

# 安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资 基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 23 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信量化沪深 300 增强
交易代码	003957
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 05 月 07 日
报告期末基金份额总额	126,062,256.12 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*90%+商业银行活期存款利率（税后）*10%

风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	2, 888, 614. 22 份	123, 173, 641. 90 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(2019 年 07 月 01 日 - 2019 年 09 月 30 日)	
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	47, 545. 65	2, 624, 421. 86
2. 本期利润	6, 985. 21	2, 443, 681. 61
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0057	0. 0273
4. 期末基金资产净值	3, 282, 986. 45	138, 746, 722. 47
5. 期末基金份额净值	1. 1365	1. 1264

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

安信量化沪深 300 增强 A

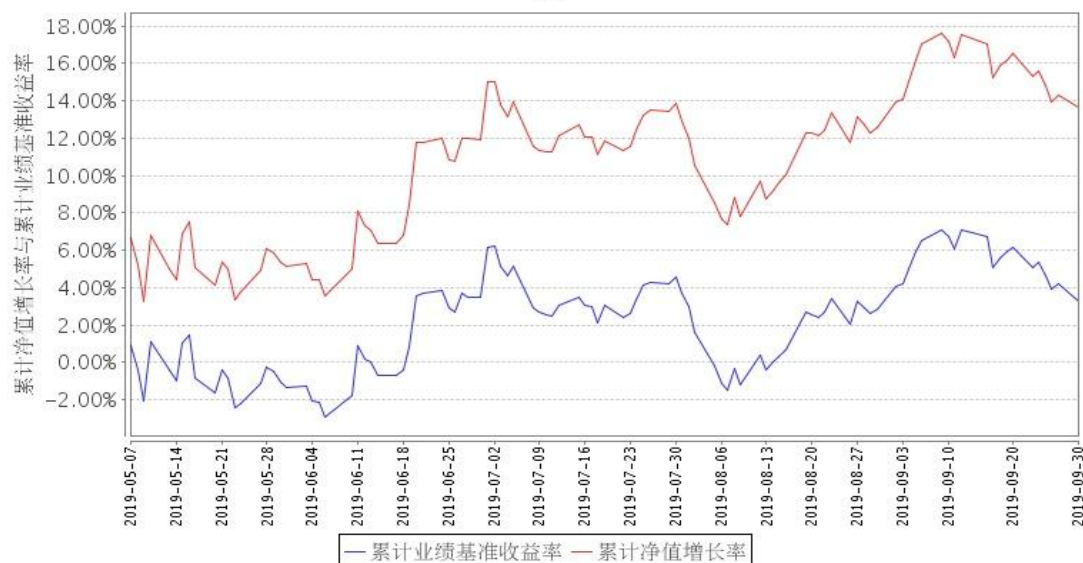
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1. 50%	0. 90%	-0. 23%	0. 86%	1. 73%	0. 04%

安信量化沪深 300 增强 C

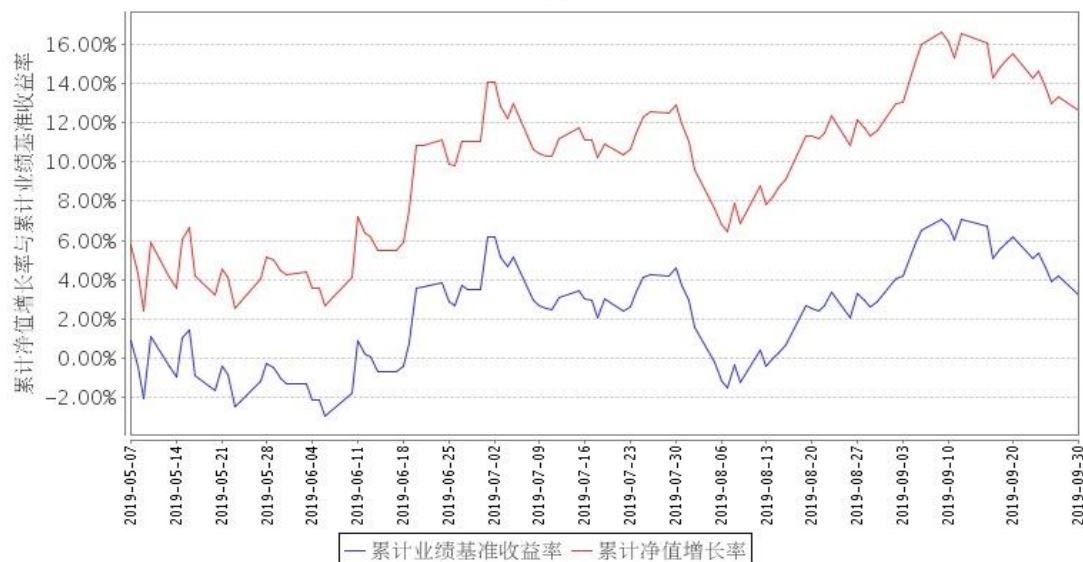
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.45%	0.90%	-0.23%	0.86%	1.68%	0.04%

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

安信量化沪深300增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信量化沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金 2019 年 5 月 7 日由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 7 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

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

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

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

### 4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所

有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济仍处于回落区间，行业景气多数下行，央行采用降准措施应对，货币政策中性偏宽松，仍有继续宽松的空间，中美贸易摩擦出现反复，风险偏好也出现反复。

本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。主要是运用量化多因子模型，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素构建相对基准有稳定超额收益的投资组合。三季度，本基金也积极把握了指数成分调整、科创板新股、市场趋势变化等确定性增强机会。

##### 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 类基金份额净值为 1.1365 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.50%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.1264 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.45%；同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

#### 4.5 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	127,179,961.64	89.23
	其中：股票	127,179,961.64	89.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,068,379.64	4.96
	其中：债券	7,068,379.64	4.96
	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	3,400,510.26	2.39

8	其他资产	4,888,504.52	3.43
9	合计	142,537,356.06	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

#### 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	2,181,818.00	1.54
B	采矿业	3,277,073.20	2.31
C	制造业	51,930,711.74	36.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,554,852.00	1.80
E	建筑业	3,809,092.80	2.68
F	批发和零售业	1,605,159.00	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	3,253,043.00	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,004,340.10	3.52
J	金融业	43,589,252.33	30.69
K	房地产业	5,583,822.00	3.93
L	租赁和商务服务业	1,707,749.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	161,262.00	0.11
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	737,865.10	0.52
R	文化、体育和娱乐业	447,705.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	125,843,745.27	88.60

#### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	877,911.97	0.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和	-	-

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	458,304.40	0.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,336,216.37	0.94

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	117,800	10,253,312.00	7.22
2	600519	贵州茅台	5,500	6,325,000.00	4.45
3	600036	招商银行	113,600	3,947,600.00	2.78
4	000651	格力电器	52,200	2,991,060.00	2.11
5	000858	五粮液	22,000	2,855,600.00	2.01
6	601166	兴业银行	159,881	2,802,713.93	1.97
7	600276	恒瑞医药	34,144	2,754,737.92	1.94
8	000333	美的集团	53,850	2,751,735.00	1.94
9	600030	中信证券	93,000	2,090,640.00	1.47
10	600887	伊利股份	67,456	1,923,845.12	1.35

#### 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	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.10
2	002463	沪电股份	4,200	102,900.00	0.07
3	601966	玲珑轮胎	4,400	89,672.00	0.06



4	603927	中科软	884	78,198.64	0.06
5	300450	先导智能	2,300	77,510.00	0.05

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,499,450.00	3.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,550,930.00	1.09
	其中：政策性金融债	1,550,930.00	1.09
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）	17,999.64	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,068,379.64	4.98

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	55,000	5,499,450.00	3.87
2	108901	农发 1801	15,500	1,550,930.00	1.09
3	128075	远东转债	180	17,999.64	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1912	IF1912	3	3,436,200.00	12,180.00	-
IF1910	IF1910	2	2,293,320.00	-28,080.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-15,900.00

股指期货投资本期收益（元）	472,527.38
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-18,000.00

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行（股票代码：600036 SH）、兴业银行（股票代码：601166 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2019 年 8 月 22 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责，被深圳市消委会责令整改。

2019 年 7 月 2 日，招商银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易，经自查为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心现对招商银行进行通报批评，要求加强风险控制和内部管理。

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

2019 年 8 月 19 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责，被中国银行间市场交易商协会监管谈话，责令改正。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	607,837.08
2	应收证券清算款	2,138,957.29
3	应收股利	-
4	应收利息	128,930.54
5	应收申购款	2,012,779.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,888,504.52

### 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

#### 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。

### 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	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	628,537.35	33,573,982.66
报告期期间基金总申购份额	2,400,841.39	113,486,733.02
减：报告期期间基金总赎回份额	140,764.52	23,887,073.78
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,888,614.22	123,173,641.90

## §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

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,578,094.25
------------------	---------------

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

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	基金转换出	2019-08-23	6,000,000.00	6,690,000.00	0.00
2	基金转换出	2019-08-26	5,578,094.25	6,269,220.13	0.00
合计			11,578,094.25	12,959,220.13	

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190701-20190718	11,578,094.25	-	11,578,094.25	-	-
	2	20190701-20190718	14,895,729.89	-	-	14,895,729.89	11.82
	3	20190719-20190930	-	41,701,896.69	2,500,000.00	39,201,896.69	31.10
	4	20190717-20190718	-	7,648,011.52	500,000.00	7,148,011.52	5.67
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 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

2019 年 10 月 23 日