

# 安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3 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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 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	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45

7.8	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	45
7.9	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	45
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>46</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	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情况	47
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>48</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>48</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>51</b>
11.1	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	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>52</b>
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	安信量化优选股票	
基金主代码	006346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 3 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	
报告期末基金份额总额	25,694,807.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	006346	006347
报告期末下属分级基金的 份额总额	11,345,440.67 份	14,349,367.26 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金使用量化模型构建股票组合,主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘,在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上,对数据进行个性化的分析处理,形成了一套完善的选股体系,并据此构建股票组合。资产配置方面,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。债券投资方面,采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等,更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险与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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798
注册地址		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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		刘入领	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)	
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
本期已实现收益	2,825,042.12	430,891.46
本期利润	2,793,120.93	258,931.06
加权平均基金份额本期利润	0.2619	0.0937

本期加权平均净值利润率	21.90%	7.50%
本期基金份额净值增长率	29.12%	29.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	2,827,219.35	3,546,416.80
期末可供分配基金份额利润	0.2492	0.2471
期末基金资产净值	14,172,660.02	17,895,784.06
期末基金份额净值	1.2492	1.2471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	24.92%	24.71%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同生效日为 2018 年 09 月 03 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

### 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

安信量化优选股票 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
过去一个月	0.15%	1.35%	0.77%	1.18%	-0.62%	0.17%
过去三个月	-2.50%	1.66%	-9.02%	1.54%	6.52%	0.12%
过去六个月	29.12%	1.57%	16.38%	1.52%	12.74%	0.05%
自基金合同生效起至今	24.92%	1.26%	3.53%	1.48%	21.39%	-0.22%

安信量化优选股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

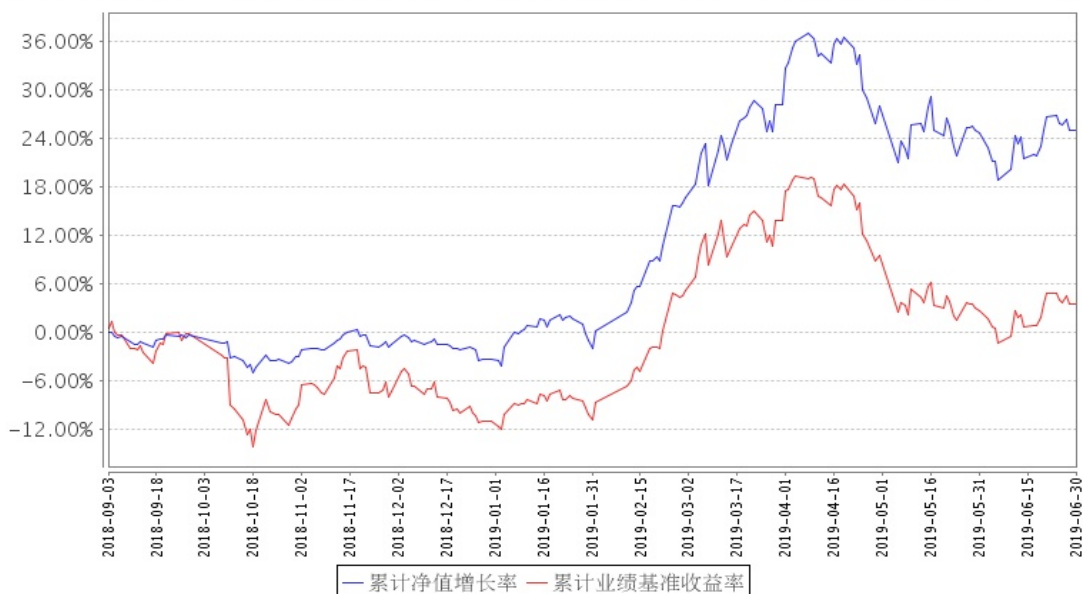
		②		准差④		
过去一个月	0.12%	1.35%	0.77%	1.18%	-0.65%	0.17%
过去三个月	-2.60%	1.66%	-9.02%	1.54%	6.42%	0.12%
过去六个月	29.07%	1.57%	16.38%	1.52%	12.69%	0.05%
自基金合同生效起至今	24.71%	1.27%	3.53%	1.48%	21.18%	-0.21%

注:根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场,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中小市值公司的整体情况;中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面,期限构成宽泛。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求,基准指数每日按照 85%、15%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信量化优选股票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





安信量化优选股票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、本基金基金合同生效日为 2018 年 9 月 3 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 2019 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 48 只开放式基金具体如下:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、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)、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利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、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券

投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）。

#### 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	2018年9月3日	-	17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。曾任安信量化多因子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、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。

杨扬	本基金的基金经理	2018 年 11 月 27 日	-	8 年	杨扬先生，清华大学工学硕士。历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究助理，上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员、投资助理，安信基金管理有限责任公司量化投资部投资经理助理、投资经理、基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾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、安信中证复兴发展 100 主题指数证券投资基金的基金经理助理；现任安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。
----	----------	------------------	---	-----	---

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。

##### 4.3.2 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。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

A 股市场各指数上半年均出现显著上涨，其中海外贸易摩擦有所反复对市场形成冲击，但与此同时政府应对国内外的不确定性迅速制定并实施了正确且有力的政策：首先全球贸易角度看，中美贸易谈判出现波折，但仍然向着好的可控的方向发展。其次是国内财政和货币政策应对得当，央行在包商银行出现问题的时候，快速行动，一定程度上解决了实体融资难的问题。国内无风险利率即出现一定的下行。同时减税政策无论对于居民还是企业都是受益匪浅，中国历史上最大规模的减税影响很可能超出市场预期。

本基金主要使用量化选股模型来发掘股票投资价值、构建股票组合。本基金建立了科学完整的量化选股体系，通过统计学和数学方法，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，从海量历史数据中寻找市场上存在的共性规律，并纪律严明地根据这些规律来指导投资，最大程度地避免主观情绪对投资的影响，力求取得稳定、可持续、高于基准的超额回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.2492 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.12%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.2471 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.07%；同期业绩比较基准收益率为 16.38%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于政策应对得当，我们认为国内外的经济形势相对平稳，好于市场预期。通胀水平有所上升但是也相对可控。市场对美国关税范围扩大至 2000 亿美元有一定预期，中国商务部也没有进一步跟进，人民币贬值一定程度上也能对冲关税影响，贸易战对市场风险偏好影响将逐渐钝化；信用债到期量平稳、“宽货币、紧信用”政策中宽货币持续发力，主动金融去杠杆节奏可控，后续去杠杆更多是结构性冲击。我们认为核心的有利因素在于 A 股估值处于合理偏低的位置，无论是沪深 300 指数市盈率约 12 倍，市净率约 1.5 倍，还是中证 800 指数的市盈率 13 倍，市净率约 1.5 倍，均已经落入历史平均偏低水平。

## 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，本基金托管人在对安信量化优选股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，安信新量化优选股票型发起式证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信新量化优选股票型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信新量化优选股票型发起式证券投

资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,326,772.93	977,394.59
结算备付金		115,246.36	39,792.29
存出保证金		5,661.17	1,499.50
交易性金融资产	6.4.7.2	29,771,670.92	8,755,993.20
其中：股票投资		29,771,670.92	8,755,993.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		220,841.25	31,542.25
应收利息	6.4.7.5	510.84	526.91
应收股利		-	-
应收申购款		20.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		32,440,724.46	9,806,748.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		220,388.38	35,328.45
应付赎回款		13,828.54	-
应付管理人报酬		33,744.86	12,568.86
应付托管费		5,624.12	2,094.80
应付销售服务费		4,402.83	8.67
应付交易费用	6.4.7.7	84,374.60	16,842.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	9,917.05	20,000.00
负债合计		372,280.38	86,843.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	25,694,807.93	10,046,568.67
未分配利润	6.4.7.10	6,373,636.15	-326,663.10
所有者权益合计		32,068,444.08	9,719,905.57
负债和所有者权益总计		32,440,724.46	9,806,748.74

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 25,694,807.93 份，其中安信量化优选股票 A 基金份额总额为 11,345,440.67 份，基金份额净值 1.2492 元；安信量化优选股票 C 基金份额总额为 14,349,367.26 份，基金份额净值 1.2471 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,409,867.28
1. 利息收入		6,671.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,671.25
债券利息收入		-
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）		3,589,192.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,340,278.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	248,913.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-203,881.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,885.14
减：二、费用		357,815.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	119,115.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,852.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,614.41
4. 交易费用	6.4.7.19	201,374.43
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	10,858.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,052,051.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,052,051.99

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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）	10,046,568.67	-326,663.10	9,719,905.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,052,051.99	3,052,051.99
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）	15,648,239.26	3,648,247.26	19,296,486.52
其中：1. 基金申购款	19,395,620.98	4,558,910.11	23,954,531.09
2. 基金赎回款	-3,747,381.72	-910,662.85	-4,658,044.57
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）	25,694,807.93	6,373,636.15	32,068,444.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：



刘入领范瑛苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信量化优选股票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”）2018年7月13日下发的证监许可[2018]1119号文关于“准予安信量化优选股票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《安信量化优选股票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2018年8月24日至2018年8月28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(2018)验字60962175\_H12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10,026,297.51元。经向中国证监会备案，《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于2018年9月3日正式生效。截至2018年8月30日止，本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10,026,297.51元，折合10,026,297.51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为人民币3.08元，折合3.08份基金份额。其中A类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10,000,297.51元，折合10,000,297.51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为人民币0.03元，折合0.03份基金份额；C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币26,000.00元，折合26,000.00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为人民币3.05元，折合3.05份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币10,026,300.59元，折合10,026,300.59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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，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。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### 6.4.6.2 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。

##### 6.4.6.3 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；

#### 6.4.6.4 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,326,772.93
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,326,772.93

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,135,741.28	29,771,670.92	-364,070.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	30,135,741.28	29,771,670.92	-364,070.36

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	456.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	51.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.50
合计	510.84

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	84,374.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	84,374.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.06
预提费用	9,916.99
合计	9,917.05

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信量化优选股票 A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,020,565.62	10,020,565.62
本期申购	1,840,354.75	1,840,354.75
本期赎回（以“-”号填列）	-515,479.70	-515,479.70
本期末	11,345,440.67	11,345,440.67

##### 安信量化优选股票 C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,003.05	26,003.05
本期申购	17,555,266.23	17,555,266.23
本期赎回（以“-”号填列）	-3,231,902.02	-3,231,902.02
本期末	14,349,367.26	14,349,367.26

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信量化优选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-166,048.81	-159,736.11	-325,784.92
本期利润	2,825,042.12	-31,921.19	2,793,120.93
本期基金份额交易产生的变动数	223,816.52	136,066.82	359,883.34
其中：基金申购款	298,235.01	175,558.98	473,793.99
基金赎回款	-74,418.49	-39,492.16	-113,910.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,882,809.83	-55,590.48	2,827,219.35
安信量化优选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-464.08	-414.10	-878.18
本期利润	430,891.46	-171,960.40	258,931.06
本期基金份额交易产生的变动数	3,184,755.67	103,608.25	3,288,363.92
其中：基金申购款	3,739,739.56	345,376.56	4,085,116.12
基金赎回款	-554,983.89	-241,768.31	-796,752.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,615,183.05	-68,766.25	3,546,416.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	5,518.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,117.68
其他	34.76
合计	6,671.25

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	71,946,972.51
减：卖出股票成本总额	68,606,693.83
买卖股票差价收入	3,340,278.68

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	248,913.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	248,913.80

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-203,881.59
股票投资	-203,881.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-203,881.59

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	17,717.01

基金转换费收入	168.13
合计	17,885.14

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	201,374.43
银行间市场交易费用	-
合计	201,374.43

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
银行汇划费用	542.00
其他	400.00
合计	10,858.99

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	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



佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	119,115.02
其中：支付销售机构的客户维护费	3,380.12

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,852.44

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	5,109.22	5,109.22
工商银行	-	-	-
安信证券	-	166.46	166.46
合计	-	5,275.68	5,275.68

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。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年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
		安信量化优选股票 A

基金合同生效日（2018年9月3日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
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	38.92%	-%

#### 6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	2,326,772.93	5,518.81

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具为包括在国内依法发行上市的股票、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在

银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2018 年 12 月 31 日：无）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银

行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	2,326,772.93	-	-	-	2,326,772.93
结算备付金	115,246.36	-	-	-	115,246.36
存出保证金	5,661.17	-	-	-	5,661.17
交易性金融资产	-	-	-	29,771,670.92	29,771,670.92
应收利息	-	-	-	510.84	510.84
应收申购款	-	-	-	20.99	20.99
应收证券清算款	-	-	-	220,841.25	220,841.25
<b>资产总计</b>	<b>2,447,680.46</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>29,993,044.00</b>	<b>32,440,724.46</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	13,828.54	13,828.54
应付管理人报酬	-	-	-	33,744.86	33,744.86
应付托管费	-	-	-	5,624.12	5,624.12
应付证券清算款	-	-	-	220,388.38	220,388.38
应付销售服务费	-	-	-	4,402.83	4,402.83
应付交易费用	-	-	-	84,374.60	84,374.60
其他负债	-	-	-	9,917.05	9,917.05
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>372,280.38</b>	<b>372,280.38</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>2,447,680.46</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>29,620,763.62</b>	<b>32,068,444.08</b>
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	977,394.59	-	-	-	977,394.59
结算备付金	39,792.29	-	-	-	39,792.29
存出保证金	1,499.50	-	-	-	1,499.50
交易性金融资产	-	-	-	8,755,993.20	8,755,993.20
应收利息	-	-	-	526.91	526.91
应收证券清算款	-	-	-	31,542.25	31,542.25
<b>资产总计</b>	<b>1,018,686.38</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,788,062.36</b>	<b>9,806,748.74</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	12,568.86	12,568.86
应付托管费	-	-	-	2,094.80	2,094.80
应付证券清算款	-	-	-	35,328.45	35,328.45

应付销售服务费	-	-	-	8.67	8.67
应付交易费用	-	-	-	16,842.39	16,842.39
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	86,843.17	86,843.17
利率敏感度缺口	1,018,686.38	-	-	8,701,219.19	9,719,905.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2019 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 80% - 95%，持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,771,670.92	92.84	8,755,993.20	90.08

交易性金融资产 —基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 —贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 —权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,771,670.92	92.84	8,755,993.20	90.08

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	1、沪深 300 指数上升 5%	1,424,570.14	498,405.72
	2、沪深 300 指数下降 5%	-1,424,570.14	-498,405.72

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	29,771,670.92	91.77
	其中：股票	29,771,670.92	91.77
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	-	-
	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	2,442,019.29	7.53
8	其他各项资产	227,034.25	0.70
9	合计	32,440,724.46	100.00



## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	798,587.10	2.49
B	采矿业	722,035.00	2.25
C	制造业	16,456,589.92	51.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,452,043.40	4.53
E	建筑业	232,939.00	0.73
F	批发和零售业	2,471,789.60	7.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,087,838.00	3.39
H	住宿和餐饮业	201,717.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,260,944.10	7.05
J	金融业	425,355.00	1.33
K	房地产业	2,202,780.80	6.87
L	租赁和商务服务业	262,926.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	202,230.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	299,144.00	0.93
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	495,362.00	1.54
S	综合	199,390.00	0.62
	合计	29,771,670.92	92.84

### 7.2.2 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。

### 7.3 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002893	华通热力	14,120	211,517.60	0.66
2	600801	华新水泥	10,300	208,575.00	0.65
3	603508	思维列控	3,200	208,256.00	0.65
4	000936	华西股份	22,900	204,497.00	0.64
5	600031	三一重工	15,500	202,740.00	0.63
6	000672	上峰水泥	16,500	202,455.00	0.63

7	002398	建研集团	31,500	202,230.00	0.63
8	600719	大连热电	37,500	202,125.00	0.63
9	300702	天宇股份	5,600	201,824.00	0.63
10	000524	岭南控股	24,100	201,717.00	0.63
11	300461	田中精机	9,100	201,474.00	0.63
12	300543	朗科智能	9,500	200,925.00	0.63
13	002746	仙坛股份	12,950	200,336.50	0.62
14	600580	卧龙电驱	23,800	200,158.00	0.62
15	603199	九华旅游	9,000	200,070.00	0.62
16	002489	浙江永强	59,900	200,066.00	0.62
17	002299	圣农发展	7,900	200,028.00	0.62
18	601677	明泰铝业	19,400	200,014.00	0.62
19	603319	湘油泵	11,520	199,987.20	0.62
20	002053	云南能投	25,300	199,870.00	0.62
21	601588	北辰实业	53,200	199,500.00	0.62
22	600673	东阳光	25,400	199,390.00	0.62
23	002441	众业达	25,100	199,294.00	0.62
24	603089	正裕工业	13,715	199,278.95	0.62
25	000031	大悦城	31,000	199,020.00	0.62
26	002803	吉宏股份	9,750	198,997.50	0.62
27	002208	合肥城建	24,900	198,951.00	0.62
28	300575	中旗股份	6,960	198,777.60	0.62
29	002406	远东传动	33,100	198,600.00	0.62
30	300118	东方日升	19,500	198,510.00	0.62
31	000700	模塑科技	52,500	198,450.00	0.62
31	000966	长源电力	35,000	198,450.00	0.62
32	002458	益生股份	10,160	198,221.60	0.62
33	601717	郑煤机	34,700	198,137.00	0.62
34	300031	宝通科技	16,000	197,760.00	0.62
35	600810	神马股份	16,000	197,600.00	0.62
35	601900	南方传媒	20,800	197,600.00	0.62
36	002195	二三四五	50,790	197,573.10	0.62
37	300035	中科电气	34,900	197,534.00	0.62
38	002560	通达股份	33,700	197,482.00	0.62
39	600675	中华企业	38,020	197,323.80	0.62
40	600070	浙江富润	24,300	197,316.00	0.62
41	300428	四通新材	18,200	197,106.00	0.61
42	000603	盛达矿业	17,600	196,768.00	0.61
43	603878	武进不锈	18,300	196,725.00	0.61
44	600633	浙数文化	21,000	196,350.00	0.61
45	600287	江苏舜天	29,700	196,020.00	0.61
46	000951	中国重汽	12,200	195,810.00	0.61

47	300697	电工合金	14,700	195,657.00	0.61
48	002882	金龙羽	16,200	195,534.00	0.61
49	002315	焦点科技	11,700	195,507.00	0.61
50	002425	凯撒文化	30,200	195,394.00	0.61
51	002554	惠博普	53,800	195,294.00	0.61
52	600127	金健米业	39,200	195,216.00	0.61
53	600368	五洲交通	41,700	195,156.00	0.61
54	300531	优博讯	11,100	194,916.00	0.61
55	000850	华茂股份	43,400	194,432.00	0.61
56	000906	浙商中拓	30,100	193,844.00	0.60
57	300696	爱乐达	7,100	193,404.00	0.60
58	603299	苏盐井神	28,600	193,050.00	0.60
59	002757	南兴股份	10,851	192,822.27	0.60
60	600053	九鼎投资	8,200	191,060.00	0.60
61	000036	华联控股	34,560	176,601.60	0.55
62	002233	塔牌集团	14,500	169,360.00	0.53
63	600668	尖峰集团	13,100	167,680.00	0.52
64	601566	九牧王	13,600	167,552.00	0.52
65	300219	鸿利智汇	22,600	166,788.00	0.52
66	600993	马应龙	9,400	165,910.00	0.52
67	300735	光弘科技	9,600	163,968.00	0.51
68	600120	浙江东方	12,590	160,396.60	0.50
69	600826	兰生股份	12,200	136,396.00	0.43
70	600592	龙溪股份	10,500	136,290.00	0.42
71	600167	联美控股	12,860	136,058.80	0.42
72	300690	双一科技	6,000	134,400.00	0.42
73	002399	海普瑞	6,400	134,336.00	0.42
74	600261	阳光照明	36,600	134,322.00	0.42
75	600757	长江传媒	19,700	134,157.00	0.42
76	002043	兔宝宝	22,200	134,088.00	0.42
77	600681	百川能源	18,000	133,920.00	0.42
78	300300	汉鼎宇佑	12,900	133,902.00	0.42
78	600724	宁波富达	34,600	133,902.00	0.42
79	600461	洪城水业	21,200	133,560.00	0.42
80	600611	大众交通	28,700	133,455.00	0.42
81	002514	宝馨科技	21,900	133,371.00	0.42
82	002083	孚日股份	23,600	133,340.00	0.42
83	002884	凌霄泵业	9,080	133,294.40	0.42
84	603167	渤海轮渡	13,500	133,245.00	0.42
85	600665	天地源	33,900	133,227.00	0.42
86	600269	赣粤高速	30,000	133,200.00	0.42
87	600662	强生控股	25,400	133,096.00	0.42

88	002608	江苏国信	15,600	133,068.00	0.41
89	000155	川能动力	31,300	133,025.00	0.41
90	600785	新华百货	8,000	132,960.00	0.41
91	002543	万和电气	9,900	132,858.00	0.41
92	300511	雪榕生物	16,500	132,825.00	0.41
92	600020	中原高速	25,300	132,825.00	0.41
93	601567	三星医疗	22,900	132,820.00	0.41
94	000919	金陵药业	17,000	132,770.00	0.41
95	600626	申达股份	19,400	132,696.00	0.41
96	600328	兰太实业	16,200	132,678.00	0.41
97	600266	北京城建	16,440	132,506.40	0.41
98	002478	常宝股份	21,900	132,495.00	0.41
99	000848	承德露露	15,900	132,447.00	0.41
100	300303	聚飞光电	40,000	132,400.00	0.41
101	002346	柘中股份	10,200	132,396.00	0.41
102	002635	安洁科技	9,800	132,202.00	0.41
103	000999	华润三九	4,500	132,030.00	0.41
104	600728	佳都科技	13,400	131,990.00	0.41
105	600327	大东方	34,820	131,967.80	0.41
106	601918	新集能源	42,800	131,824.00	0.41
107	600064	南京高科	12,300	131,733.00	0.41
108	600475	华光股份	12,100	131,648.00	0.41
109	002110	三钢闽光	14,150	131,595.00	0.41
110	600985	淮北矿业	11,600	131,544.00	0.41
111	000530	大冷股份	30,300	131,502.00	0.41
112	002451	摩恩电气	13,100	131,393.00	0.41
113	000821	京山轻机	16,200	131,382.00	0.41
114	600727	鲁北化工	19,700	131,202.00	0.41
115	600694	大商股份	4,700	131,177.00	0.41
116	600865	百大集团	21,500	131,150.00	0.41
117	002760	凤形股份	7,100	130,853.00	0.41
118	300467	迅游科技	7,100	130,782.00	0.41
119	300532	今天国际	8,600	130,720.00	0.41
120	002875	安奈儿	6,800	130,560.00	0.41
121	002657	中科金财	7,500	130,500.00	0.41
122	002712	思美传媒	18,800	130,472.00	0.41
123	000637	茂化实华	28,000	130,200.00	0.41
124	603026	石大胜华	4,300	130,118.00	0.41
125	600587	新华医疗	8,100	129,195.00	0.40
126	300221	银禧科技	20,000	129,000.00	0.40
127	300508	维宏股份	4,100	128,289.00	0.40
128	600530	交大昂立	22,500	128,250.00	0.40

129	300353	东土科技	9,800	127,792.00	0.40
130	000885	城发环境	11,400	127,338.00	0.40
131	300205	天喻信息	8,500	127,160.00	0.40
132	300686	智动力	8,700	126,411.00	0.39
133	000732	泰禾集团	6,100	100,650.00	0.31
134	300599	雄塑科技	9,200	100,648.00	0.31
135	002088	鲁阳节能	8,200	100,450.00	0.31
136	600170	上海建工	26,700	100,392.00	0.31
137	600618	氯碱化工	12,700	99,822.00	0.31
138	000736	中交地产	13,000	99,580.00	0.31
139	000686	东北证券	11,300	99,553.00	0.31
140	603165	荣晟环保	5,300	99,481.00	0.31
141	000928	中钢国际	17,100	99,351.00	0.31
142	002097	山河智能	15,900	99,216.00	0.31
143	601058	赛轮轮胎	33,400	99,198.00	0.31
144	000417	合肥百货	19,100	99,129.00	0.31
145	002734	利民股份	6,600	98,736.00	0.31
146	002381	双箭股份	12,400	98,580.00	0.31
147	600740	山西焦化	11,600	98,484.00	0.31
148	603300	华铁科技	12,300	98,154.00	0.31
149	300417	南华仪器	4,600	97,474.00	0.30
150	002272	川润股份	13,400	73,700.00	0.23
151	600366	宁波韵升	7,800	71,604.00	0.22
152	600644	乐山电力	10,900	69,215.00	0.22
153	000789	万年青	6,900	69,138.00	0.22
154	600864	哈投股份	8,800	68,640.00	0.21
155	300200	高盟新材	7,200	68,040.00	0.21
156	603730	岱美股份	2,900	67,976.00	0.21
157	603393	新天然气	2,900	67,860.00	0.21
158	600802	福建水泥	8,200	67,650.00	0.21
158	603839	安正时尚	5,500	67,650.00	0.21
159	000338	潍柴动力	5,500	67,595.00	0.21
160	000517	荣安地产	22,000	67,540.00	0.21
161	000921	海信家电	5,400	67,392.00	0.21
162	600755	厦门国贸	7,800	67,314.00	0.21
163	002234	民和股份	2,400	67,176.00	0.21
164	002267	陕天然气	8,200	67,158.00	0.21
165	000573	粤宏远A	20,000	67,000.00	0.21
166	600606	绿地控股	9,800	66,934.00	0.21
167	600739	辽宁成大	4,600	66,884.00	0.21
168	603585	苏利股份	2,800	66,864.00	0.21
169	600062	华润双鹤	5,300	66,833.00	0.21

170	000863	三湘印象	12,700	66,802.00	0.21
171	600704	物产中大	12,300	66,666.00	0.21
172	600533	栖霞建设	18,400	66,608.00	0.21
173	002128	露天煤业	7,700	66,605.00	0.21
174	300571	平治信息	1,600	66,480.00	0.21
175	000629	攀钢钒钛	19,600	66,444.00	0.21
176	002283	天润曲轴	16,900	66,417.00	0.21
177	600585	海螺水泥	1,600	66,400.00	0.21
178	002555	三七互娱	4,900	66,395.00	0.21
179	002438	江苏神通	8,100	66,258.00	0.21
180	600035	楚天高速	19,600	66,248.00	0.21
181	603798	康普顿	5,700	66,234.00	0.21
182	002126	银轮股份	8,900	66,216.00	0.21
183	002755	奥赛康	5,700	66,177.00	0.21
184	002394	联发股份	6,800	66,164.00	0.21
185	600282	南钢股份	18,900	66,150.00	0.21
186	002582	好想你	7,300	66,138.00	0.21
187	600643	爱建集团	6,900	66,102.00	0.21
188	600997	开滦股份	10,800	66,096.00	0.21
189	603689	皖天然气	6,000	66,060.00	0.21
190	300270	中威电子	8,700	66,033.00	0.21
191	002462	嘉事堂	4,400	66,000.00	0.21
192	300175	朗源股份	11,300	65,992.00	0.21
193	000059	华锦股份	10,300	65,920.00	0.21
194	300578	会畅通讯	2,500	65,825.00	0.21
195	000034	神州数码	5,100	65,790.00	0.21
196	002137	麦达数字	9,800	65,758.00	0.21
197	600285	羚锐制药	7,800	65,754.00	0.21
198	600706	曲江文旅	5,600	65,744.00	0.21
199	300320	海达股份	13,800	65,688.00	0.20
200	600325	华发股份	8,400	65,604.00	0.20
201	600191	华资实业	11,900	65,569.00	0.20
202	000717	韶钢松山	14,800	65,564.00	0.20
203	000623	吉林敖东	4,000	65,560.00	0.20
204	300068	南都电源	5,800	65,540.00	0.20
205	000932	华菱钢铁	13,720	65,444.40	0.20
206	002221	东华能源	7,600	65,436.00	0.20
207	300292	吴通控股	10,900	65,400.00	0.20
208	000030	富奥股份	14,000	65,380.00	0.20
209	000811	冰轮环境	7,400	65,342.00	0.20
210	600229	城市传媒	8,700	65,337.00	0.20
211	002866	传艺科技	5,800	65,308.00	0.20

212	600551	时代出版	7,200	65,304.00	0.20
213	603277	银都股份	6,700	64,990.00	0.20
214	000606	顺利办	10,700	64,949.00	0.20
215	002235	安妮股份	7,400	64,898.00	0.20
216	600793	宜宾纸业	3,700	64,565.00	0.20
217	600677	航天通信	3,700	64,269.00	0.20
218	002889	东方嘉盛	1,400	34,300.00	0.11
219	601002	晋亿实业	4,800	33,888.00	0.11
220	603396	金辰股份	1,540	33,864.60	0.11
221	000049	德赛电池	1,300	33,839.00	0.11
222	600056	中国医药	2,500	33,725.00	0.11
223	002605	姚记扑克	3,200	33,600.00	0.10
224	600648	外高桥	1,600	33,568.00	0.10
225	000929	兰州黄河	4,200	33,474.00	0.10
226	000425	徐工机械	7,500	33,450.00	0.10
227	603926	铁流股份	2,700	33,345.00	0.10
228	300422	博世科	3,000	33,330.00	0.10
229	300443	金雷股份	2,300	33,304.00	0.10
230	601000	唐山港	12,100	33,275.00	0.10
231	600647	同达创业	2,200	33,264.00	0.10
232	600829	人民同泰	4,700	33,229.00	0.10
233	000926	福星股份	4,800	33,216.00	0.10
234	002062	宏润建设	8,600	33,196.00	0.10
235	600185	格力地产	6,800	33,116.00	0.10
236	000601	韶能股份	6,900	33,051.00	0.10
237	600522	中天科技	3,600	33,012.00	0.10
238	002161	远望谷	4,600	32,982.00	0.10
239	300146	汤臣倍健	1,700	32,980.00	0.10
240	600466	蓝光发展	5,300	32,966.00	0.10
241	300148	天舟文化	8,200	32,964.00	0.10
242	002860	星帅尔	1,700	32,946.00	0.10
243	603298	杭叉集团	2,600	32,916.00	0.10
244	600382	广东明珠	4,280	32,913.20	0.10
245	603368	柳药股份	1,000	32,880.00	0.10
246	600332	白云山	800	32,776.00	0.10
247	002788	鹭燕医药	4,100	32,636.00	0.10
248	002111	威海广泰	2,600	32,630.00	0.10
249	603980	吉华集团	3,600	32,616.00	0.10
250	000676	智度股份	3,600	32,472.00	0.10
251	600782	新钢股份	6,400	32,000.00	0.10

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 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	300417	南华仪器	531,746.00	5.47
2	300219	鸿利智汇	512,027.00	5.27
3	000848	承德露露	495,341.00	5.10
4	600053	九鼎投资	456,611.00	4.70
5	002746	仙坛股份	448,352.50	4.61
6	002875	安奈儿	442,245.00	4.55
7	300690	双一科技	441,732.00	4.54
8	002803	吉宏股份	416,605.00	4.29
9	600719	大连热电	413,770.00	4.26
10	300531	优博讯	412,088.00	4.24
11	300735	光弘科技	407,297.00	4.19
12	600728	佳都科技	405,457.00	4.17
13	300578	会畅通讯	386,981.00	3.98
14	600070	浙江富润	378,062.00	3.89
15	000936	华西股份	372,873.00	3.84
16	603800	道森股份	369,620.00	3.80
17	603277	银都股份	366,612.00	3.77
18	002195	二三四五	362,764.40	3.73
19	002514	宝馨科技	358,040.00	3.68
20	601900	南方传媒	355,676.00	3.66
21	002438	江苏神通	354,445.00	3.65
22	601058	赛轮轮胎	345,051.00	3.55
23	002554	惠博普	344,874.00	3.55
24	600368	五洲交通	337,721.00	3.47
25	002478	常宝股份	332,834.00	3.42
26	300543	朗科智能	330,491.00	3.40
27	300443	金雷股份	326,271.00	3.36
28	603538	美诺华	317,522.00	3.27
29	002399	海普瑞	312,719.00	3.22
30	601588	北辰实业	309,687.00	3.19
31	600673	东阳光	306,640.00	3.15
32	300031	宝通科技	304,866.00	3.14
33	000603	盛达矿业	301,368.00	3.10
34	002458	益生股份	298,743.00	3.07
35	600452	涪陵电力	296,593.00	3.05
36	300467	迅游科技	295,377.00	3.04
37	002882	金龙羽	294,795.00	3.03



38	600285	羚锐制药	291,727.95	3.00
39	600328	兰太实业	291,311.00	3.00
40	603508	思维列控	290,248.00	2.99
41	002893	华通热力	289,088.30	2.97
42	600810	神马股份	287,131.00	2.95
43	000966	长源电力	286,767.00	2.95
44	002381	双箭股份	285,966.00	2.94
45	002444	巨星科技	282,760.00	2.91
46	000951	中国重汽	278,262.00	2.86
47	600580	卧龙电驱	278,078.00	2.86
48	002468	申通快递	277,229.00	2.85
49	002110	三钢闽光	277,216.00	2.85
50	002233	塔牌集团	276,440.00	2.84
51	601515	东风股份	275,958.00	2.84
52	600793	宜宾纸业	275,914.00	2.84
53	600740	山西焦化	274,798.00	2.83
54	002299	圣农发展	274,109.00	2.82
55	002097	山河智能	274,033.00	2.82
56	601677	明泰铝业	273,236.00	2.81
57	300575	中旗股份	271,502.00	2.79
58	300461	田中精机	270,639.00	2.78
59	600120	浙江东方	269,922.00	2.78
60	002441	众业达	267,923.00	2.76
61	300423	鲁亿通	267,407.00	2.75
62	300088	长信科技	265,865.00	2.74
63	600706	曲江文旅	265,613.00	2.73
64	600993	马应龙	263,342.00	2.71
65	600997	开滦股份	263,175.00	2.71
66	002449	国星光电	262,304.00	2.70
67	002406	远东传动	261,763.00	2.69
68	603393	新天然气	261,683.00	2.69
69	600287	江苏舜天	261,379.00	2.69
70	600020	中原高速	257,655.00	2.65
71	002734	利民股份	257,136.00	2.65
72	600127	金健米业	256,745.00	2.64
73	600681	百川能源	256,490.00	2.64
74	300205	天喻信息	256,472.00	2.64
75	600035	楚天高速	256,393.00	2.64
76	000850	华茂股份	256,105.00	2.63
77	300532	今天国际	255,682.00	2.63
78	000686	东北证券	253,866.00	2.61
79	600167	联美控股	252,377.00	2.60

80	603313	梦百合	251,708.00	2.59
81	002757	南兴股份	250,467.00	2.58
82	603878	武进不锈	250,392.00	2.58
83	603319	湘油泵	248,264.40	2.55
84	002398	建研集团	247,803.00	2.55
85	300702	天宇股份	246,566.00	2.54
86	603199	九华旅游	245,943.00	2.53
87	002489	浙江永强	243,477.00	2.50
88	300428	四通新材	243,293.00	2.50
89	600675	中华企业	242,441.00	2.49
90	600668	尖峰集团	242,282.00	2.49
91	300571	平治信息	240,326.00	2.47
92	002425	凯撒文化	239,535.00	2.46
93	300697	电工合金	238,763.00	2.46
94	600261	阳光照明	238,716.00	2.46
95	002272	川润股份	237,123.00	2.44
96	300389	艾比森	236,617.00	2.43
97	300118	东方日升	235,932.00	2.43
98	002315	焦点科技	232,827.00	2.40
99	000789	万年青	232,383.00	2.39
100	600229	城市传媒	231,261.00	2.38
101	000700	模塑科技	231,133.00	2.38
102	603299	苏盐井神	230,885.00	2.38
103	300696	爱乐达	230,224.00	2.37
104	300035	中科电气	230,133.00	2.37
105	002053	云南能投	229,057.00	2.36
106	000031	大悦城	228,246.00	2.35
107	002208	合肥城建	227,213.00	2.34
108	600618	氯碱化工	227,063.00	2.34
109	000524	岭南控股	226,441.00	2.33
110	000906	浙商中拓	225,631.00	2.32
111	000672	上峰水泥	225,051.00	2.32
112	002088	鲁阳节能	224,191.60	2.31
113	002560	通达股份	223,469.00	2.30
114	601717	郑煤机	220,798.00	2.27
115	600985	淮北矿业	220,415.00	2.27
116	600633	浙数文化	220,267.00	2.27
117	600031	三一重工	219,486.00	2.26
118	002772	众兴菌业	219,218.00	2.26
119	000338	潍柴动力	218,821.00	2.25
120	300511	雪榕生物	218,368.00	2.25
121	300243	瑞丰高材	218,297.00	2.25

122	603369	今世缘	217,069.00	2.23
123	600475	华光股份	216,791.00	2.23
124	002283	天润曲轴	216,003.00	2.22
125	600152	维科技术	215,618.00	2.22
126	000928	中钢国际	214,337.00	2.21
127	002884	凌霄泵业	213,054.20	2.19
128	601566	九牧王	213,030.00	2.19
129	600785	新华百货	212,148.00	2.18
130	603089	正裕工业	211,586.00	2.18
131	300599	雄塑科技	211,028.00	2.17
132	601137	博威合金	210,724.00	2.17
133	300175	朗源股份	206,988.00	2.13
134	601002	晋亿实业	206,497.00	2.12
135	603283	赛腾股份	203,814.00	2.10
136	300638	广和通	203,603.00	2.09
137	603500	祥和实业	203,598.00	2.09
138	300508	维宏股份	202,235.00	2.08
139	603326	我乐家居	202,199.00	2.08
140	002128	露天煤业	200,569.00	2.06
141	600657	信达地产	199,435.00	2.05
142	600585	海螺水泥	199,310.00	2.05
143	600731	湖南海利	198,944.00	2.05
144	603030	全筑股份	197,996.00	2.04
145	002555	三七互娱	197,559.00	2.03
146	603300	华铁科技	197,396.00	2.03
147	603801	志邦家居	197,121.00	2.03
148	601918	新集能源	196,823.00	2.02
149	603018	中设集团	196,476.00	2.02
150	600801	华新水泥	195,980.00	2.02
151	600655	豫园股份	195,356.00	2.01
152	600755	厦门国贸	194,763.00	2.00

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。

#### 7.4.2 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	300417	南华仪器	457,117.00	4.70
2	603800	道森股份	383,793.00	3.95
3	002468	申通快递	377,136.00	3.88
4	300423	鲁亿通	369,527.60	3.80

5	000848	承德露露	363,052.00	3.74
6	600452	涪陵电力	359,994.00	3.70
7	002746	仙坛股份	352,384.40	3.63
8	300219	鸿利智汇	344,601.00	3.55
9	300088	长信科技	330,375.00	3.40
10	300578	会畅通讯	330,016.36	3.40
11	300443	金雷股份	323,890.00	3.33
12	002875	安奈儿	318,305.00	3.27
13	603538	美诺华	314,106.00	3.23
14	300690	双一科技	310,176.00	3.19
15	002444	巨星科技	310,072.00	3.19
16	603277	银都股份	302,327.00	3.11
17	002438	江苏神通	296,104.00	3.05
18	300638	广和通	295,902.00	3.04
19	601515	东风股份	288,042.00	2.96
20	601058	赛轮轮胎	284,319.00	2.93
21	600728	佳都科技	279,783.85	2.88
22	300632	光莆股份	279,086.00	2.87
23	002449	国星光电	277,994.00	2.86
24	601137	博威合金	270,180.00	2.78
25	600070	浙江富润	269,630.00	2.77
26	000936	华西股份	269,481.00	2.77
27	600152	维科技术	266,052.00	2.74
28	600053	九鼎投资	263,991.00	2.72
29	603086	先达股份	261,973.00	2.70
30	600657	信达地产	258,170.00	2.66
31	603985	恒润股份	254,571.00	2.62
32	300735	光弘科技	254,256.00	2.62
33	603313	梦百合	253,543.00	2.61
34	000789	万年青	243,255.00	2.50
35	300243	瑞丰高材	243,012.00	2.50
36	300120	经纬辉开	241,133.00	2.48
37	600997	开滦股份	240,714.00	2.48
38	002803	吉宏股份	240,528.00	2.47
39	300389	艾比森	239,451.00	2.46
40	300531	优博讯	236,469.00	2.43
41	002195	二三四五	235,836.00	2.43
42	600655	豫园股份	235,293.00	2.42
43	000159	国际实业	231,278.00	2.38
44	002705	新宝股份	229,768.00	2.36
45	002772	众兴菌业	229,698.00	2.36
46	600285	羚锐制药	227,449.73	2.34

47	603030	全筑股份	226,861.00	2.33
48	002040	南京港	226,519.00	2.33
49	002478	常宝股份	224,601.00	2.31
50	603369	今世缘	222,488.00	2.29
51	600035	楚天高速	222,307.00	2.29
52	600731	湖南海利	221,386.00	2.28
53	002514	宝馨科技	219,457.00	2.26
54	600719	大连热电	218,821.00	2.25
55	603980	吉华集团	217,427.00	2.24
56	300341	麦克奥迪	217,324.00	2.24
57	601900	南方传媒	216,257.00	2.22
58	601233	桐昆股份	215,418.00	2.22
59	300175	朗源股份	212,250.00	2.18
60	600585	海螺水泥	212,212.00	2.18
61	603996	ST 中新	211,213.00	2.17
62	600793	宜宾纸业	210,611.00	2.17
63	300571	平治信息	209,205.00	2.15
64	603283	赛腾股份	208,991.00	2.15
65	300132	青松股份	207,478.00	2.13
66	603801	志邦家居	207,409.00	2.13
67	000731	四川美丰	206,937.00	2.13
68	603326	我乐家居	206,013.80	2.12
69	000823	超声电子	205,389.00	2.11
70	600706	曲江文旅	204,014.00	2.10
71	300687	赛意信息	201,351.00	2.07
72	300230	永利股份	200,922.00	2.07
73	600740	山西焦化	200,517.00	2.06
74	603669	灵康药业	199,028.00	2.05
75	603500	祥和实业	198,151.00	2.04
76	002110	三钢闽光	197,174.00	2.03
77	600977	中国电影	195,627.00	2.01
78	000828	东莞控股	195,186.00	2.01
79	603018	中设集团	194,666.00	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。

#### 7.4.3 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	89,826,253.14
卖出股票收入（成交）总额	71,946,972.51

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货的投资, 以管理投资组合的系统性风险, 改善组合的风险收益特性。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则, 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。

##### 7.11.2 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。

##### 7.11.3 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体除上峰水泥(股票代码: 000672), 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。

甘肃上峰水泥股份有限公司于 2018 年 7 月 4 日因未依法履行职责及重大事故被安监局罚款 34500 元（（庆）安监管（工）罚[2018]第（005）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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	5,661.17
2	应收证券清算款	220,841.25
3	应收股利	-
4	应收利息	510.84
5	应收申购款	20.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	227,034.25

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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(%)
安信量化优选	79	143,613.17	10,000,000.00	88.14	1,345,440.67	11.86

股票 A						
安信量化优选股票 C	487	29,464.82	12,838,710.76	89.47	1,510,656.50	10.53
合计	557	46,130.71	22,838,710.76	88.88	2,856,097.17	11.12

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）。

### 8.2 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	安信量化优选股票 A	7,426.31	0.0655
	安信量化优选股票 C	14,811.52	0.1032
	合计	22,237.83	0.0865

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0

### 8.4 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	38.92	10,000,000.00	38.92	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	38.92	10,000,000.00	38.92	-



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 3 日）基金份额总额	10,000,297.54	26,003.05
本报告期期初基金份额总额	10,020,565.62	26,003.05
本报告期基金总申购份额	1,840,354.75	17,555,266.23
减：本报告期基金总赎回份额	515,479.70	3,231,902.02
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	11,345,440.67	14,349,367.26

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 1 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第三届董事会第十次会议审议通过，廖维坤先生自 2019 年 5 月 31 日起担任公司副总经理兼首席信息官。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	113,075,627.69	69.90	80,432.67	69.90	-
广发证券	2	48,697,597.96	30.10	34,637.64	30.10	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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。

#### 10.7.2 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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权

		成交总额的比例		购成交总额的比例		证成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报	2019-01-19
2	安信基金管理有限责任公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司和北京钱景基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2019-01-30
3	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-02-28
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长春高新（000661）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-03-06
5	关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金和安信恒利增强债券型证券投资基金新增上海基煜基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报、证券时报	2019-03-15
6	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2018 年年度报告摘要	上海证券报	2019-03-29
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持格力电器（000651）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-02
8	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-03

9	安信量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	上海证券报	2019-04-17
10	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报	2019-04-22
11	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-13
12	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增开源证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、上海证券报	2019-05-15
13	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-20
14	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-01
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
16	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
17	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2019-06-21
18	关于安信基金管理有限责任公司暂停快速取现业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20190101-20190630	10,000,000.00			10,000,000.00	38.92
	2	20190605-20190630		12,838,710.76		12,838,710.76	49.97
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信量化优选股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 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8月27日**