

# 安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资 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	安信沪深 300 增强
交易代码	003261
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 12 日
报告期末基金份额总额	16,728,441.44 份
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。
投资策略	股票投资上，本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。债券投资上，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，确定组合久期及债券资产配置。股指期货投资上，本基金以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。资产支持证券投资上，对部分高质量的资产支持证券采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。	
业绩比较基准	95%*沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003261	003262
报告期末下属分级基金的份额总额	14,301,508.55 份	2,426,932.89 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)	
	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	988,939.48	196,031.66
2. 本期利润	-151,456.61	-15,253.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.0047
4. 期末基金资产净值	16,831,473.98	2,821,397.34
5. 期末基金份额净值	1.1769	1.1625

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

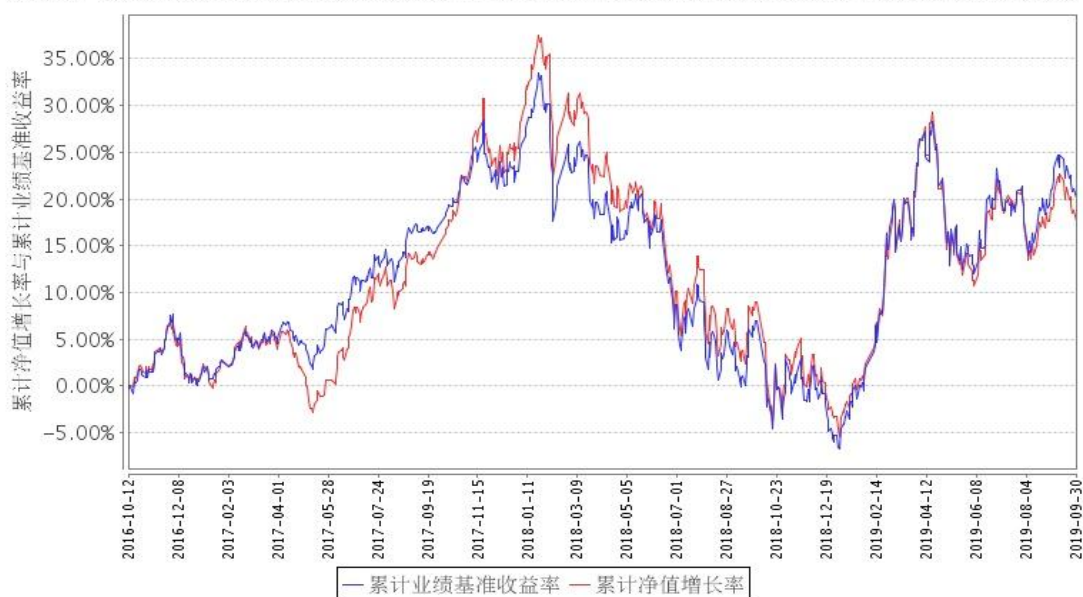
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.08%	0.89%	0.12%	0.91%	-1.20%	-0.02%

安信沪深 300 增强 C

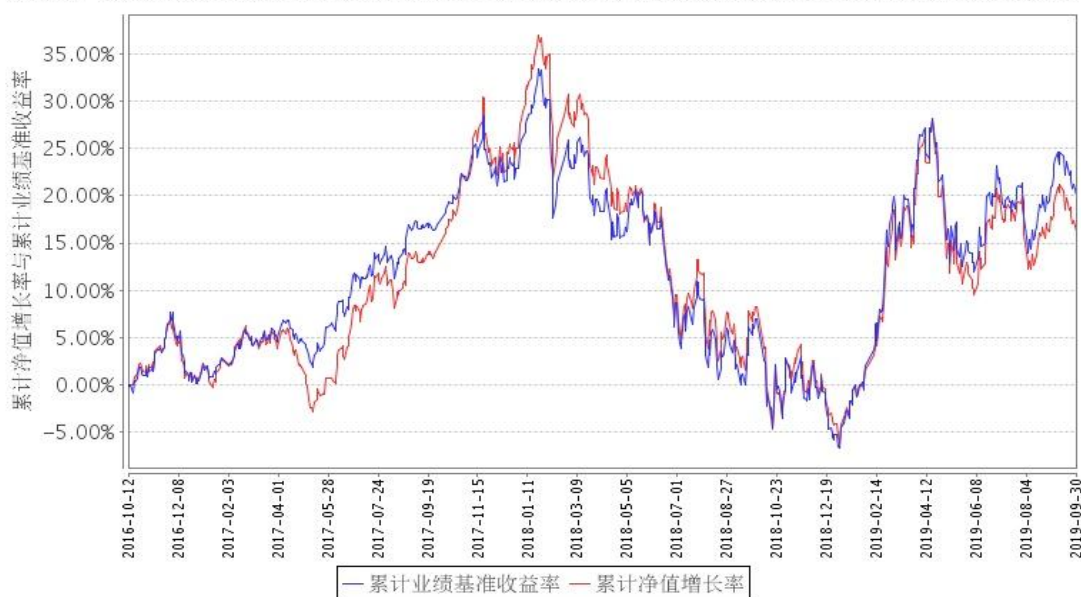
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.20%	0.89%	0.12%	0.91%	-1.32%	-0.02%

#### 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、本基金合同生效日为 2016 年 10 月 12 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2016年10月12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证券投资基金的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深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。

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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能会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

2019 年三季度市场整体处于震荡走势，上证指数下跌 2.47%，沪深 300 指数下跌 0.29%，中证 500 指数下跌 0.19%，创业板指数上涨 7.69%，小盘股好于大盘股。分行业来看，三季度电子、计算机、医药等行业涨幅居前，钢铁、房地产、建筑等行业涨幅靠后。尽管房地产行业的半年度业绩表现亮眼，但由于国家对房地产行业的政策打压再度趋严，使得房地产行业的估值进一步被压缩，整体股价表现较差。另一方面，市场资金面依然维持较宽松的局面，无风险利率依然在较低的位置，加上市场对贸易战的态度变得不再敏感，以及华为的国产化替代计划大范围启动，使得市场对于科技公司的中长期态度变得积极了很多，进而带动了华为产业链与整个科技板块的行情。另外，半年报表现较好的消费股依然表现比较好。从国际贸易角度看，中美贸易谈判仍处于轨道之中，虽然有波折但依然在可控的范围内。从政策角度看，国内财政和货币政策同时发力，信贷资金倾向于小微企业和民营企业，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。减税政策无论对于居民还是企业都是受益匪浅，财政托底现象也较为明显。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，积极获取超额收益率。

#### 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 1.1769 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.08%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.1625 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.20%；同期业绩比较基准收益率为 0.12%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	18,167,091.00	91.75
	其中：股票	18,167,091.00	91.75
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	1,580,689.69	7.98
8	其他资产	52,263.31	0.26
9	合计	19,800,044.00	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	314,730.00	1.60
B	采矿业	532,307.00	2.71
C	制造业	7,457,165.00	37.94
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应业	396,674.00	2.02
E	建筑业	494,290.00	2.52

F	批发和零售业	224,856.00	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	504,655.00	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	705,233.00	3.59
J	金融业	6,296,582.00	32.04
K	房地产业	738,831.00	3.76
L	租赁和商务服务业	262,809.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	17,340.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	21,472.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	109,852.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	90,295.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	18,167,091.00	92.44

**报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）**

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

**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	13,400	1,166,336.00	5.93
2	600519	贵州茅台	700	805,000.00	4.10
3	600036	招商银行	16,900	587,275.00	2.99
4	000651	格力电器	7,800	446,940.00	2.27
5	601166	兴业银行	23,900	418,967.00	2.13
6	600276	恒瑞医药	5,000	403,400.00	2.05
7	000858	五粮液	3,100	402,380.00	2.05
8	000333	美的集团	7,100	362,810.00	1.85
9	600030	中信证券	13,300	298,984.00	1.52
10	600887	伊利股份	8,900	253,828.00	1.29

**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**

本基金本报告期末未持有积极投资股票。



#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

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

#### 5.11 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行（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	4,379.49
2	应收证券清算款	47,508.19
3	应收股利	-
4	应收利息	375.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,263.31

### 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	安信沪深 300 增强 A	安信沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	15,797,064.63	3,570,922.95
报告期期间基金总申购份额	1,036,357.39	512,012.35
减：报告期期间基金总赎回份额	2,531,913.47	1,656,002.41
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	14,301,508.55	2,426,932.89

## §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	10,002,825.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,825.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	59.80

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末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	10,002,825.57	59.80	10,000,000.00	59.78	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	10,002,825.57	59.80	10,000,000.00	59.78	-

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20190701-20190930	10,002,825.57	-	-	10,002,825.57	59.80
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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金因出现基金合同终止事由于 2019 年 10 月 12 日终止运作，并于 2019 年 10 月 13 日进入清算程序。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集的文件；

- 2、《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信沪深 300 指数增强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。

## 10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

## 10.3 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