

安信中证一带一路主题指数分级证券投资  
基金  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 26 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信一带一路分级
场内简称	一带分级
基金主代码	167503
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日
报告期末基金份额总额	101,774,414.61 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将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绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	股票投资上，本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整；债券投资上，本基金将以宏观形势及利率分析为基础，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价；权证投资上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，谨慎进行权证投资；资产支持证券投资方面，综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。
业绩比较基准	中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险

	收益特征。		
基金管理人	安信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	一带一 A	一带一 B	一带分级
下属分级基金的交易代码	150275	150276	167503
报告期末下属分级基金的份 额总额	34,851,086.00 份	34,851,086.00 份	32,072,242.61 份
下属分级基金的风险收益特 征	安信一带一路 A 份 额为稳健收益类份 额,具有低预期风 险且预期收益相对 较低的特征。	安信一带一路 B 份 额为积极收益类份 额,具有高预期风 险且预期收益相对 较高的特征。	本基金属于股票型基金,其 预期的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,为证券投资 基金中较高风险、较高预期 收益的品种。同时本基金为 指数基金,通过跟踪标的指 数表现,具有与标的指数以 及标的指数所代表的公司相 似的风险收益特征。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月1日-2020年9月30日）
1. 本期已实现收益	4,779,864.30
2. 本期利润	15,816,555.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1372
4. 期末基金资产净值	115,965,780.41
5. 期末基金份额净值	1.139

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

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

#### 3.2 基金净值表现

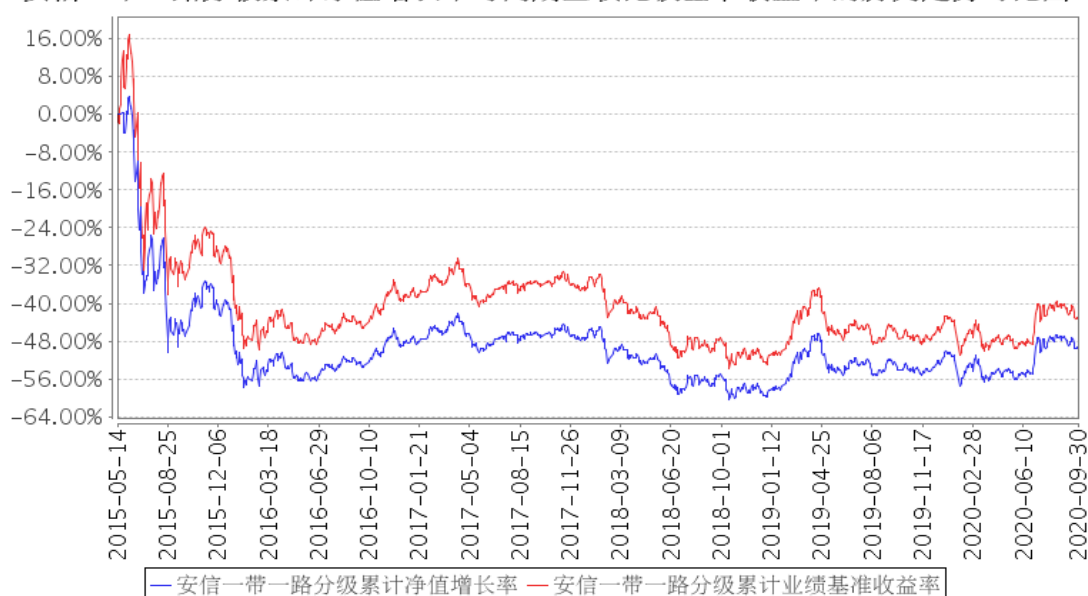
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.12%	1.53%	9.71%	1.54%	1.41%	-0.01%

过去六个月	14.82%	1.28%	12.13%	1.29%	2.69%	-0.01%
过去一年	10.25%	1.37%	7.99%	1.38%	2.26%	-0.01%
过去三年	-5.05%	1.29%	-11.17%	1.30%	6.12%	-0.01%
过去五年	-5.20%	1.37%	-13.05%	1.36%	7.85%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-49.53%	1.65%	-43.25%	1.67%	-6.28%	-0.02%

### 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

安信一带一路分级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
施荣盛	本基金的 基金经理	2020 年 1 月 13 日	-	7 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、基金经理助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部

					基金经理。曾任安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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》、《公开募集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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度市场整体处于震荡上行走势，上证指数上涨 7.82%，沪深 300 指数上涨 10.17%，中证 500 指数上涨 5.59%，创业板指数上涨 5.60%，市场风格上大盘股表现好于小盘股。

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，跟踪指数收益，力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.139 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.12%，业绩比较基准收益率为 9.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	110,207,671.38	94.50
	其中：股票	110,207,671.38	94.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	498,250.00	0.43
	其中：债券	498,250.00	0.43
	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	5,874,023.23	5.04
8	其他资产	37,713.43	0.03
9	合计	116,617,658.04	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,520,330.11	9.93
C	制造业	57,503,257.36	49.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,329,819.92	2.87
E	建筑业	18,447,429.41	15.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,181,206.29	9.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,202,251.92	2.76
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,611,628.00	3.11
M	科学研究和技术服务业	178,600.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	564,239.90	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	285,864.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	109,824,626.91	94.70

### 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	320,197.14	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,189.36	0.01
F	批发和零售业	16,793.79	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	18,487.50	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,376.68	0.01
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	383,044.47	0.33

### 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	600031	三一重工	151,456	3,769,739.84	3.25
2	601888	中国中免	16,200	3,611,628.00	3.11
3	000338	潍柴动力	232,394	3,509,149.40	3.03
4	601668	中国建筑	675,859	3,433,363.72	2.96
5	600028	中国石化	855,239	3,343,984.49	2.88
6	601766	中国中车	600,409	3,296,245.41	2.84
7	600309	万华化学	46,500	3,222,450.00	2.78
8	600585	海螺水泥	58,100	3,210,606.00	2.77
9	600406	国电南瑞	162,386	3,202,251.92	2.76
10	600019	宝钢股份	637,000	3,178,630.00	2.74

### 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	688093	世华科技	2,133	60,726.51	0.05
2	688330	宏力达	559	49,320.57	0.04
3	688585	上纬新材	4,922	49,170.78	0.04
4	603565	中谷物流	750	18,487.50	0.02
5	605336	帅丰电器	701	17,027.29	0.01

### 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	498,250.00	0.43
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	498,250.00	0.43

### 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	019640	20 国债 10	5,000	498,250.00	0.43

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



## 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券除中国建筑（股票代码：601668.SH）、宝钢股份（股票代码：600019.SH）外其他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。

2019 年 11 月 4 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局北京市海淀区税务局【京海一税简罚（2019）6025922 号】处以罚款。

2019 年 11 月 6 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被深圳市住房和建设局处以罚款【深建罚（2019）280 号、深建罚（2019）159 号】

2019 年 12 月，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局大连市中山区税务局、成都市住建局、济宁市住建局通报批评并责令改正。

2020 年 5 月 7 日，中国建筑股份有限公司因违反交通法规被江西省交通建设工程质量监督管理局罚款五万元【赣交质安监罚（2019）5 号】。

2020 年 7 月 31 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被门头沟区住建委罚款 1000 元【京建法罚（门建）字[2020]第 670011 号】。

2020 年 9 月 8 日，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被坪山区环境保护和水务局罚款 3 万元【深坪环罚（2018）172 号】。

2019 年 11 月 9 日，宝山钢铁股份有限公司因未依法履行职责被上海市应急管理局责令改正【沪安监事故批（2019）11 号】。

2019 年 12 月 25 日，宝山钢铁股份有限公司因涉嫌违反法律法规被上海市生态环境局罚款。

2019 年 12 月 30 日，宝山钢铁股份有限公司因未依法履行职责被上海市宝山区生态环境局罚款并责令改正【第 2520190191 号】。

2020 年 2 月 7 日，宝山钢铁股份有限公司因涉嫌违反法律法规被上海市生态环境局罚款。

### 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	20,306.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,083.25
5	应收申购款	12,323.84

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,713.43

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名中不存在流通受限情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688330	宏力达	49,320.57	0.04	新股未上市
2	688585	上纬新材	49,170.78	0.04	新股锁定

#### 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

单位：份

项目	一带一 A	一带一 B	一带分级
报告期期初基金份额总额	40,461,993.00	40,461,993.00	49,025,581.01
报告期期间基金总申购份额	-	-	3,687,010.02
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	31,862,162.42
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-5,610,907.00	-5,610,907.00	11,221,814.00
报告期期末基金份额总额	34,851,086.00	34,851,086.00	32,072,242.61

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

### 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

无。

### 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、中国证监会准予安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

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

2020 年 10 月 26 日