

# 安信中证 500 指数增强型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

(2019 年第 1 号)

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2019 年 5 月 29 日

### 重要提示

安信中证 500 指数增强型证券投资基金的募集申请于 2018 年 3 月 16 日经中国证监会证监许可[2018]490 号文注册。本基金基金合同于 2018 年 11 月 29 日正式生效。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 5 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：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

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

法定代表人：刘入领

成立时间：2011 年 12 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可（2011）1895 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：50,625 万元人民币

存续期间：永续经营

联系人：陈静满

联系电话：0755-82509999

公司的股权结构如下：

| 股东名称           | 持股比例   |
|----------------|--------|
| 五矿资本控股有限公司     | 39.84% |
| 安信证券股份有限公司     | 33.95% |
| 佛山市顺德区新碧贸易有限公司 | 20.28% |
| 中广核财务有限责任公司    | 5.93%  |

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

王连志先生，董事长，经济学硕士。历任长城证券有限公司投行部经理、中信证券股份有限公司投行部经理、第一证券有限责任公司副总经理、安信证券股份有限公司副总经理、安信基金管理有限责任公司总经理。现任安信证券股份有限公司董事、总经理、党委副书记。

刘入领先生，董事，经济学博士。历任国通证券股份有限公司（现招商证券股份有限公司）研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理；招商证券股份有限公司战略部副总经理（主持工作）、总裁办公室主任、理财客户部总经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理，兼任安

信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事长。

任珠峰先生，董事，经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理，英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理，五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理、总经理等职务。现任中国五矿集团有限公司总经理助理，中国五矿股份有限公司董事、副总经理，五矿资本股份有限公司董事长、总经理、党委书记，五矿资本控股有限公司董事长、总经理，五矿国际信托有限公司董事长、党委书记，中国外贸金融租赁有限公司董事长，工银安盛人寿保险有限公司副董事长，绵阳市商业银行股份有限公司董事、党委书记。

王晓东先生，董事，经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员，日本五金矿产株式会社财务部科员，中国外贸金融租赁有限公司副总经理，中国五矿集团公司财务部总部副总经理，五矿投资发展有限责任公司副总经理等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员，五矿资本控股有限公司副总经理、资本运营部总经理，五矿经易期货有限公司董事长、党委书记，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，绵阳市商业银行股份有限公司董事。

代永波先生，董事，管理学硕士。历任深圳深国投房地产开发有限公司财务部会计、第一创业证券有限责任公司投资银行部业务经理、中信建投证券股份有限公司投资银行部副总裁、申银万国证券股份有限公司投资银行部执行总经理、广州市顺路管理咨询股份有限公司董事、总经理。现任中证信用增进股份有限公司监事、Qutoutiao Inc. 董事、深圳市帕拉丁股权投资有限公司业务总裁。

郭伟喜先生，董事，经济学学士。历任福云会计师事务所项目经理，上海中科合臣股份有限公司财务主管，厦门天地安保险代理有限公司财务总监，高能资本有限公司投资银行业务董事等职。现任中广核财务有限公司投资银行部副总经理（主持工作）。

庞继英先生，独立董事，金融学博士，高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部，国家外汇管理局副处长、处长、副司长，中国外汇交易中心副总裁、总裁，中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员，中国再保险（集团）股份有限公司党委副书记、副董事长、国家开发银行股份有限公司董事。

魏华林先生，独立董事，1977年毕业于武汉大学政治经济学专业、1979年毕业于厦门大学政治经济学研究班。历任武汉大学经济系讲师，保险系副教授、副系主任、主任，保险经济研究所所长。现任武汉大学风险研究中心主任、教授、博士生导师，中国原保监会咨询

委员会委员、中国金融学会常务理事暨学术委员会委员、中国保险学会副会长、湖北省政府文史研究馆馆员。

尹公辉先生，独立董事，法学硕士。历任四川建材工业学院辅导员、学办主任，中农信（香港）集团有限公司法务主管，广东信达律师事务所专职律师，广东华商律师事务所专职律师，广东百利孚律师事务所合伙人。现任广东信达律师事务所合伙人，深圳北鼎晶辉科技股份有限公司独立董事，深圳市律师协会公平交易委员会委员。

## 2、基金管理人监事会成员

刘国威先生，监事会主席，工商管理硕士。历任五矿集团财务公司资金部科长、香港信荣财务有限公司资金部高级经理、五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、五矿投资发展有限责任公司规划发展部总经理、五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员，五矿资本控股有限公司副总经理，工银安盛人寿保险有限公司监事会主席，中国外贸金融租赁有限公司董事，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，五矿经易期货有限公司董事。

余斌先生，监事，经济学学士。历任深圳鸿华实业股份有限公司财务审计经理、南方证券股份有限公司稽核部副总经理、中科证券托管组副组长。现任安信证券股份有限公司计划财务部总经理。

陈明女士，会计学学士。历任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）广州分所审计经理。现任深圳市帕拉丁股权投资有限公司事业部副总经理。

范瑛女士，职工监事，工商管理硕士。历任深圳特发实业有限公司财务部主办会计，交通银行深圳分行国际业务部主办会计，融通基金管理有限公司登记清算部基金会计，大成基金管理有限公司基金运营部总监，现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼运营部总经理。

王卫峰先生，职工监事，工商管理硕士，注册会计师。历任吉林省国际信托公司财务人员，汉唐证券有限责任公司营业部财务经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管，浦银安盛基金管理有限公司监察部负责人。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼监察稽核部总经理、风险管理部总经理。

张再新先生，职工监事，经济学硕士。历任安信证券股份有限公司计划财务部会计，安信基金管理有限责任公司财务部会计、工会财务委员。现任安信基金管理有限责任公司运营

部总经理助理、交易主管。

### 3、基金管理人高级管理人员

王连志先生，董事长，经济学硕士。简历同上。

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理、证券投资部副总经理，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理、东方基金管理有限责任公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

孙晓奇先生，副总经理，经济学硕士。历任上海石化股份有限公司董事会秘书室高级经理，上海证券交易所交易运行部襄理、市场发展部高级经理、债券基金部执行经理，南方证券行政接管组成员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司督察长、副总经理兼安信乾盛财富管理（深圳）有限公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

李学明先生，副总经理，哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理，理财发展部高级经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理，安信基金筹备组成员；安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。

乔江晖女士，督察长，文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、副处长，安信证券股份有限公司安信基金筹备组成员，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

### 4、本基金基金经理

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。2017年11月1日至今，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）的基金经理；2017年12月29日至今，任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、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金的基金经理、安信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。

## 5、投资决策委员会成员

主任委员：

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

委员：

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

孙晓奇先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

钟光正先生，经济学硕士。历任广东发展银行总行资金部交易员，招商银行股份有限公司总行资金交易部交易员，长城基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼固定收益部总经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监。

陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。

占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理，安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司 FOF 投资部总经理。

杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。

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。

张竞先生，南开大学金融学硕士。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理、安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金

管理有限责任公司权益投资部总经理。

陈鹏先生，工商管理硕士。历任联合证券有限责任公司行业研究员，鹏华基金管理有限公司基金经理，安信基金管理有限责任公司综合管理部首席招聘官。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 1、基本情况

名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

注册日期：1997 年 04 月 10 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会，银监复[2007]64 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：伍拾亿陆仟玖佰柒拾叁万贰仟叁佰零伍人民币元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2012】1432 号

托管部门联系人：王海燕

电话：0574-89103171

### 2、主要人员情况

截至 2019 年 3 月底，宁波银行资产托管部共有员工 90 人，100%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，宁波银行自 2012 年获得证券投资基金资产托管的资格以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富和成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、

信托资产、Q D I I 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、基金公司特定客户资产管理等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。

截至2019年3月底，宁波银行共托管55只证券投资基金，证券投资基金托管规模910.84亿元。

#### 4、基金托管人的职责

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并及时将更新后的名单发送给对方。

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。

#### 5、基金托管人的内部控制制度

##### (1) 内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金持有人及基金托管人的合法权益。

##### (2) 内部风险控制组织结构

由宁波银行总行审计部和资产托管部内设的审计内控部门构成。资产托管部内部设置专



门审计内控部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### （3）内部风险控制原则

1) 合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2) 完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到基金托管部所有的部门、岗位和人员。

3) 及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

4) 审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整。

5) 有效性原则：必须根据国家政策、法律及宁波银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

6) 独立性原则：设立专门履行基金托管人职责的管理部门；直接的操作人员和控制人员必须相对独立、适当分开；基金托管部内部设置独立的负责审计内控部门专责内控制度的检查。

## 6、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （1）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用“基金投资监督系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （2）监督流程

1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3) 根据基金投资运作监督情况, 定期编写基金投资运作监督报告, 对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价, 报送中国证监会。

4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易, 电话或书面要求基金管理人进行解释或举证, 并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

##### 1、直销机构

###### (1) 直销中心

名称: 安信基金管理有限责任公司

住所: 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 25 层

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 25 层

法定代表人: 刘入领

电话: 0755-82509820

传真: 0755-82509920

联系人: 江程

客户服务电话: 4008-088-088

公司网站: [www.essencefund.com](http://www.essencefund.com)

##### 2、其他销售机构

###### (1) 宁波银行股份有限公司

住所: 中国浙江宁波市宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 95574

网站: [www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

###### (2) 江苏张家港农村商业银行股份有限公司

住所: 张家港市人民中路 66 号

法定代表人: 季颖

客户服务电话: 0512-96065

网站: [www.zrcbank.com](http://www.zrcbank.com)

(3) 珠海华润银行股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大九州大道东 1346 号珠海华润银行大厦

法定代表人：刘晓勇

客户服务电话：96588

网站：www.crbank.com.cn

(4) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

(5) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务电话：400-8888-666 / 95521

网站：www.gtja.com

(6) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

(7) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553

网站：www.htsec.com

(8) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客户服务电话：95575

网站: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(9) 中信证券股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人: 张佑君

客户服务电话: 95558

网站: [www.citics.com](http://www.citics.com)

(10) 中信证券(山东)有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人: 姜晓林

客户服务电话: 96577

网站: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(11) 东海证券股份有限公司

住所: 上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 5 楼

法定代表人: 赵俊

客户服务电话: 4008-888-588

网站: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(12) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网站: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(13) 中山证券有限责任公司

住所: 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7、8 层

法定代表人: 林炳城

客户服务电话: 95329

网站: [www.zszq.com.cn](http://www.zszq.com.cn)

(14) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦

法定代表人: 王常青

客户服务电话：95587/4008-888-108

网站：www.csc108.com

(15) 中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-9908-826

网站：www.citicsf.com

(16) 中国国际金融股份有限公司

住所：中国北京建国门外大街1号国贸写字楼2座28层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com

(17) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：高涛

客户服务电话：95532/4006-008-008

网站：www.china-invs.cn

(18) 东海期货有限责任公司

住所：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人：陈太康

客户服务电话：95531/400-8888588

网站：www.qh168.com.cn

(19) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网站：<http://www.guosen.com.cn>

(20) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

客户服务电话：4008888993

网站：www.dxzq.net

(21) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584/4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

(22) 东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

网站：www.nesc.cn

(23) 第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

网站：www.firstcapital.com.cn

(24) 国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网站：www.gjq.com.cn

(25) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-8888

网站：www.chinastock.com.cn

(26) 上海华信证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：陈灿辉

客户服务电话：400-820-5999

网站：www.shhxzq.com

(27) 宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008-366-366

网站：www.hx818.com

(28) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户服务电话：95597

网站：<http://www.htsc.com.cn/>

(29) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

客户服务电话：95511-8

网站：stock.pingan.com

(30) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李琦

客户服务电话：400-800-0562

网站：www.hysec.com

(31) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

客户服务电话：4008323000

网站: <http://www.csco.com.cn>

(32) 天风证券股份有限公司

住所: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人: 余磊

客户服务电话: 95391/4008005000

网站: <http://www.tfzq.com>

(33) 广州证券股份有限公司

住所: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人: 胡伏云

客户服务电话: 95396

网站: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(34) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

客户服务电话: 95525

网站: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(35) 长城证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人: 丁益

客户服务电话: 4006666888

网站: [www.cgws.com/cczq](http://www.cgws.com/cczq)

(36) 开源证券股份有限公司

住所: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

客户服务电话: 95325

网站: <http://www.kysec.cn/>

(37) 联储证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

法定代表人: 丁倩云



客户服务电话：400-620-6868

网站：www.lczq.com

(38) 大同证券有限责任公司

住所：山西省太原市小店区长治路 111 号 12、13 层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007121212

网站：www.dtsbc.com.cn

(39) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

客户服务电话：4000-766-123

网站：www.fund123.cn

(40) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-181-8188

网站：www.1234567.com.cn

(41) 上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网站：www.erichfund.com

(42) 和讯信息科技有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 E 座 18 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网站：licaikexun.com

(43) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

网站：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(44) 泰信财富基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦 C 座 12 层

法定代表人：张虎

客户服务电话：400-004-8821

网站：<http://www.hxlc.com>

(45) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：4008-773-772

网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(46) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(47) 北京钱景基金销售有限公司

住所：北京海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008 室

法定代表人：赵荣春

客户服务电话：400-893-6885

网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(48) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(49) 深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

客户服务电话：400-930-0660

网站：www.jfzinv.com

(50) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：广州市珠海市琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

(51) 北京晟视天下基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：400-818-8866

网站：www.shengshiview.com

(52) 北京中天嘉华基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区京顺路 5 号曙光大厦 C 座一层

法定代表人：洪少猛

客户服务电话：4006509972

网站：www.5ilicai.cn

(53) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼（西环广场 T2）19 层 19C13

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

网站：www.hcjijin.com

(54) 大泰金石基金销售有限公司

住所：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人：姚杨

客户服务电话：400-928-2266

网站：www.dtfunds.com

(55) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：董云巍

客户服务电话：400-088-8080

网站：www.qiandaojr.com

(56) 北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：江卉

客户服务电话：400 098 8511

网站：fund.jd.com

(57) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块 新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客户服务电话：010-62675369

网站：www.xincai.com

(58) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

网站：www.jiyufund.com.cn

(59) 上海万得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网站：www.520fund.com.cn

(60) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网站：www.noah-fund.com

(61) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

法定代表人：陶捷

客户服务电话：400-027-9899

网站：www.buyfunds.cn

(62) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：马勇

客户服务电话：400-116-1188

网站：8.jrj.com.cn

(63) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客户服务电话：95177

网站：www.snjijin.com

(64) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区梨园路 6 号物资控股大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：400-678-8887

网站：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

(65) 北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客户服务电话：400-066-8586

网站：www.igesafe.com

(66) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层

法定代表人： 吴雪秀

客户服务电话： 400-001-1566

网站： <http://www.yilucaifu.com>

(67) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所： 北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人： 钟斐斐

客户服务电话： 400-061-8518

网站： <https://danjuanapp.com/>

(68) 中民财富基金销售（上海）有限公司

住所： 上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人： 弭洪军

客户服务电话： 400-876-5716

网站： <https://www.cmiwm.com/>

(69) 万家财富基金销售（天津）有限公司

住所： 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人： 李修辞

客户服务电话： 010-59013895

网站： [www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

(70) 通华财富（上海）基金销售有限公司

住所： 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 楼

法定代表人： 沈丹义

客户服务电话： 400-101-9301

网站： <https://www.tonghuafund.com>

(71) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所： 北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人： 张旭

客户服务电话： 400-810-5919

网站： [www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(72) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

网站：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(73) 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

住所：深圳市福田区福强路 4001 号深圳市世纪工艺品文化市场 313 栋 E-403

法定代表人：李春瑜

客户服务电话：400-680-3928

网站：[www.simuwang.com](http://www.simuwang.com)

(74) 嘉实财富管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4400-021-8850

网站：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(75) 北京创金启富基金销售有限公司

住所：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-1818 /010-66154828

网站：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(76) 上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客户服务电话：021-50810673

网站：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

(77) 天津市凤凰财富基金销售有限公司

住所：天津市和平区南京路 181 号世纪都会 1606-1607

法定代表人：王正宇

客户服务电话：4007-066-880

网站：<http://www.phoenix-capital.com.cn>

(78) 奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客户服务电话：400-684-0500

网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(79) 北京植信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客户服务电话：4006-802-123

网站：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(80) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

客户服务电话：400-819-9868

网站：<http://www.tdyhfund.com/>

(81) 民商基金销售（上海）有限公司

住所：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

客户服务电话：021-50206003

网站：<http://www.msftec.com/>

(82) 上海联泰基金销售有限公司

住所：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

网站：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(83) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客户服务电话：4006-433-389



网站: [www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

(84) 华瑞保险销售有限公司

住所: 上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 楼 806

法定代表人: 路昊

客户服务电话: 4001-115-818

网站: [www.huaruisales.com](http://www.huaruisales.com)

(85) 北京百度百盈基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人: 张旭阳

客户服务电话: 95599-4

网站: [www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

(二) 登记机构

名称: 安信基金管理有限责任公司

住所: 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

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

法定代表人: 刘入领

电话: 0755-82509865

传真: 0755-82560289

联系人: 宋发根

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 俞卫锋

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

联系人: 陈颖华

经办律师: 黎明、陈颖华

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：李妍明

#### **四、基金名称**

安信中证500指数增强型证券投资基金

#### **五、基金类型**

股票型

#### **六、基金的运作方式**

契约型开放式

#### **七、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。

## 八、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票)、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例占基金资产的90%-95%,其中,投资标的指数成份股及其备选成份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合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

## 九、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。

### 1、资产配置策略

本基金为指数基金,股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出合适调整。

### 2、股票投资策略

本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合,并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段,严格将跟踪误差控制在规定范围内,控制与标的指

数主动偏离的风险。

#### (1) 指数化被动投资策略

指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出相应调整,力争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%。

#### (2) 量化增强策略

量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,产出投资组合,以追求超越标的指数表现的业绩水平。

**超额收益模型:**该模型通过构建多因子量化系统,综合评估估值、市场趋势、盈利、企业质量、投资者情绪等多个因素,以自下而上为主,自上而下为辅,分辨各类资产和各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值,定价过高的资产应当考虑回避。

**风险模型:**该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口,包括基金规模、资产波动率、行业集中度等,力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。

**成本模型:**该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本,能有效控制基金的换手率。

#### (3) 组合调整策略

##### 1) 定期调整

本基金将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整,达到有效控制跟踪偏离度和跟踪误差的目的。

##### 2) 不定期调整

①根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配、各类限售股获得流通权等原因而需要进行成份股权重调整时,本基金将参考标的指数最新权重比例,进行相应调整;

②根据本基金的申购和赎回情况,结合基金的现金头寸管理,对股票投资组合进行调整以应对基金的申购赎回,从而有效跟踪标的指数;

③根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时的被动性卖出调整,并相应地对其他资产或个股进行微调,以保证基金合法规范运;

④根据法律、法规和基金合同的规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生

相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

#### （4）跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金为指数增强型基金，将通过适度的主动投资获取超越标的指数的超额收益，同时也将因承担相应的主动风险而导致较大的跟踪误差。

因此，本基金将每日跟踪基金组合与指数表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案，实现有效控制跟踪误差。

### 3、股指期货投资策略

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，以套期保值为目的，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，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并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。

### 4、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，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。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

### 5、国债期货投资策略

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与研判，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 6、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，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，在此基础上谨慎进行权证投资。本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在形成的风险对冲机会，在充分论证和模型分析的基础上谨慎构建套利投资组合，获取相对稳定的投资收益。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将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，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

#### 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$

本基金为指数增强型基金，标的指数为中证 500 指数，因此业绩比较基准以中证 500 指数收益率为主要组成部分。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况。

如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权，或中证 500 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或者今后法律法规发生变化，证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，按监管部门要求履行适当程序以后变更本基金标的指数、业绩比较基、基金名称等并及时公告。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数、基金名称和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

#### 十一、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。

## 十二、基金投资组合报告

本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。

本基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日，来源于《安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》。本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（人民币元）      | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 67,087,716.00 | 70.46        |
|    | 其中：股票             | 67,087,716.00 | 70.46        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 2,876,647.92  | 3.02         |
|    | 其中：债券             | 2,876,647.92  | 3.02         |
|    | 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          | 3,200,000.00  | 3.36         |
|    | 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      | 6,909,050.35  | 7.26         |
| 8  | 其他资产              | 15,142,097.47 | 15.90        |
| 9  | 合计                | 95,215,511.74 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

| 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         | 528,374.00    | 0.66         |
| B  | 采矿业              | 2,086,573.00  | 2.62         |
| C  | 制造业              | 33,004,710.00 | 41.51        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,398,988.00  | 3.02         |
| E  | 建筑业              | 1,203,195.00  | 1.51         |
| F  | 批发和零售业           | 3,056,825.00  | 3.84         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,947,204.00  | 2.45         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 210,912.00    | 0.27         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,954,357.00  | 4.97         |
| J  | 金融业              | 1,718,201.00  | 2.16         |
| K  | 房地产业             | 3,241,831.00  | 4.08         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,540,528.00  | 1.94         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 225,860.00    | 0.28         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 452,192.00    | 0.57         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,205,449.00  | 2.77         |
| S  | 综合               | 142,238.00    | 0.18         |
|    | 合计               | 57,917,437.00 | 72.83        |

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

| 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 | 806,299.00 | 1.01         |
| B  | 采矿业      | 282,943.00 | 0.36         |



|   |                  |              |       |
|---|------------------|--------------|-------|
| C | 制造业              | 5,642,562.00 | 7.1   |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 166,416.00   | 0.21  |
| E | 建筑业              | 232,842.00   | 0.29  |
| F | 批发和零售业           | 595,189.00   | 0.75  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 262,463.00   | 0.33  |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 575,663.00   | 0.72  |
| J | 金融业              | 169,748.00   | 0.21  |
| K | 房地产业             | 341,154.00   | 0.43  |
| 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        | 95,000.00    | 0.12  |
| S | 综合               | -            | -     |
|   | 合计               | 9,170,279.00 | 11.53 |

(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。

**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**

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  | 002092 | 中泰化学 | 79,300  | 722,423.00 | 0.91         |
| 2  | 000623 | 吉林敖东 | 35,500  | 646,455.00 | 0.81         |
| 3  | 000060 | 中金岭南 | 114,100 | 576,205.00 | 0.72         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 4  | 002152 | 广电运通 | 77,800  | 567,940.00 | 0.71 |
| 5  | 601958 | 金钼股份 | 72,400  | 501,008.00 | 0.63 |
| 6  | 000028 | 国药一致 | 9,600   | 494,304.00 | 0.62 |
| 7  | 300027 | 华谊兄弟 | 89,600  | 488,320.00 | 0.61 |
| 8  | 000778 | 新兴铸管 | 94,200  | 482,304.00 | 0.61 |
| 9  | 600567 | 山鹰纸业 | 118,300 | 468,468.00 | 0.59 |
| 10 | 601801 | 皖新传媒 | 57,000  | 456,570.00 | 0.57 |

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  | 002714 | 牧原股份 | 6,900  | 436,839.00 | 0.55         |
| 2  | 300498 | 温氏股份 | 9,100  | 369,460.00 | 0.46         |
| 3  | 002138 | 顺络电子 | 14,700 | 277,977.00 | 0.35         |
| 4  | 002809 | 红墙股份 | 11,400 | 259,920.00 | 0.33         |
| 5  | 002449 | 国星光电 | 17,500 | 251,300.00 | 0.32         |

#### 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      | 2,508,500.00 | 3.15         |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,508,500.00 | 3.15         |
| 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） | 368,147.92   | 0.46         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,876,647.92 | 3.62         |

#### 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 | 25,000 | 2,508,500.00 | 3.15         |
| 2  | 113513 | 安井转债   | 1,600  | 187,792.00   | 0.24         |
| 3  | 123016 | 洲明转债   | 1,200  | 171,756.00   | 0.22         |
| 4  | 128061 | 启明转债   | 86     | 8,599.92     | 0.01         |

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (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<br>(元)      | 公允价值变动(元)  | 风险说明         |
|-------------------|--------|----------|------------------|------------|--------------|
| IC1904            | IC1904 | 7        | 7,743,960.0<br>0 | 220,845.71 | -            |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |          |                  |            | 220,845.71   |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |          |                  |            | 1,447,314.29 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |          |                  |            | 220,845.71   |

##### (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,以套期保值为目的,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,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并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。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与研判，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### (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。

### (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。

## 11、投资组合报告附注

(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

基金投资的前十名证券的发行主体除新兴铸管（股票代码：000778），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。

新兴铸管股份有限公司于2018年7月21日因环境污染问题被地方环保局处以罚款130万元。

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。

### (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。

### (3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）      |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,430,129.52  |
| 2  | 应收证券清算款 | 13,566,266.14 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 29,953.07     |
| 5  | 应收申购款   | 115,748.74    |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 15,142,097.47 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113513 | 安井转债 | 187,792.00 | 0.24         |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

**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。

**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。

(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。

**十三、基金的业绩**

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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如下表所示：

安信中证 500 指数增强 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    |
|----------------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 2018.11.29-2019.3.31 | 23.97%   | 1.26%       | 23.59%     | 1.54%         | 0.38% | -0.28% |

安信中证 500 指数增强 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     |
|--------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|---------|
| 2018. 11. 29-2019. 3. 31 | 23. 81%  | 1. 26%      | 23. 59%    | 1. 54%        | 0. 22% | -0. 28% |

#### 十四、基金的费用概览

##### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、标的指数许可使用费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

###### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

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 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 4、标的指数许可使用费

本基金基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

自基金合同生效之日起，标的指数许可使用费每日计提，按季支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于每年 1 月、4 月、7 月、10 月，将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第5-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### (四) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并经基金份额持有人大会审议通过后,可调整基金管理费率、基金托管费率或提高基金销售服务费率。

调低本基金C类基金份额的销售服务费率,无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

### (五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

本期更新招募说明书所载内容截止日为2019年5月29日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。现就本期更新招募说明书截止日前主要更新内容说明如下:

- 1、对“重要提示”部分进行了更新。



2、“第三部分 基金管理人”部分，更新基金管理人董事会成员、基金管理人监事会成员、基金管理人高级管理人员、本基金基金经理以及投资决策委员会成员信息，本基金基金经理未发生变更。

3、更新“第四部分 基金托管人”部分的内容。

4、“第五部分 相关服务机构”部分，更新了直销机构及其他销售机构的信息。

5、更新“第六部分 基金的募集”部分的内容。

6、更新“第七部分 基金合同的生效”部分的内容。

7、“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分，更新了申购、赎回开放日及业务办理时间、基金转换和定期定额投资计划的内容。

8、“第九部分 基金的投资”部分，更新风险收益特征的内容，并新增基金投资组合报告的内容。

9、新增“第十部分 基金的业绩”部分的内容，并更新后续序号。

10、更新“第二十二部分 其他应披露事项”部分的内容。

安信基金管理有限责任公司

2019年7月12日