

## 安信价值精选股票型证券投资基金

## [2016] 第一季度报告

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:2016年4月22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2016年4月20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信息,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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31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	
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014/4/21
报告期末基金资产总额	32,084,392,095.00

投资目标 在深入研究的基础上,精选具有长期持续盈利能力的股票进行投资,追求资本增值。

投资策略 本基金将主要通过分析宏观经济、行业景气度、公司治理、估值水平、盈利能力和成长性等大类投资因子,结合对个股的深入分析和精选,坚持全市场选股,主要投资于具备核心竞争力的优质企业,重点关注具有持续增长的盈利能力、合理的估值水平和良好的成长性,并严格控制仓位,降低组合波动率。

投资范围 分析基金的投资比例,研究利用统计学和数量化方法,对股票进行综合评价,选择具有持续增长的盈利能力、合理的估值水平和良好的成长性,并严格控制仓位,降低组合波动率。

业绩比较基准 95%×中证成份股息率指数+5%×中证行业轮动指数

风险收益特征 本基金为股票型基金,风险收益水平高于货币市场基金,属于高风险、高收益的理财产品。

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

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-2,180,160.69	
2.本期利润	-9,949,076.62	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.02746	
4.期末基金资产净值	67,717,361.31	
5.期末基金份额净值	1.783	

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

平即为净收益,亦称“净值收益率”。

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 本基金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的标准差 ④

过去三个月 -0.72% 2.04% -10.80% 1.34% 0.06%

注:本基金的基准收益 = 沪深300指数收益率 × 20% × 业绩比较基准收益率 × 20% × 表现比

基准在每个交易日实现平衡。

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

比率

图示:安信价值精选股票型证券投资基金净值走势图

注:1. 本基金的建仓期为2014年4月21日至2014年10月20日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2. 本基金基金合同生效日为2014年4月21日。图示日期为2014年4月21日至2016年3月31日。

3. 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的管理期间 任期日期 离任日期 证券从业年限

陈峰	本基金的基金经理	2014/4/21	-	8
----	----------	-----------	---	---

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. 证券从业人员标准遵行业务《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员

范围内的相关规定。

3.2.3 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内,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》、《证券投资基金销售适用性管理办法》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 公平交易制度的情况

本报告期内,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

司制公平交易原则,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

本基金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

今年以来市场出现了一定程度的下跌,月度指数跌幅基本都超过20%,个股普遍超过30%。进

入3月后,市场又出现了反弹,各大指数反弹9%左右。我们一直采用精选股票的策略,下阶段跌幅较小,同时,我们在市场底部提高了仓位,精选了一些估值合理的成长型股票,获得了一定的超

额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-9.72%,同期

业绩比较基准收益率为-10.86%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本报告期内,本基金尚未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低

于5000万元人民币的情形。

§ 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	权证投资	61,990,784.00	0.76
2	基金投资	61,990,784.00	0.76
3	固定收益投资	66,099,633.00	0.10
4	货币市场基金	66,099,633.00	0.10
5	银行存款	1,162,520.01	0.00
6	金融衍生品投资	1,162,520.01	0.00
7	股票投资	209,796,079.00	0.00
8	其他投资	2,122,104.98	0.00
9	合计	69,316,515.00	100.00

注:1. 本基金的建仓期为2014年4月21日至2014年10月20日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2. 本基金基金合同生效日为2014年4月21日。图示日期为2014年4月21日至2016年3月31日。

3. 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的管理期间 任期日期 离任日期 证券从业年限

陈峰	本基金的基金经理	2014/4/21	-	8
----	----------	-----------	---	---

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. 证券从业人员标准遵行业务《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员

范围内的相关规定。

3.2.4 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内,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

管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售适用性管理办法》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 公平交易制度的情况

本基金报告期未发现有异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内,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

司制公平交易原则,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-9.72%,同期

业绩比较基准收益率为-10.86%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本报告期内,本基金尚未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低

于5000万元人民币的情形。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 申购赎回情况

6.1.1 申购情况

6.1.2 赎回情况

6.1.3 其他情况

6.1.4 申购赎回情况总计

6.2 报告期内基金的日常经营情况

6.2.1 报告期内基金的日常经营情况

6.2.2 报告期内基金的日常经营情况

6.2.3 报告期内基金的日常经营情况

6.2.4 报告期内基金的日常经营情况

6.2.5 报告期内基金的日常经营情况

6.2.6 报告期内基金的日常经营情况

6.2.7 报告期内基金的日常经营情况

6.2.8 报告期内基金的日常经营情况

6.2.9 报告期内基金的日常经营情况

6.2.10 报告期内基金的日常经营情况

6.2.11 报告期内基金的日常经营情况

6.2.12 报告期内基金的日常经营情况

6.2.13 报告期内基金的日常经营情况

6.2.14 报告期内基金的日常经营情况

6.2.15 报告期内基金的日常经营情况

6.2.16 报告期内基金的日常经营情况