安信活期宝货币市场基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月27日

§1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信活期宝	
交易代码	003402	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月17日	
报告期末基金份额总额	2,516,486,599.37份	
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造稳定的收益。	
投资策略	资产配置方面，本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的判研。同时，通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析，确定本基金流动性目标，相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比。在个券方面，本基金将首先考虑安全性因素，优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
下属分级基金的交易代码	003402	004167
报告期末下属分级基金的份额总额	962,085,669.99份	1,554,400,929.38份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日 — 2017年9月30日）	
	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
1. 本期已实现收益	4,534,370.02	15,743,995.85
2. 本期利润	4,534,370.02	15,743,995.85
3. 期末基金资产净值	962,085,669.99	1,554,400,929.38

注：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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信活期宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0954%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.7551%	0.0014%

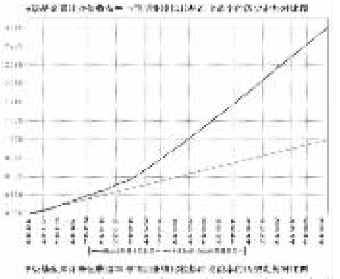
注：本基金收益分配为按日结转份额。

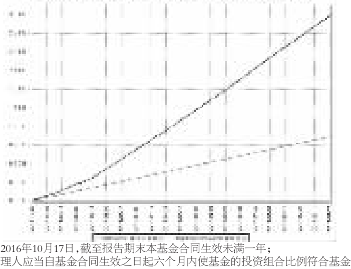
安信活期宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0991%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.7588%	0.0014%

注：本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金合同生效日为2016年10月17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。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。

3、本基金自2016年12月22日起增加B类份额。

§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		
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016年10月17日	－	11	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。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	－	6	肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司资产管理部研究员、财达证券有限责任公司资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理助理，现任安信安盈保本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、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，现任安信保证金交易型货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金的基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，经济景气度持续高位，投资增速、信贷增速基本保持稳定；监管态度温和，银行去杠杆进程加速，M2持续回落；超储率持续低位，shibor先先后上；我们根据对资金情况的预判进行了波段操作，并在季末月增配了大量优质资产，获取较高收益外，为四季度投资打好了基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期安信活期宝货币A的基金份额净值收益率为1.0954%，本报告期安信活期宝货币B的基金份额净值收益率为1.0991%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,701,428,005.39	93.86
	其中：债券	2,701,428,005.39	93.86
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	159,855,639.78	5.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	3,871,354.15	0.13
4	其他资产	12,838,347.34	0.45
5	合计	2,877,993,346.66	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	13.19	
	其中：买断式回购融资	－	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	359,948,740.06	14.30
	其中：买断式回购融资	－	－

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期未出现投资组合平均剩余存续期超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	8.09	14.30
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天(含)－60天	13.08	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.99	－
3	60天(含)－90天	44.94	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天(含)－120天	8.24	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	120天(含)－397天（含）	39.51	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	113.86	14.30

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,998,966.14	0.12
2	央行票据	－	－
3	金融债券	230,054,357.87	9.14
	其中：政策性金融债	230,054,357.87	9.14
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	80,313,089.70	3.19
6	中期票据	－	－
7	同业存单	2,388,061,591.68	94.90
8	其他	－	－
9	合计	2,701,428,005.39	107.35
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	100,351,785.04	3.99

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111719290	17恒丰银行CD290	2,000,000	198,266,594.78	7.88
2	160305	16进出05	1,000,000	100,351,785.04	3.99
3	111614213	16江苏银行CD213	1,000,000	99,365,696.77	3.95
4	111681045	16杭州银行CD192	1,000,000	99,286,401.78	3.95
5	111707233	17招商银行CD233	1,000,000	99,167,867.28	3.94
6	111710449	17兴业银行CD449	1,000,000	99,166,048.56	3.94
6	111708295	17中信银行CD295	1,000,000	99,166,048.56	3.94
7	111716193	17上海银行CD193	1,000,000	99,158,991.83	3.94
7	111719286	17恒丰银行CD286	1,000,000	99,158,991.83	3.94
8	111715316	17民生银行CD316	1,000,000	98,030,392.75	3.90
9	111714262	17江苏银行CD262	1,000,000	98,023,297.96	3.90
10	111718358	17华夏银行CD358	1,000,000	97,982,238.81	3.89

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)－0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1518%
报告期内偏离度的最低值	－0.0083%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0698%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	453.27
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	4,215,340.43
4	应收申购款	8,622,553.64
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	12,838,347.34

5.9.4 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	安信活期宝货币A	安信活期宝货币B
报告期期初基金份额总额	133,916,416.58	1,370,053,706.33
报告期期间基金总申购份额	2,081,500,854.07	416,167,801.93
报告期期间基金总赎回份额	1,253,331,600.66	231,820,578.88
报告期期末基金份额总额	962,085,669.99	1,554,400,929.38

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20170701－20170731	304,600,488.40	3,317,016.99	－	307,917,505.39	12.24%
	2	20170701－20170930	500,534,929.95	5,450,690.13	－	505,985,620.08	20.11%
	3	20170710－20170717	299,430,038.97	2,833,210.02	90,000,000.00	212,263,248.99	8.43%
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、中国证监会核准安信活期宝货币市场基金募集的文件；
2、《安信活期宝货币市场基金基金合同》；
3、《安信活期宝货币市场基金托管协议》；
4、《安信活期宝货币市场基金招募说明书》；
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008－088－088
网址：http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2017年10月27日

安信价值精选股票型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月27日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信价值精选股票
交易代码	000577
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月21日
报告期末基金份额总额	1,282,910,360.35份
投资目标	在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，重点关注包括GDP增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金的股票资产主要投资于价值型股票，坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上，分析基础利率的走势，研究利率期限结构和中长期收益率走势，在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金，属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日 — 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	29,583,801.32
2.本期利润	236,112,435.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.1999
4.期末基金资产净值	3,519,161,840.19
5.期末基金份额净值	2.743

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；

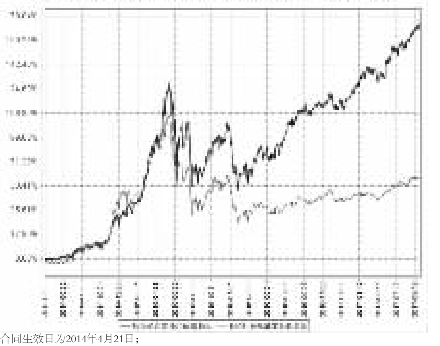
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	7.48%	0.71%	3.62%	0.47%	3.86%	0.24%

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



注：1、本基金基金合同生效日为2014年4月21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		
陈一峰	本基金的基金经理、公司总经理助理兼权益投资部总经理	2014年4月21日	－	9	陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员，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，现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、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的基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我们继续坚持自下而上的投资选股思路，在充分研究公司商业模式、竞争优势，公司成长空间，行业竞争格局的背景下，结合估值水平，注重安全边际，选择低估值的价值股和合理估值的成长股，总结成一句话就是："好公司，好价格，买入并持有，赚钱是大概率事件"。

从市场角度来看，三季度市场保持一个震荡略微上行的态势，沪深300指数上涨4.6%，中证500指数上证7.6%，创业板指数上涨2.7%，三季度我们的产品也取得了一定涨幅，截止三季度末单位净值2.743，三季度上涨7.48%，今年以来上涨了30.06%。结构方面，虽然有一些题材类股票估值仍然偏高，但市场估值分化依然较大，可选的优秀公司估值水平都还在相对合理的位置。

对未来的展望方面，总体我们认为短期市场还将维持震荡的格局，宏观经济今年以来保持了较强的韧性，大盘股的估值还处于历史平均位置，创业板指的估值已经跌到历史后1/4的水平，但绝对估值水平仍然偏高，我们继续坚持以精选个股为主要投资策略，选择买入价值存在低估的优秀公司以期望为投资者获取长期回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为2.743元；本报告期基金份额净值增长率为7.48%，业绩比较基准收益率为3.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,240,612,454.76	89.98
	其中：股票	3,240,612,454.76	89.98
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	49,945,000.00	1.39
	其中：债券	49,945,000.00	1.39
	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	40,000,000.00	1.11
	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	240,167,805.14	6.67
8	其他资产	30,588,059.14	0.85
9	合计	3,601,313,319.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	69,064,422.88	1.96
C	制造业	2,079,284,429.01	59.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,127,365.44	1.00
E	建筑业	190,196,900.36	5.40
F	批发和零售业	128,600,034.11	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	40,019,019.41	1.14
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,218,297.18	2.00
J	金融业	480,945,366.12	13.67
K	房地产业	2,961,694.96	0.08
L	租赁和商务服务业	87,320,057.80	2.48
M	科学研究和技术服务业	2,897,607.00	0.08
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	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	53,861,960.50	1.53
S	综合	－	－
	合计	3,240,612,454.76	92.08

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

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	600887	伊利股份	7,366,625	202,582,187.50	5.76
2	600036	招商银行	6,026,740	153,983,207.00	4.38
3	600183	生益科技	7,342,303	112,557,504.99	3.20
4	600703	三安光电	4,542,967	105,124,256.38	2.99
5	002078	太阳纸业	9,718,500	97,185,000.00	2.76
6	002466	天齐锂业	1,262,200	88,720,038.00	2.52
7	002027	分众传媒	8,598,500	86,414,925.00	2.46
8	601288	农业银行	22,183,000	84,739,060.00	2.41
9	600566	济川药业	2,233,818	82,338,531.48	2.34
10	000498	山东路桥	9,159,210	75,563,482.50	2.15

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	49,945,000.00	1.42
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
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）	－	－
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	49,945,000.00	1.42

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	160024	16附息国债24	500,000	49,945,000.00	1.42

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

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

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除分众传媒（002027），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。

根据2017年6月8日分众传媒信息技术股份有限公司（下称分众传媒，股票代码：002027）《分众传媒信息技术股份有限公司关于收到证监会广东监管局警示函的公告》，分众传媒近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局下发的《关于对分众传媒信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2017】14号），根据《证券法》第一百七十九条、《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，证监会广东监管局对分众传媒予以警示：请分众传媒认真吸取教训，切实加强对证券法律法规的学习，不断完善内部控制，依法履行信息披露义务，杜绝此类问题再次发生。

基金管理人对上述股票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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	366,160.06
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	1,006,433.08
5	应收申购款	29,215,466.00
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	30,588,059.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,071,259,229.62
报告期期间基金总申购份额	421,137,332.05
减:报告期期间基金总赎回份额	209,486,201.32
报告期期末基金份额总额	1,282,910,360.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信价值精选股票型证券投资基金募集的文件；
2、《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
3、《安信价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
4、《安信价值精选股票型证券投资基金招募说明书》；
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008－088－088
网址：http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2017年10月27日

安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月27日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信沪深300增强	
交易代码	003261	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2016年10月12日	
报告期末基金份额总额	136,289,718.45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	安信沪深增强A	安信沪深增强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	135,647,922.44份	641,796.01份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日 — 2017年9月30日）	
	安信沪深增强A	安信沪深增强C
1. 本期已实现收益	14,541,623.44	75,296.77
2. 本期利润	8,641,457.72	42,613.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0633	0.0587
4. 期末基金资产净值	155,570,944.68	734,394.14
5. 期末基金份额净值	1.1469	1.1443

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

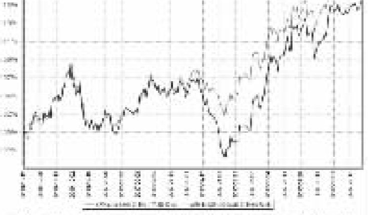
安信沪深增强A

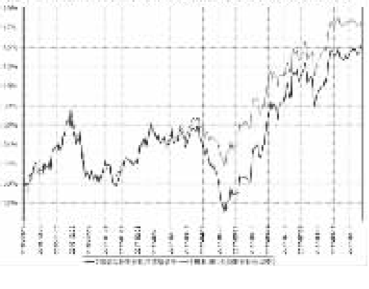
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.82%	0.62%	4.79%	0.56%	1.03%	0.06%

安信沪深增强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	5.65%	0.62%	4.79%	0.56%	0.86%	0.06%

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





注：1、本基金合同生效日为2016年10月12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。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	－	15	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。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、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度，上半年市场大小盘严重分化的现象有所缓和，但是整体风格仍然是以公司业绩为导向的价值投资风格，为了与这种市场风格相契合，本产品采用的是以基本面选股因子为主的量化模型，在本季度中，模型表现优秀，超越业绩比较基准1.42%。

安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。本基金管理人将继续坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，力争获取稳健的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信沪深增强A基金份额净值为1.1469元，本报告期基金份额净值增长率为5.82%；截至本报告期末安信沪深增强C基金份额净值为1.1443元，本报告期基金份额净值增长率为5.65%；同期业绩比较基准收益率为4.79%。

4.6 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，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	144,654,359.70	92.12
	其中：股票	144,654,359.70	92.12
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	7,496,250.00	4.77
	其中：债券	7,496,250.00	4.77
	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	4,672,631.32	2.98
8	其他资产	209,472.81	0.13
9	合计	157,032,713.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,049,081.00	0.67
B	采矿业	2,252,491.00	1.44
C	制造业	51,281,813.76	32.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,391,714.00	0.89
E	建筑业	3,284,637.00	2.10
F	批发和零售业	1,421,457.19	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,268,740.00	0.81
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,726,404.00	3.02
J	金融业	53,507,684.86	34.23
K	房地产业	9,209,669.00	5.89
L	租赁和商务服务业	622,834.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	3,899,154.00	2.49
S	综合	1,534,593.00	0.98
	合计	135,450,272.81	86.66

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采掘业	454,889.60	0.29
C	制造业	4,239,197.16	2.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	264,689.44	0.17
E	建筑业	310,390.00	0.20
F	批发和零售业	1,469,213.45	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	210,096.91	0.13
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,070.03	0.09
J	金融业	－	－
K	房地产业	1,118,779.00	0.72
L	租赁和商务服务业	815,499.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	25,440.00	0.02
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	115,299.99	0.07
R	文化、体育和娱乐业	11,860.31	0.01
S	综合	22,662.00	0.01
	合计	9,204,086.89	5.89

5.2.3 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

5.3.1 报告期末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	000333	美的集团	191,400	8,457,966.00	5.41
2	000725	京东方A	1,886,500	8,300,600.00	5.31
3	000858	五粮液	141,400	8,099,392.00	5.18
4	601318	中国平安	141,600	7,669,056.00	4.91
5	600036	招商银行	247,039	6,311,846.45	4.04
6	600016	民生银行	566,600	4,544,132.00	2.91
7	601328	交通银行	658,500	4,161,720.00	2.66
8	600030	中信证券	228,700	4,160,053.00	2.66
9	601288	农业银行	915,700	3,497,974.00	2.24
10	600837	海通证券	235,200	3,476,256.00	2.22

5.3.2 报告期末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	600666	奥瑞德	64,960	1,130,304.00	0.72
2	000061	农产品	81,000	714,420.00	0.46
3	600657	信达地产	47,900	299,854.00	0.19
4	600859	王府井	15,400	274,120.00	0.18
5	600823	世茂股份	49,900	267,963.00	0.17

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	7,496,250.00	4.80
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
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）	－	－
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	7,496,250.00	4.80

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	019563	17国债09	75,000	7,496,250.00	4.80

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除中信证券（600030）和海通证券（600837），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。

根据2017年5月25日中信证券股份有限公司（下称中信证券，股票代码：600030）《中信证券股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，中信证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字［2017］57号），依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款；对宜新亚、宋成给予警告，并分别处以人民币10万元罚款。

根据2016年11月29日海通证券股份有限公司（下称海通证券，股票代码：600837）《海通证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》，2015年8月24日海通证券收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）《调查通知书》（津证调查字2015011号），依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款。

根据2017年5月25日海通证券股份有限公司（下称海通证券，股票代码：600837）《海通证券股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，2017年5月23日海通证券收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）行政处罚事先告知书（处罚字【2017】59号），依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，证监会决定：责令海通证券改正，给予警告，没收违法所得509,653.15元，并处罚款2,548,265.75元，对左秀海、徐晓啸、朱元灏给予警告，并分别处以10万元罚款。

基金管理人对上述股票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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	95,322.63
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	103,547.37
5	应收申购款	10,602.81
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	209,472.81

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

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600666	奥瑞德	1,130,304.00	0.72	重大事项

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	安信沪深增强A	安信沪深增强C
报告期期初基金份额总额	137,491,886.27	729,437.79
报告期期间基金总申购份额	27,899,846.23	409,681.28
减:报告期期间基金总赎回份额	29,743,810.06	497,323.06
报告期期末基金份额总额	135,647,922.44	641,796.01

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
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	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.52

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 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	10,000,000.00	7.34	10,000,000.00	7.34	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	7.34	10,000,000.00	7.34	3年

§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	20170701－20170930	30,555,756.23	－	－	30,555,756.23	22.42%
	2	20170701－20170930	67,605,756.23	－	－	67,605,756.23	49.60%
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

无。

§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

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
2017年10月27日