

浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

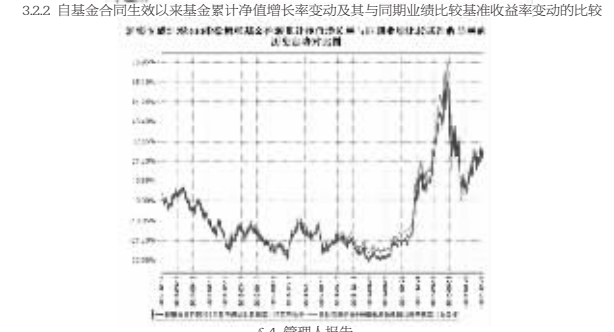
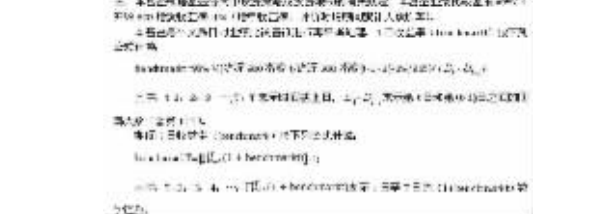
§1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	浦银安盛沪深300指数增强
基金代码	519116
交易代码	519116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月10日
报告期末基金份额总额	68,467,341.63份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上,通过主动选股和仓位控制,力争获得超越基准的长期收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金,属于相对收益型产品,投资策略为:在追求跟踪误差最小化的基础上,通过主动选股和仓位控制,力争获得超越基准的长期收益,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+1%指数收益率,评价期限按照合同约定计算。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,属于相对收益型产品,投资策略为:在追求跟踪误差最小化的基础上,通过主动选股和仓位控制,力争获得超越基准的长期收益,谋求基金资产的长期增值。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%



§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§5 投资组合报告

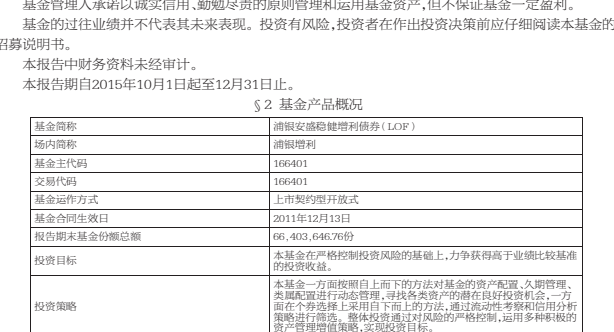
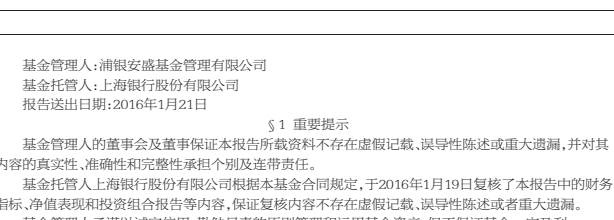
5.1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业名称
1	医药生物
2	信息技术
3	金融地产
4	工业制造
5	其他行业

5.3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%



§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业名称
1	医药生物
2	信息技术
3	金融地产
4	工业制造
5	其他行业

5.3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%

§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业名称
1	医药生物
2	信息技术
3	金融地产
4	工业制造
5	其他行业

5.3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%

§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业名称
1	医药生物
2	信息技术
3	金融地产
4	工业制造
5	其他行业

5.3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%

§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业名称
1	医药生物
2	信息技术
3	金融地产
4	工业制造
5	其他行业

5.3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-559,420.73
2.加权平均基金份额本期利润	13.663,410.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1005
4.期末基金资产净值	84,876,632.35
5.期末基金份额净值	1.246

注:1、上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可能低于所列数字。
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。
3、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 自基金合同生效以来基金累计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
过去三个月	17.65%

§4 管理人报告	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 管理人对于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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未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
本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。
在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理流程和风险控制制度,保证公平基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易所执行的流程,对于不同时间窗口(同日、3日、5日和10日)发生的不同组合间同一股票的同向交易及反向交易进行分析,并进行了统计显著性的检验,以确定交易价差对相关组合的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资组合股票收益差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。
4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现本基金存在违反法律法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中所认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情形。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,GDP增速下降至7%以下,各项宏观经济指标都在低位运行,受益于政策刺激下的汽车、房地产等领域的回暖,企业盈利出现小幅改善,股票市场趋于平稳,投资市场风险偏好上升,融资余额显著回升,中小盘股大幅反弹。从量化的角度来看,量宽因子和盈利因子表现较好。
本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,根据市场投资风格变化适时调整组合中的行业配置比例,组合表现优于同期业绩比较基准。
4.5 报告期内基金投资组合资产配置情况
本报告期内,本基金净值增长率为17.65%,同期业绩比较基准收益率为15.94%。
4.6 报告期内基金持有人收益情况、净值持续增长说明
1.本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
§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
1	权益投资
2	固定收益投资
3	买入返售金融资产
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产

</