年10月25日前提交整改报告。

兴业银行股份有限公司于2018年8月21日因违规经营被深圳市消委会监管(约见)谈话,责令改正。

兴业银行股份有限公司于2018年9月12日因违规经营被上海证监局责令整改。

兴业银行股份有限公司于 2019 年 3 月 31 日因未依法履行职责被鼓东市场监管局罚款（鼓市场监管字[2018]108 号）。

中国农业银行有限公司浙江省分行于 2018 年 5 月 15 日因应扣未扣工资薪金个人所得税、未按规定代扣代缴个人所得税、未按规定申报缴纳印花税、未按规定申报缴纳城市维护建设税、未按规定申报缴纳房产税、少缴城镇土地使用税等，被税务处罚，罚款 8661290.73 元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	262,668.03
2	应收证券清算款	857,351.28
3	应收股利	-
4	应收利息	53,713.16
5	应收申购款	543.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,174,275.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 7 日）持有	586,304.23	60,774,551.77

的基金份额		
报告期期间基金总申购份额(自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日)	115,364.07	556,431.73
减:报告期期间基金总赎回份额(自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日)	73,130.95	27,757,000.84
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)(自 2019 年 5 月 7 日起至 2019 年 6 月 30 日)	-	-
报告期期末基金份额总额(2019 年 6 月 30 日)	628,537.35	33,573,982.66

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

项目	安信新起点混合 A	安信新起点混合 C
报告期期初基金份额总额	591,467.76	66,728,535.34
报告期期间基金总申购份额(自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 6 日)	51,275.64	843,408.99
减:报告期期间基金总赎回份额(自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 6 日)	56,439.17	6,797,392.56
报告期期间基金(自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 6 日)拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额(2019 年 5 月 6 日)	586,304.23	60,774,551.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,578,094.25
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,578,094.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	33.85

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,578,094.25
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,578,094.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	18.87

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20190513-20190630	11,578,094.25	-	-	11,578,094.25	33.85
	2	20190401-20190630	14,895,729.89	-	-	14,895,729.89	43.55
	3	20190401-20190521	24,775,337.28	-	24,775,337.28	-	-

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信新起点灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、中国证监会核准安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型的文件；
- 3、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 7、《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2019 年 7 月 18 日