

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
2017 年第 3 季度报告

2017 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 26 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 2017 年 7 月 20 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信工业 4.0 混合
交易代码	004521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 20 日
报告期末基金份额总额	166,286,264.80 份
投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中债总指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股通标的股票，从而面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
下属分级基金的交易代码	004521	004522
报告期末下属分级基金的份额总额	84,997,630.93 份	81,288,633.87 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 7 月 20 日 — 2017 年 9 月 30 日）	
	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
1. 本期已实现收益	949,011.52	850,080.89
2. 本期利润	2,956,353.95	2,658,144.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0291
4. 期末基金资产净值	87,749,655.89	83,904,145.22
5. 期末基金份额净值	1.0324	1.0322

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

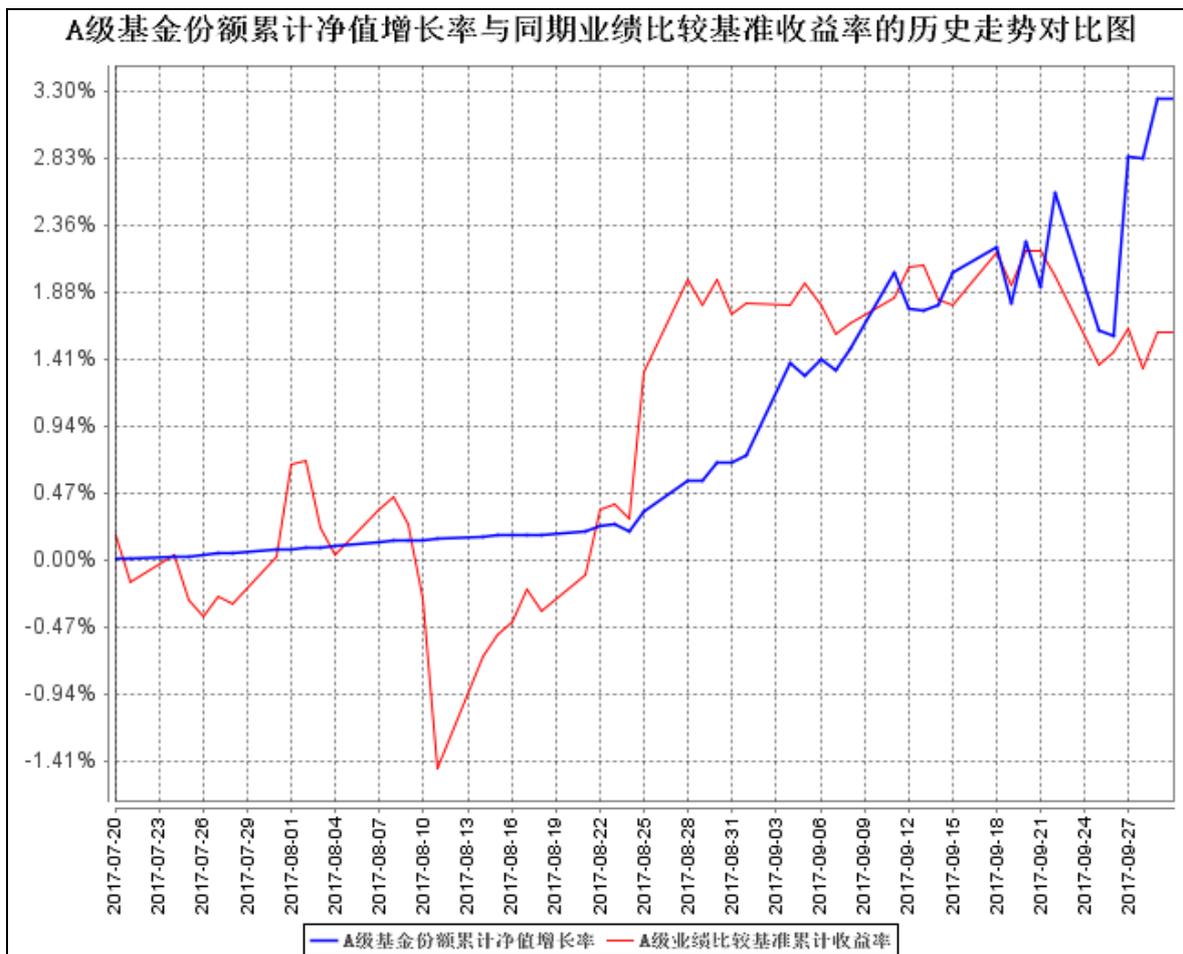
安信工业 4.0 混合 A

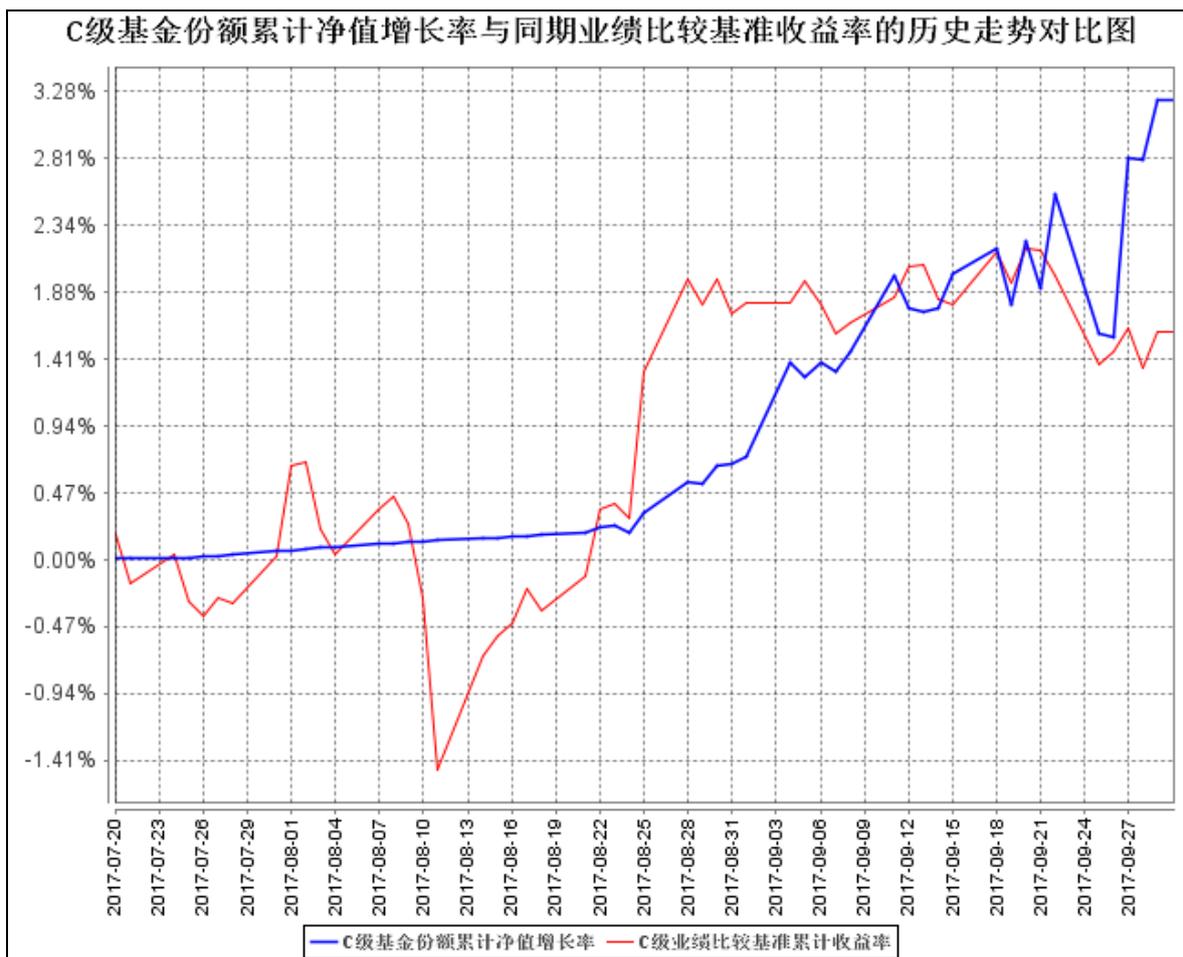
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.24%	0.29%	1.60%	0.35%	1.64%	-0.06%

安信工业 4.0 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
过去三个月	3.22%	0.29%	1.60%	0.35%	1.62%	-0.06%

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





注：1、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 20 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。

§ 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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2017 年 7 月 20 日	-	11	蓝雁书先生，理学硕士。历任桂林理工大学（原桂林工学院）理学院教师，华西证券有限责任公司证券研究所研究员，安信证券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。

					2011 年 12 月加入安信基金管理有限责任公司，现任权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、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的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入 2017 年三季度，由于 7、8 月份经济数据好于市场预期，强周期品种涨幅居前；进入 9 月份以后，在韧性较强的经济基本面支撑下，市场资金更愿意往中小创板块集中，以规避国家队在二级市场上对蓝筹股直接干预带来的不利影响，通信、电子元器件等行业涨幅后来居上，同时业绩预期较好的食品饮料、家电、汽车等行业取得较好的区间涨幅。

期间，安信工业 4.0 基金主要配置方向有：（1）通信设备：5G 将成为中国又一领先全球的高端制造领域，光纤光缆行业竞争格局较好，在基建加速过程中将继续受益于产品涨价，通信标准的统一也有利于通信设备龙头企业集中度提升；（2）高端制造：主要包括工业自动化、激光装备、3C 设备等符合中国制造业升级转向的优质品种；（3）建筑建材：考虑到地产行业集中度提升必将加速下游建筑建材行业格局优化，同时更多省市对于精装修比例提出严格规划，集采比例提高将带给建材龙头企业稳健增长；（4）其余配置在估值合理、业绩确定性高的家电、地产、汽车零部件等行业内。总体取得较好的投资业绩，但周期品种参与度不够，相对业绩排名不是非常亮眼。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信工业 4.0 混合 A 基金份额净值为 1.0324 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.24%；截至本报告期末安信工业 4.0 混合 C 基金份额净值为 1.0322 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.22%；同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

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	125,415,690.74	71.76
	其中：股票	125,415,690.74	71.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	30,000,000.00	17.16

	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	13,706,178.75	7.84
8	其他资产	5,656,538.27	3.24
9	合计	174,778,407.76	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	98,392,612.32	57.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,450,372.00	4.92
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	2,448,540.00	1.43
J	金融业	4,456,504.00	2.60
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	3,557,141.00	2.07
S	综合	-	-
	合计	117,305,169.32	68.34

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	4,170,015.60	2.43
非日常生活消费品	-	-

日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	3,940,505.82	2.30
信息技术	-	-
电信业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,110,521.42	4.72

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	600522	中天科技	603,300	8,621,157.00	5.02
2	600068	葛洲坝	608,200	6,313,116.00	3.68
3	002008	大族激光	119,717	5,219,661.20	3.04
4	000063	中兴通讯	183,300	5,187,390.00	3.02
5	600487	亨通光电	147,240	5,065,056.00	2.95
6	000530	大冷股份	671,070	4,898,811.00	2.85
7	002273	水晶光电	187,900	4,798,966.00	2.80
8	600366	宁波韵升	220,100	4,608,894.00	2.68
9	002475	立讯精密	221,158	4,569,124.28	2.66
10	000910	大亚圣象	216,700	4,524,696.00	2.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，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严格匹配，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

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,081.76
2	应收证券清算款	5,599,877.50
3	应收股利	-
4	应收利息	32,579.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,656,538.27

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

单位：份

项目	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
基金合同生效日（2017 年 7 月 20 日） 基金份额总额	116,111,252.40	103,640,122.42
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	11,835,502.63	662,295.19
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	42,949,124.10	23,013,783.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

报告期期末基金份额总额	84,997,630.93	81,288,633.87
-------------	---------------	---------------

§ 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运用固有资金投资本基金。

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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 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、中国证监会核准安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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托管协议》；
- 4、《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

2017 年 10 月 27 日