

安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：2024 年 1 月 19 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 2024 年 1 月 18 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信量化优选股票
基金主代码	006346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 3 日
报告期末基金份额总额	26,202,510.02 份
投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。资产配置方面，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%

风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。	
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	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	006346	006347
报告期末下属分级基金的份额总额	16,150,031.20 份	10,052,478.82 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
1. 本期已实现收益	147,307.39	63,707.04
2. 本期利润	-271,580.36	11,457.76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0165	0.0011
4. 期末基金资产净值	28,082,159.46	17,134,555.94
5. 期末基金份额净值	1.7388	1.7045

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

安信量化优选股票 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	-1.27%	0.70%	-3.70%	0.73%	2.43%	-0.03%
过去六个月	-5.86%	0.75%	-7.80%	0.73%	1.94%	0.02%

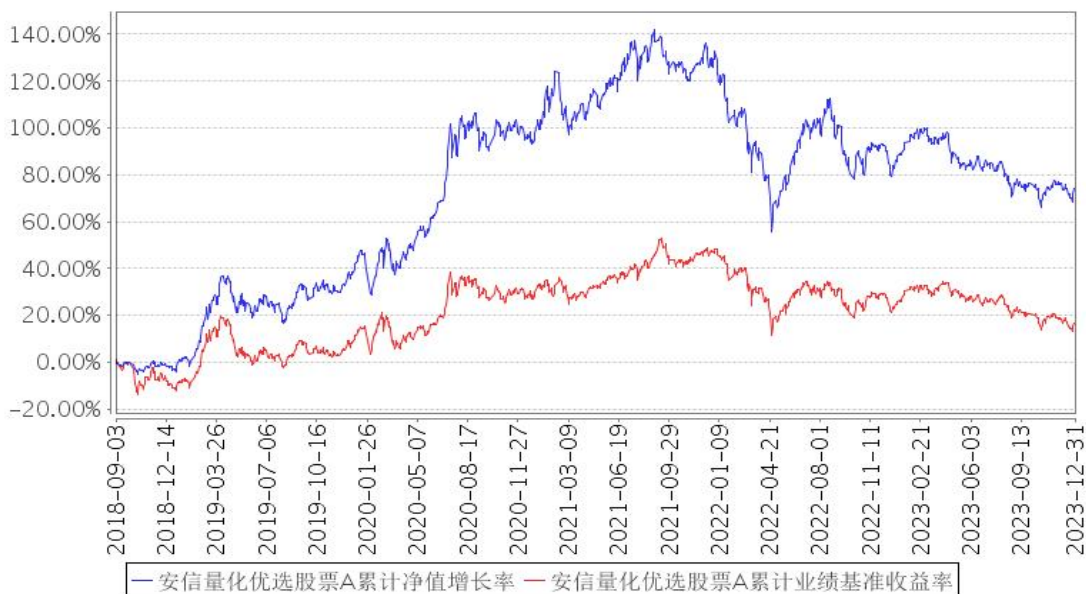
过去一年	-5.08%	0.74%	-5.58%	0.70%	0.50%	0.04%
过去三年	-12.15%	1.13%	-10.44%	0.92%	-1.71%	0.21%
过去五年	79.72%	1.24%	30.84%	1.09%	48.88%	0.15%
自基金合同生效起至今	73.88%	1.21%	16.39%	1.12%	57.49%	0.09%

安信量化优选股票 C

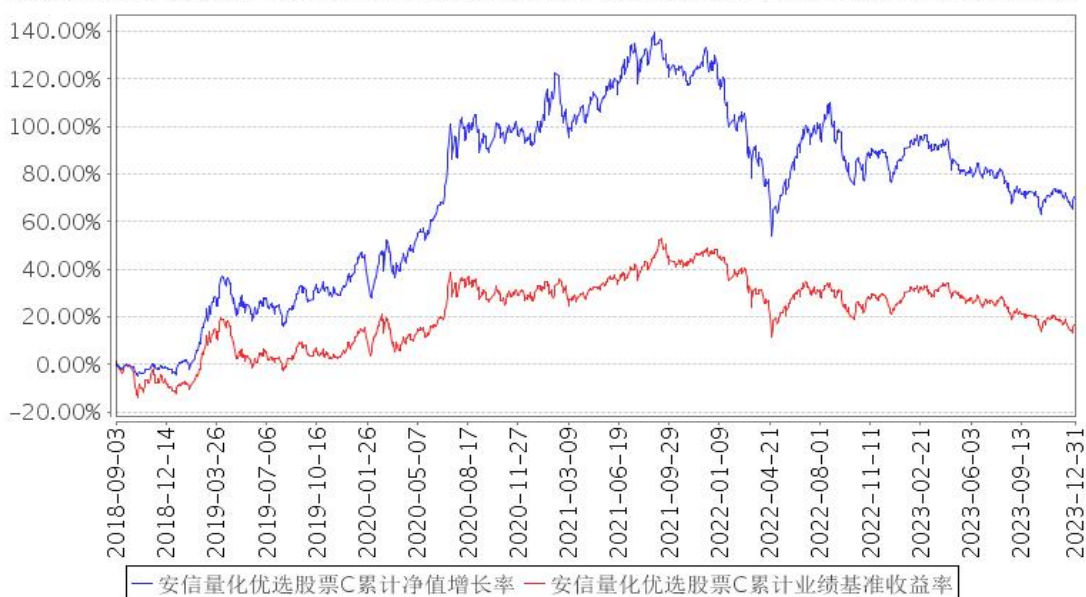
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.37%	0.70%	-3.70%	0.73%	2.33%	-0.03%
过去六个月	-6.05%	0.75%	-7.80%	0.73%	1.75%	0.02%
过去一年	-5.46%	0.74%	-5.58%	0.70%	0.12%	0.04%
过去三年	-13.20%	1.13%	-10.44%	0.92%	-2.76%	0.21%
过去五年	76.41%	1.24%	30.84%	1.09%	45.57%	0.15%
自基金合同生效起至今	70.45%	1.21%	16.39%	1.12%	54.06%	0.09%

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

安信量化优选股票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



安信量化优选股票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 2018 年 9 月 3 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		
朱舟扬	本基金的基金经理	2023 年 8 月 24 日	-	5 年	朱舟扬先生，哲学博士，曾任安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证 500 指数增强型证券投资基金、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。

4.1.1 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

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运作分析

在 2023 年第四季度，我国经济仍然处于弱复苏的状态，处于向潜在增速中枢回归的过程，工业稳增长政策陆续下达，供给端修复超预期且显著快于需求端。消费需求在复苏，但不及市场预期，四季度物价有一定回落，对于名义社零有影响。海外资产近期的价格变化显示投资者们预期美联储 2024 年将停止加息并开始降息，但北上资金于四季度依然处于净流出状态，相较于三季度有所缓和，对 A 股估值有一定的压制作用。我们认为，国家对“高质量发展”依然非常重视，将是后续经济增长的重点。

就市场而言，第四季度股市指数呈现震荡态势，期间经历两波下跌和两波上涨，小盘股相比大盘股在四季度表现优异。低波动类、红利类及高质量类风格有较好表现。

本基金作为量化股票型基金，坚持宽基选股，淡化择时，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、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 and 合理估值的证券作为主要的投资标的。并根据开发的多指标体系灵活配置不同风格的量化选股策略。在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，力争实现基金财产的长期稳健增值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信量化优选股票 A 基金份额净值为 1.7388 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.27%；安信量化优选股票 C 基金份额净值为 1.7045 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.37%；同期业绩比较基准收益率为-3.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2023 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日。

§ 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	42,360,654.46	93.17
	其中：股票	42,360,654.46	93.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,381,366.39	5.24
	其中：债券	2,381,366.39	5.24
	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	711,372.09	1.56
8	其他资产	11,383.91	0.03
9	合计	45,464,776.85	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	163,804.00	0.36
B	采矿业	1,518,283.00	3.36
C	制造业	29,017,429.42	64.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,338,291.00	2.96
E	建筑业	661,551.00	1.46
F	批发和零售业	2,124,535.60	4.70
G	交通运输、仓储和邮政业	1,090,322.00	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,077,708.94	4.60
J	金融业	1,801,814.00	3.98
K	房地产业	608,784.00	1.35
L	租赁和商务服务业	298,830.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	558,895.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	890,835.50	1.97
O	居民服务、修理和其他服务业	85,559.00	0.19
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	84,096.00	0.19
S	综合	39,916.00	0.09
	合计	42,360,654.46	93.68

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 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	600153	建发股份	71,200	685,656.00	1.52
2	603758	秦安股份	56,100	641,784.00	1.42
3	600863	内蒙华电	139,200	542,880.00	1.20
4	002422	科伦药业	18,100	525,805.00	1.16
5	301200	大族数控	13,900	525,003.00	1.16
6	600737	中粮糖业	61,100	503,464.00	1.11
7	002032	苏泊尔	9,400	498,294.00	1.10
8	300533	冰川网络	16,300	451,510.00	1.00
9	002757	南兴股份	26,400	412,896.00	0.91
10	002384	东山精密	20,800	378,144.00	0.84

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	2,379,966.30	5.26
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）	1,400.09	0.00

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,381,366.39	5.27

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	019670	22 国债 05	8,000	815,132.05	1.80
2	019709	23 国债 16	8,000	804,186.30	1.78
3	019703	23 国债 10	7,500	760,647.95	1.68
4	127100	神码转债	14	1,400.09	0.00

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金将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内蒙华电（代码：600863 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。

1. 内蒙古蒙电华能热电股份有限公司

2023 年 11 月 9 日，内蒙古蒙电华能热电股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会内蒙古监管局责令改正。

2023 年 12 月 22 日，内蒙古蒙电华能热电股份有限公司因未及时披露公司重大事件被上海证券交易所通报批评。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	10,580.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	803.61
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,383.91

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

项目	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
报告期期初基金份额总额	15,768,707.62	8,655,389.93
报告期期间基金总申购份额	1,854,065.99	4,798,405.23
减:报告期期间基金总赎回份额	1,472,742.41	3,401,316.34
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	16,150,031.20	10,052,478.82

§ 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

§ 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

无。

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、中国证监会准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化优选股票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

2024 年 1 月 19 日