

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资 基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 21 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 2022 年 1 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信量化沪深 300 增强	
基金主代码	003957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 7 日	
报告期末基金份额总额	165,634,977.17 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。本基金将参考标的指数成分股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。	
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	82,107,054.49 份	83,527,922.68 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（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 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	-123,034.50	-504,693.50
2. 本期利润	-785,429.16	-767,128.98
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.0085
4. 期末基金资产净值	150,804,118.07	151,360,338.10
5. 期末基金份额净值	1.8367	1.8121

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 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	-0.30%	0.75%	1.39%	0.71%	-1.69%	0.04%
过去六个月	-4.78%	1.01%	-4.83%	0.92%	0.05%	0.09%
过去一年	-2.33%	1.16%	-4.51%	1.05%	2.18%	0.11%
自基金转型起至今	73.95%	1.21%	30.92%	1.11%	43.03%	0.10%

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	-0.35%	0.75%	1.39%	0.71%	-1.74%	0.04%

过去六个月	-4.88%	1.01%	-4.83%	0.92%	-0.05%	0.09%
过去一年	-2.53%	1.16%	-4.51%	1.05%	1.98%	0.11%
自基金转型起至今	73.01%	1.21%	30.92%	1.11%	42.09%	0.10%

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

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。

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		
徐黄玮	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2019 年 5 月 7 日	-	14 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总经理。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、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度，制造业和服务业 PMI 数据年底小幅回升，但整体还是具有一定压力。目前上游原材料价格逐步回落，企业出现补库现象，但整体需求端处于回落状态。外需上来看，大部分国家增速都在下滑。疫情上来看，由于新变种，海外再次加剧，国内亦出现多地疫情，对经济有一定扰动。流动性方面，目前经济下行压力加大，政策重心是稳增长，所以在流动性方面具有一定宽松预期。

市场方面，四季度以地产产业链、元宇宙等低估值的行业表现较好。成长类赛道股表现比较一般，市场认为景气有所回落。

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、分析师预期，技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素构建我们预计相对基准有稳定超额收益的投资组合，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的，并积极把握指数分红、指数成分调整、新股、科创板新股、个股事件驱动等确定性增强机会，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。

4.5 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 1.8367 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.30%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.8121 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.35%，同期业绩比较基准收益率为 1.39%。

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	282,325,875.23	92.02
	其中：股票	282,325,875.23	92.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,539,211.99	5.06
	其中：债券	15,539,211.99	5.06
	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	7,815,884.64	2.55
8	其他资产	1,140,771.90	0.37
9	合计	306,821,743.76	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	1,661,588.00	0.55
B	采矿业	4,530,037.20	1.50
C	制造业	162,778,804.34	53.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,706,166.00	1.56
E	建筑业	4,058,742.00	1.34
F	批发和零售业	2,305,497.40	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,169,934.00	2.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,313,855.27	2.75
J	金融业	41,520,518.01	13.74
K	房地产业	5,654,289.00	1.87
L	租赁和商务服务业	2,838,964.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	5,920,151.80	1.96
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	1,642,530.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	617,976.00	0.20

S	综合	-	-
	合计	253,719,053.02	83.97

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	524,489.00	0.17
B	采矿业	321,851.00	0.11
C	制造业	21,454,316.75	7.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,573.00	0.03
E	建筑业	1,040,256.22	0.34
F	批发和零售业	753,011.35	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,116,452.78	0.37
H	住宿和餐饮业	17,580.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	580,455.80	0.19
J	金融业	1,587,046.00	0.53
K	房地产业	294,069.00	0.10
L	租赁和商务服务业	289,175.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	322,120.91	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	38,660.03	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	169,603.59	0.06
S	综合	-	-
	合计	28,606,822.21	9.47

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	600519	贵州茅台	6,325	12,966,250.00	4.29
2	300750	宁德时代	14,900	8,761,200.00	2.90
3	000858	五粮液	26,900	5,989,554.00	1.98
4	600036	招商银行	106,200	5,173,002.00	1.71
5	601318	中国平安	101,300	5,106,533.00	1.69
6	601012	隆基股份	56,576	4,876,851.20	1.61

7	600690	海尔智家	126,200	3,772,118.00	1.25
8	300059	东方财富	99,279	3,684,243.69	1.22
9	600887	伊利股份	87,699	3,636,000.54	1.20
10	000333	美的集团	44,850	3,310,378.50	1.10

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	603915	国茂股份	36,100	1,404,290.00	0.46
2	300294	博雅生物	36,000	1,380,600.00	0.46
3	600521	华海药业	59,100	1,280,106.00	0.42
4	600705	中航产融	217,000	861,490.00	0.29
5	600862	中航高科	19,300	690,168.00	0.23

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	15,202,085.00	5.03
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）	337,126.99	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,539,211.99	5.14

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	019654	21 国债 06	100,000	10,003,000.00	3.31
2	019649	21 国债 01	40,500	4,050,810.00	1.34
3	019658	21 国债 10	11,500	1,148,275.00	0.38
4	113052	兴业转债	3,040	303,996.04	0.10
5	113049	长汽转债	210	32,148.90	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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
股指期货投资本期收益 (元)					277,926.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-119,226.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，以控制并调整投资组合风险、提高投资的资金效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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。

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东方财富（股票代码：300059 SZ）、招商银行（股票代码：600036 SH）、中国平安（股票代码：601318 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。

2021 年 7 月 19 日，东方财富信息股份有限公司因未依法履行职责被工信部通报批评，通知整改。

2021 年 5 月 10 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室通知整改。

2021 年 5 月 21 日，招商银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款 7,170.00 万元【银保监罚决字（2021）16 号】。

2021 年 2 月 23 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因未依法履行职责被广东省通信管理局通知整改。

2021 年 7 月 5 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因违规经营被银保监会人身保险监管部通知整改，通报批评【人身险部函（2021）305 号】。

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（元）
1	存出保证金	120,241.32
2	应收证券清算款	637,174.18
3	应收股利	-
4	应收利息	270,455.48
5	应收申购款	112,900.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,140,771.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113049	长汽转债	32,148.90	0.01
2	127038	国微转债	982.05	0.00

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

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	75,358,442.24	95,099,650.51
报告期期间基金总申购份额	15,828,374.79	15,213,526.18
减：报告期期间基金总赎回份额	9,079,762.54	26,785,254.01
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	82,107,054.49	83,527,922.68

§ 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

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

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 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

2022 年 1 月 21 日