

# 安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	17
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况 .....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
8.6 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 .....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	66
8.8 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贵金属投资明细 .....	66
8.9 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 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	71
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
12.1 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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	安信中证 500 指数增强	
基金主代码	005965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 29 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,589,666.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005965	005966
报告期末下属分级基金的份额总额	6,541,749.58 份	15,047,916.65 份

### 2.2 基金产品说明

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	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。指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。量化增强策略主要采用超额收益模型、风险模型和成本模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。在股指期货投资方面，将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。在债券投资方面，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，进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。此外，本基金还将采用资产配置策略、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	95% × 中证 500 指数收益率 +5% × 银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标

	的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 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。
--	--

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名 孙晓奇	朱广科
	联系电话 0755-82509999	0574-87050338
	电子邮箱 service@essencefund.com	custody-audit@nbcb.cn
客户服务电话	4008-088-088	0574-83895886
传真	0755-82799292	0574-89103213
注册地址	深圳市福田区福田街道福安社区 福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区 福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码	518026	315100
法定代表人	刘入领	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊 普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安 永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	安信中证	安信中证	安信中证	安信中证	安信中证	安信中证

	500 指数增 强 A	500 指数增 强 C	500 指数增 强 A	500 指数增 强 C	500 指数增 强 A	500 指数增 强 C
本期已实现 收益	436,992.82	1,431,080. 18	-146,745.9 0	-462,382.0 3	-3,369,851 .59	-5,638,700 .05
本期利润	507,085.76	1,433,335. 25	-55,400.98	-263,353.7 2	-3,260,008 .89	-7,841,321 .67
加权平均基 金份额本期 利润	0.0715	0.0980	-0.0080	-0.0221	-0.3488	-0.5805
本期加权平 均净值利润 率	4.23%	5.91%	-0.45%	-1.27%	-19.00%	-31.43%
本期基金份 额净值增长 率	3.81%	3.40%	-0.37%	-0.76%	-17.56%	-17.89%
3.1.2 期末 数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分 配利润	3,495,286. 21	7,410,915. 76	3,544,138. 78	5,738,385. 33	3,287,499. 39	4,356,448. 45
期末可供分 配基金份额 利润	0.5343	0.4925	0.4715	0.4378	0.4884	0.4612
期末基金资 产净值	11,577,181 .73	25,990,881 .75	12,814,342 .30	21,891,566 .95	11,517,156 .66	15,899,669 .83
期末基金份 额净值	1.7697	1.7272	1.7047	1.6704	1.7110	1.6832
3.1.3 累计 期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累 计净值增长 率	76.97%	72.72%	70.47%	67.04%	71.10%	68.32%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

安信中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-2.59%	1.74%	-0.23%	1.93%	-2.36%	-0.19%
过去六个月	9.23%	1.65%	15.13%	1.91%	-5.90%	-0.26%
过去一年	3.81%	1.46%	5.40%	1.73%	-1.59%	-0.27%
过去三年	-14.73%	1.17%	-20.91%	1.33%	6.18%	-0.16%
过去五年	35.36%	1.24%	8.93%	1.31%	26.43%	-0.07%
自基金合同生效起至今	76.97%	1.24%	28.28%	1.32%	48.69%	-0.08%

安信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-2.68%	1.74%	-0.23%	1.93%	-2.45%	-0.19%
过去六个月	9.01%	1.65%	15.13%	1.91%	-6.12%	-0.26%
过去一年	3.40%	1.46%	5.40%	1.73%	-2.00%	-0.27%
过去三年	-15.74%	1.17%	-20.91%	1.33%	5.17%	-0.16%
过去五年	32.69%	1.24%	8.93%	1.31%	23.76%	-0.07%
自基金合同生效起至今	72.72%	1.24%	28.28%	1.32%	44.44%	-0.08%

注：根据《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准收益率=95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。本基金为指数增强型基金，标的指数为中证 500 指数，因此业绩比较基准以中证 500 指数收益率为主要组成部分。

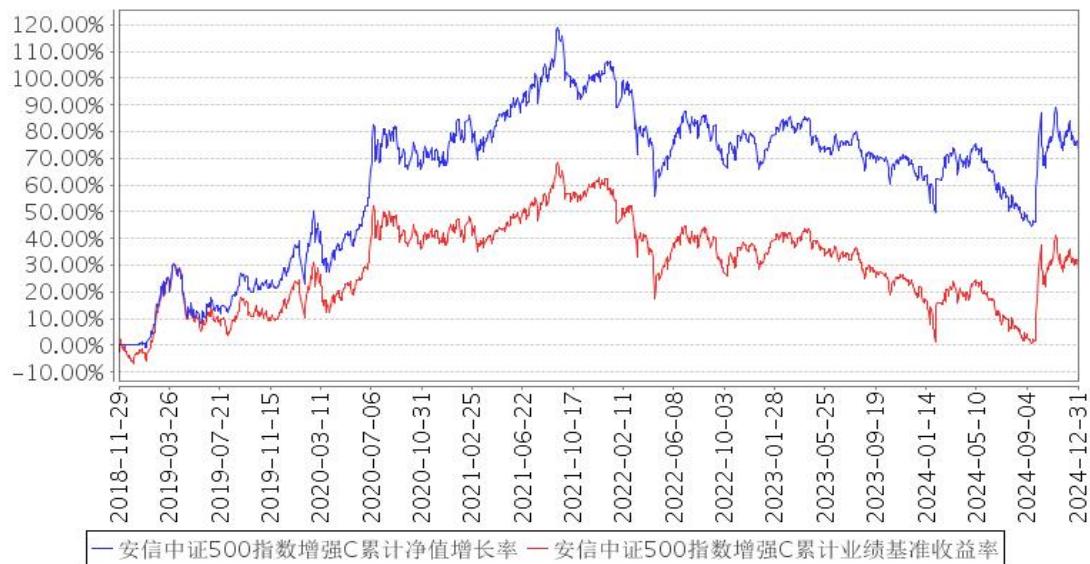
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

安信中证500指数增强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



安信中证500指数增强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

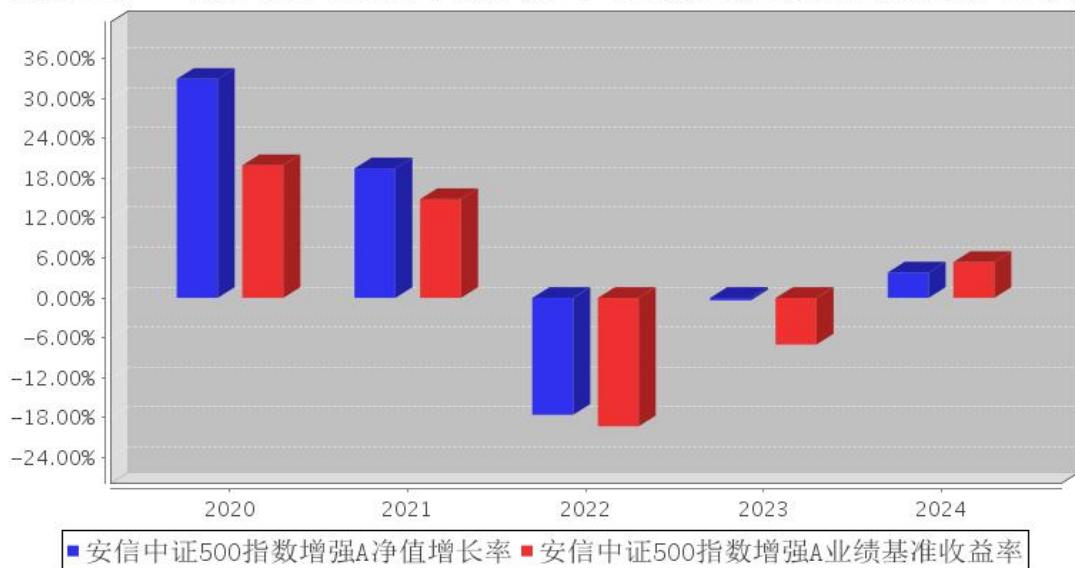


注：1、本基金基金合同生效日为2018年11月29日。

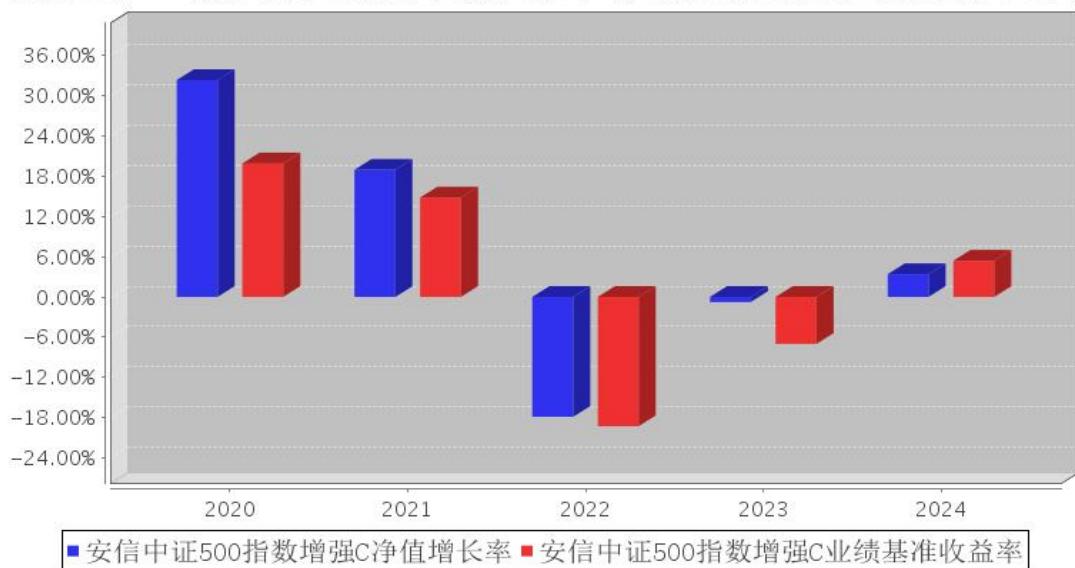
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，国投证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 95 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势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、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、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）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合

型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金、安信远见稳进一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金、安信医药创新股票型发起式证券投资基金、安信周期优选股票型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱舟	本基金的	2021 年	-	7 年	朱舟扬先生，哲学博士，曾任安信基金管

扬	基金经理	12 月 31 日			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、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
---	------	-----------	--	--	---

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写。“离职日期”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。

#### 4.1.3 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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.3 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。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，外部美国开始进入降息周期，虽然联邦基金利率依然在较高水平，但流动性逐渐趋松，对权益资产的估值产生一定的促进作用。中国经济呈现出较为稳健的态势，一系列促进经济及资本市场发展的政策出台，投资者信心得到有效修复。经济运行维持在温和复苏的轨道上，物价水平总体保持稳定。

权益市场在这 2024 年经历了剧烈的波动。一季度，股市迎来了近年来罕见的深 V 型反弹。春节前，受多重因素影响，股市整体出现了较大的下跌，从风格角度分析，小盘股的跌幅远远超过了大盘股，红利型股票的表现相对较好。春节过后，股市触底并迅速反弹，小盘股的表现尤为突出。在 9 月末，央行、金融监管总局、证监会联合发声，创设新的货币政策工具，支持股票市场稳定发展，逆转资本市场的悲观情绪。9.26 政治局会议提出多项政策，再次提振市场情绪。自 9.24 起权益市场大幅上涨。市场风格也在此期间发生轮动，9.24 前价值相对占优，红利低波策略表现较为突出。9.24 后则成长风格占优，创业板指，科创指数等表现优异。

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，通过数量化模型进行投资组合优化。主要是运用量化多策略框架，并根据开发的多指标体系灵活配置量化子策略，构建相对基准有稳定超额收益的投资组合，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的，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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.7697 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.81%；安信中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.7272 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.40%；同期业绩比较基准收益率为 5.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

至 2024 年末时，有利于资本市场的很多政策已经在逐步落实。根据历史经验，往往从政策落地到经济数据所有反应，再到最终传导至资本市场，这个过程需要一定的时间。预计这一系列传导事件将在 2025 年逐步发生。这些关键事件不仅对市场行情将产生重大影响，对于市场的风格切换也将产生重大冲击，并在期间伴随着一定的反复，但最终的方向是确定的。

2024 年价值风格逐步切换至成长风格，预计 2025 年全年也以成长风格占优为主，但其中有部分时间将会发生风格的短期反转。鉴于目前权益资产的估值都处于历史较低位置，同时国债收

益率处在降低位置，权益资产具有较高投资性价比，预计 2025 年权益市场表现不错。

在 2025 年本基金将继续秉持安信基金“帮助客户实现其财富梦想”的使命，恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报，用持续稳健的投资业绩，来回报持有人的信任。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 2024 年 1 月 2 日至 2024 年 12 月 31 日。

自 2023 年 7 月 6 日至本报告期末，本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在安信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

	<p>我们认为，后附的安信中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>安信中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适</p>

	<p>当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 邓雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2025 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,203,477.99	2,073,664.30
结算备付金		516,577.96	542.11
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	34,936,444.09	32,950,812.55
其中：股票投资		34,905,472.52	32,950,812.55
基金投资		-	-
债券投资		30,971.57	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	7. 4. 7. 4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		12, 496. 22	16, 070. 51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7. 4. 7. 5	-	-
资产总计		37, 668, 996. 26	35, 041, 089. 47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5, 102. 26	118, 327. 60
应付管理人报酬		26, 298. 89	23, 871. 46
应付托管费		3, 287. 35	2, 983. 93
应付销售服务费		9, 106. 94	7, 574. 38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0. 35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7. 4. 7. 6	57, 136. 99	182, 422. 85
负债合计		100, 932. 78	335, 180. 22
<b>净资产:</b>			
实收基金	7. 4. 7. 7	21, 589, 666. 23	20, 622, 982. 26
未分配利润	7. 4. 7. 8	15, 978, 397. 25	14, 082, 926. 99
净资产合计		37, 568, 063. 48	34, 705, 909. 25
负债和净资产总计		37, 668, 996. 26	35, 041, 089. 47

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 21, 589, 666. 23 份，其中安信中证 500 指数增强 A 基金份额总额为 6, 541, 749. 58 份，基金份额净值 1. 7697 元；安信中证 500 指数增强 C 基金份额总额为 15, 047, 916. 65 份，基金份额净值 1. 7272 元。

## 7.2 利润表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业收入</b>		2,495,083.78	319,547.50
1. 利息收入		20,225.14	18,268.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	20,225.14	18,268.33
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,370,008.65	-108,493.95
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,750,028.43	-584,260.66
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.11	2,756.63	34,759.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	—	—
贵金属投资收益	7.4.7.13	—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	-27,847.05	—
股利收益	7.4.7.15	645,070.64	441,007.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	72,348.01	290,373.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	32,501.98	119,399.89
<b>减：二、营业总支出</b>		554,662.77	638,302.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	290,958.22	262,631.82
2. 托管费	7.4.10.2.2	36,369.67	32,829.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	97,404.06	82,440.80
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	7.4.7.18	—	—
7. 税金及附加		95.56	0.58
8. 其他费用	7.4.7.19	129,835.26	260,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额）</b>		1,940,421.01	-318,754.70

以“-”号填列)			
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,940,421.01	-318,754.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,940,421.01	-318,754.70

### 7.3 净资产变动表

会计主体: 安信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	20,622,982.26	-	14,082,926.99	34,705,909.25
二、本期期初净资产	20,622,982.26	-	14,082,926.99	34,705,909.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	966,683.97	-	1,895,470.26	2,862,154.23
(一)、综合收益总额	-	-	1,940,421.01	1,940,421.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	966,683.97	-	-44,950.75	921,733.22
其中: 1. 基金申购款	23,451,175.37	-	16,511,607.06	39,962,782.43
2. 基金赎回款	-22,484,491.40	-	-16,556,557.81	-39,041,049.21
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	21,589,666.23	-	15,978,397.25	37,568,063.48
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	16,177,474.15	-	11,239,352.34	27,416,826.49
二、本期期初净资产	16,177,474.15	-	11,239,352.34	27,416,826.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,445,508.11	-	2,843,574.65	7,289,082.76
(一)、综合收益总额	-	-	-318,754.70	-318,754.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	4,445,508.11	-	3,162,329.35	7,607,837.46
其中：1. 基金申购款	22,178,535.68	-	16,457,848.23	38,636,383.91
2. 基金赎回款	-17,733,027.57	-	-13,295,518.88	-31,028,546.45
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	20,622,982.26	-	14,082,926.99	34,705,909.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领

廖维坤

苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2018 年 3 月 16 日下发的证监许可[2018]490 号文“关于准予安信中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复”的核准,由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金募集期间为 2018 年 9 月 14 日至 2018 年 11 月 27

日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字 60962175\_H14 号验资报告，经向中国证监会备案，《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 29 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 247,748,039.51 份，其中认购资金利息折合 9,517.36 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及《安信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，安信中证 500 指数增强型证券投资基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例占基金资产的 80%-95%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率  $\times$  95%+银行活期存款利率（税后） $\times$  5%。

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资

基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其

继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

- (3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- (4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认

金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### (1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### (2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### （4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	296,406.35	131,096.56
等于： 本金	296,352.01	131,059.45
加： 应计利息	54.34	37.11
减： 坏账准备	—	—
定期存款	—	—
等于： 本金	—	—
加： 应计利息	—	—
减： 坏账准备	—	—
其中： 存款期限 1 个月以内	—	—
存款期限 1-3 个月	—	—
存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	1,907,071.64	1,942,567.74
等于： 本金	1,906,803.64	1,942,195.81
加： 应计利息	268.00	371.93
减： 坏账准备	—	—
合计	2,203,477.99	2,073,664.30

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,110,442.61	—	34,905,472.52	-204,970.09
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	27,999.82	11.97	30,971.57
	银行间市场	—	—	—
	合计	27,999.82	11.97	30,971.57
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	35,138,442.43	11.97	34,936,444.09	-202,010.31
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	33,225,170.87	-	32,950,812.55	-274,358.32
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	33,225,170.87	-	32,950,812.55	-274,358.32

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.01	59.44
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	27,301.72	72,363.41
其中：交易所市场	27,301.72	72,363.41
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	24,863.02	50,000.00
应付指数使用费	-	50,000.00
应付审计费	4,972.24	10,000.00
合计	57,136.99	182,422.85

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信中证 500 指数增强 A

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,517,092.35	7,517,092.35
本期申购	3,188,453.04	3,188,453.04
本期赎回(以“-”号填列)	-4,163,795.81	-4,163,795.81
本期末	6,541,749.58	6,541,749.58

## 安信中证 500 指数增强 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,105,889.91	13,105,889.91
本期申购	20,262,722.33	20,262,722.33
本期赎回(以“-”号填列)	-18,320,695.59	-18,320,695.59
本期末	15,047,916.65	15,047,916.65

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

## 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

## 安信中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,544,138.78	1,753,111.17	5,297,249.95
本期期初	3,544,138.78	1,753,111.17	5,297,249.95
本期利润	436,992.82	70,092.94	507,085.76
本期基金份额交易产生的变动数	-485,845.39	-283,058.17	-768,903.56
其中：基金申购款	1,435,810.37	902,365.34	2,338,175.71
基金赎回款	-1,921,655.76	-1,185,423.51	-3,107,079.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,495,286.21	1,540,145.94	5,035,432.15

## 安信中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,738,385.33	3,047,291.71	8,785,677.04
本期期初	5,738,385.33	3,047,291.71	8,785,677.04
本期利润	1,431,080.18	2,255.07	1,433,335.25
本期基金份额交易产生的变动数	241,450.25	482,502.56	723,952.81
其中：基金申购款	8,195,148.68	5,978,282.67	14,173,431.35
基金赎回款	-7,953,698.43	-5,495,780.11	-13,449,478.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,410,915.76	3,532,049.34	10,942,965.10

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,215.89	2,721.15
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	14,922.08	15,537.41
结算备付金利息收入	3,087.17	9.77
其他	-	-
合计	20,225.14	18,268.33

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	276,539,235.48	270,006,035.08
减：卖出股票成本总额	274,335,473.48	269,992,068.16
减：交易费用	453,733.57	598,227.58
买卖股票差价收入	1,750,028.43	-584,260.66

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	14.46	238.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,742.17	34,520.87
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申	-	-

购差价收入		
合计	2,756.63	34,759.32

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	14,746.07	1,608,156.79
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	11,999.93	1,569,940.57
减: 应计利息总额	3.38	2,601.81
减: 交易费用	0.59	1,093.54
买卖债券差价收入	2,742.17	34,520.87

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	-27,847.05	-

#### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	645,070.64	441,007.39
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	645,070.64	441,007.39

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	72,348.01	290,373.23
股票投资	69,388.23	270,425.84
债券投资	2,959.78	19,947.39
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减: 应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	—	—
合计	72,348.01	290,373.23

#### 7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	22,140.01	114,687.59
基金转换费收入	10,361.97	4,712.30
合计	32,501.98	119,399.89

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	4,972.24	10,000.00
信息披露费	24,863.02	50,000.00
证券出借违约金	—	—
指数使用费	100,000.00	200,000.00
其他	—	400.00
合计	129,835.26	260,400.00

注: 本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分审计费、信息披露费、指数使用费。

### 7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国投证券	552,754,500.70	100.00	196,318,188.13	35.83

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)	
国投证券	280,009.01	100.00	27,301.72	100.00
关联方名称	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年12月31日			
当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)	
国投证券	141,601.49	43.19	72,363.41	100.00

注: (1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方协商约定, 并扣除由交易所或登记结算公司收取的相关费用后的净额列示。

(2) 被动股票型基金佣金协议的服务范围仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务, 其他类型基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的研究服务及证券交易服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	290,958.22	262,631.82
其中: 应支付销售机构的客户维护费	62,508.77	48,591.97
应支付基金管理人的净管理费	228,449.45	214,039.85

注: 基金管理费每日计提, 按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	36,369.67	32,829.00

注: 基金托管费每日计提, 按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

$H$  为每日应计提的基金托管费

$E$  为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	合计
安信基金	-	59,591.18	59,591.18
国投证券	-	7,390.05	7,390.05
宁波银行	-	805.04	805.04
合计	-	67,786.27	67,786.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	合计
安信基金	-	52,547.63	52,547.63
国投证券	-	6,994.46	6,994.46
宁波银行	-	749.33	749.33
合计	-	60,291.42	60,291.42

注: 基金销售服务费每日计提, 按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

$H$  为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

$E$  为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 29 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期内申购/买入总份额	—	8,922,917.51
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份 额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	8,922,917.51
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	41.33%
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 29 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 安信中证 500 指数增强 C

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例(%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	-	-	8,861,394.07	42.97

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国投证券	1,906,768.12	14,869.04	1,902,791.31	5,166.70
宁波银行	296,406.35	2,215.89	131,096.56	2,721.15

注：本基金的活期银行存款由基金托管人宁波银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将

相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08%（2023 年 12 月 31 日：无）。

##### 7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	30,971.57	-
未评级	-	-
合计	30,971.57	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	2,203,477.99	-	-	-	2,203,477.99
结算备付金	516,577.96	-	-	-	516,577.96
交易性金融资产	-	-	30,971.57	34,905,472.52	34,936,444.09
应收申购款	-	-	-	12,496.22	12,496.22
资产总计	2,720,055.95	-	30,971.57	34,917,968.74	37,668,996.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,102.26	5,102.26
应付管理人报酬	-	-	-	26,298.89	26,298.89
应付托管费	-	-	-	3,287.35	3,287.35
应付销售服务费	-	-	-	9,106.94	9,106.94
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	57,136.99	57,136.99
负债总计	-	-	-	100,932.78	100,932.78
利率敏感度缺口	2,720,055.95	-	30,971.57	34,817,035.96	37,568,063.48
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,073,664.30	-	-	-	2,073,664.30
结算备付金	542.11	-	-	-	542.11
交易性金融资产	-	-	-	32,950,812.55	32,950,812.55
应收申购款	-	-	-	16,070.51	16,070.51
资产总计	2,074,206.41	-	-	32,966,883.06	35,041,089.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	118,327.60	118,327.60
应付管理人报酬	-	-	-	23,871.46	23,871.46
应付托管费	-	-	-	2,983.93	2,983.93
应付销售服务费	-	-	-	7,574.38	7,574.38
其他负债	-	-	-	182,422.85	182,422.85
负债总计	-	-	-	335,180.22	335,180.22
利率敏感度缺口	2,074,206.41	-	-	32,631,702.84	34,705,909.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	447.16	-

	2. 市场利率上升 25 个基点	-439.75	-
--	---------------------	---------	---

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例占基金资产的 80%-95%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	34,905,472.52	92.91	32,950,812.55	94.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	34,905,472.52	92.91	32,950,812.55	94.94

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2024 年 12 月 31 日)
1. 沪深 300 指数上升 5%	1,752,052.41	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
		1,250,239.81
2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,752,052.41	-1,250,239.81

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	34,936,444.09	32,950,812.55
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	34,936,444.09	32,950,812.55

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。对于公开市场交易的证券等投资,若出现交易不活跃、非公开发行等情况,本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的对

公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	34,905,472.52	92.66
	其中：股票	34,905,472.52	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,971.57	0.08
	其中：债券	30,971.57	0.08
	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	2,720,055.95	7.22
8	其他各项资产	12,496.22	0.03
9	合计	37,668,996.26	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	98,358.00	0.26
B	采矿业	1,635,785.00	4.35
C	制造业	17,763,633.52	47.28

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,391,928.00	3.71
E	建筑业	229,490.00	0.61
F	批发和零售业	600,842.00	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	633,809.00	1.69
H	住宿和餐饮业	167,940.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,655,129.00	7.07
J	金融业	2,581,823.00	6.87
K	房地产业	362,156.00	0.96
L	租赁和商务服务业	155,111.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	96,889.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	229,674.00	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,740.00	0.10
Q	卫生和社会工作	81,595.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	429,518.00	1.14
S	综合	31,612.00	0.08
	合计	29,183,032.52	77.68

### 8.2.2 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	30,752.00	0.08
B	采矿业	290,400.00	0.77
C	制造业	4,470,891.00	11.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,335.00	0.29
E	建筑业	38,400.00	0.10
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	131,871.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,704.00	0.25
J	金融业	410,595.00	1.09
K	房地产业	15,246.00	0.04
L	租赁和商务服务业	52,624.00	0.14

M	科学研究和技术服务业	44,032.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	15,040.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	18,550.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	5,722,440.00	15.23

### 8.2.3 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300207	欣旺达	19,700	439,507.00	1.17
2	002517	恺英网络	29,900	406,939.00	1.08
3	002078	太阳纸业	26,800	398,516.00	1.06
4	002273	水晶光电	17,500	388,850.00	1.04
5	601168	西部矿业	23,400	376,038.00	1.00
6	601128	常熟银行	49,300	373,201.00	0.99
7	688617	惠泰医疗	1,000	372,330.00	0.99
8	002138	顺络电子	11,500	362,020.00	0.96
9	000423	东阿阿胶	5,500	344,960.00	0.92
10	300002	神州泰岳	29,000	336,110.00	0.89
11	002966	苏州银行	39,000	316,290.00	0.84
12	002128	电投能源	16,100	315,238.00	0.84
13	688099	晶晨股份	4,500	309,060.00	0.82
14	600873	梅花生物	30,600	306,918.00	0.82
15	002595	豪迈科技	5,700	286,083.00	0.76
16	000400	许继电气	10,000	275,300.00	0.73
17	002008	大族激光	10,900	272,500.00	0.73
18	300724	捷佳伟创	4,300	271,803.00	0.72
19	601577	长沙银行	30,500	271,145.00	0.72
20	002984	森麒麟	10,500	258,930.00	0.69
21	600529	山东药玻	9,300	239,661.00	0.64
22	601567	三星医疗	7,700	236,852.00	0.63
23	002444	巨星科技	7,100	229,685.00	0.61

24	000513	丽珠集团	5,800	220,400.00	0.59
25	600642	申能股份	23,200	220,168.00	0.59
26	601717	郑煤机	16,900	219,362.00	0.58
27	600398	海澜之家	28,940	217,050.00	0.58
28	600563	法拉电子	1,800	214,056.00	0.57
29	688188	柏楚电子	1,100	213,675.00	0.57
30	002558	巨人网络	16,100	204,309.00	0.54
31	603345	安井食品	2,400	195,552.00	0.52
32	002262	恩华药业	7,900	192,365.00	0.51
33	600901	江苏金租	36,700	191,574.00	0.51
34	601231	环旭电子	11,000	181,500.00	0.48
35	000921	海信家电	6,200	179,180.00	0.48
36	603228	景旺电子	6,400	178,176.00	0.47
37	600549	厦门钨业	9,200	177,284.00	0.47
38	600863	内蒙华电	40,700	176,231.00	0.47
39	002155	湖南黄金	11,200	176,176.00	0.47
40	603939	益丰药房	7,300	176,149.00	0.47
41	300054	鼎龙股份	6,600	171,732.00	0.46
42	603816	顾家家居	6,200	170,996.00	0.46
43	002423	中粮资本	12,700	170,053.00	0.45
44	601665	齐鲁银行	29,800	166,582.00	0.44
45	000887	中鼎股份	12,600	165,312.00	0.44
46	603568	伟明环保	7,400	160,062.00	0.43
47	002244	滨江集团	18,200	156,702.00	0.42
48	601000	唐山港	32,800	154,488.00	0.41
49	600583	海油工程	28,200	154,254.00	0.41
50	600566	济川药业	5,300	154,124.00	0.41
51	600004	白云机场	16,000	153,600.00	0.41
52	600737	中粮糖业	14,200	144,982.00	0.39
53	603658	安图生物	3,300	144,012.00	0.38
54	600258	首旅酒店	9,800	143,766.00	0.38
55	601098	中南传媒	9,400	141,094.00	0.38
56	601139	深圳燃气	19,700	139,082.00	0.37
57	603589	口子窖	3,500	137,340.00	0.37
58	600867	通化东宝	16,300	131,378.00	0.35
59	300487	蓝晓科技	2,700	129,249.00	0.34
60	603979	金诚信	3,500	127,050.00	0.34
61	600062	华润双鹤	6,400	126,720.00	0.34
62	000598	兴蓉环境	16,600	125,994.00	0.34
63	002557	洽洽食品	4,300	124,915.00	0.33
64	002831	裕同科技	4,600	124,660.00	0.33
65	002625	光启技术	2,600	124,280.00	0.33
66	600582	天地科技	20,000	123,600.00	0.33
67	000739	普洛药业	7,400	120,324.00	0.32

68	600418	江淮汽车	3,200	120,000.00	0.32
69	600487	亨通光电	6,900	118,818.00	0.32
70	002120	韵达股份	15,700	118,064.00	0.31
71	601016	节能风电	35,900	113,803.00	0.30
72	300595	欧普康视	6,000	113,700.00	0.30
73	603298	杭叉集团	5,800	103,762.00	0.28
74	002056	横店东磁	7,900	102,384.00	0.27
75	000563	陕国投 A	28,600	101,816.00	0.27
76	600970	中材国际	10,100	95,748.00	0.25
77	601108	财通证券	11,600	94,772.00	0.25
78	600352	浙江龙盛	9,100	93,639.00	0.25
79	600612	老凤祥	1,700	92,259.00	0.25
80	600298	安琪酵母	2,500	90,125.00	0.24
81	603883	老百姓	5,500	90,035.00	0.24
82	600968	海油发展	20,800	88,816.00	0.24
83	600096	云天化	3,900	86,970.00	0.23
84	601990	南京证券	10,000	86,600.00	0.23
85	000155	川能动力	8,000	85,440.00	0.23
86	600879	航天电子	9,500	85,120.00	0.23
87	600885	宏发股份	2,600	82,732.00	0.22
88	000738	航发控制	3,700	82,288.00	0.22
89	300339	润和软件	1,600	80,048.00	0.21
90	600765	中航重机	3,900	79,833.00	0.21
91	000623	吉林敖东	4,600	79,442.00	0.21
92	000988	华工科技	1,800	77,940.00	0.21
93	688778	厦钨新能	1,700	77,588.00	0.21
94	000878	云南铜业	6,300	76,797.00	0.20
95	603379	三美股份	2,000	76,760.00	0.20
96	600483	福能股份	7,600	75,772.00	0.20
97	600271	航天信息	8,300	75,613.00	0.20
98	600166	福田汽车	29,800	74,798.00	0.20
99	000034	神州数码	2,100	73,605.00	0.20
100	002797	第一创业	8,800	73,480.00	0.20
101	600038	中直股份	1,900	73,264.00	0.20
102	000060	中金岭南	15,600	73,164.00	0.19
103	600157	永泰能源	41,500	70,965.00	0.19
104	000636	风华高科	4,900	70,315.00	0.19
105	603225	新凤鸣	6,300	70,119.00	0.19
106	002409	雅克科技	1,200	69,540.00	0.19
107	002563	森马服饰	9,800	68,796.00	0.18
108	002152	广电运通	5,900	68,794.00	0.18
109	601958	金钼股份	6,800	68,408.00	0.18
110	002203	海亮股份	6,300	67,725.00	0.18
111	603927	中科软	3,120	67,704.00	0.18

112	002384	东山精密	2,300	67,160.00	0.18
113	601019	山东出版	5,900	66,965.00	0.18
114	002508	老板电器	3,100	66,433.00	0.18
115	600685	中船防务	2,800	66,360.00	0.18
116	600143	金发科技	7,600	65,664.00	0.17
117	000039	中集集团	8,400	65,268.00	0.17
118	688777	中控技术	1,300	64,571.00	0.17
119	600707	彩虹股份	7,800	64,116.00	0.17
120	002340	格林美	9,800	63,994.00	0.17
121	002373	千方科技	6,300	63,882.00	0.17
122	600839	四川长虹	6,600	63,690.00	0.17
123	600312	平高电气	3,300	63,360.00	0.17
124	600131	国网信通	3,300	62,403.00	0.17
125	605358	立昂微	2,500	61,925.00	0.16
126	002294	信立泰	2,000	61,860.00	0.16
127	688538	和辉光电	26,546	61,586.72	0.16
128	688072	拓荆科技	400	61,468.00	0.16
129	601162	天风证券	13,600	60,928.00	0.16
130	002608	江苏国信	7,900	60,593.00	0.16
131	600820	隧道股份	8,400	60,396.00	0.16
132	000050	深天马 A	6,600	59,598.00	0.16
133	600977	中国电影	5,100	59,211.00	0.16
134	301236	软通动力	1,000	58,710.00	0.16
135	601933	永辉超市	9,200	58,328.00	0.16
136	600598	北大荒	3,900	57,525.00	0.15
137	603156	养元饮品	2,500	57,100.00	0.15
138	600535	天士力	3,900	56,394.00	0.15
139	601099	太平洋	13,200	56,232.00	0.15
140	002156	通富微电	1,900	56,145.00	0.15
141	600536	中国软件	1,200	56,028.00	0.15
142	601966	玲珑轮胎	3,100	55,924.00	0.15
143	600925	苏能股份	10,500	55,650.00	0.15
144	601928	凤凰传媒	4,700	54,238.00	0.14
145	002202	金风科技	5,200	53,716.00	0.14
146	002185	华天科技	4,600	53,406.00	0.14
147	600380	健康元	4,700	52,969.00	0.14
148	000066	中国长城	3,600	52,452.00	0.14
149	600528	中铁工业	6,500	52,390.00	0.14
150	603858	步长制药	3,300	52,140.00	0.14
151	600988	赤峰黄金	3,300	51,513.00	0.14
152	600079	人福医药	2,200	51,436.00	0.14
153	600511	国药股份	1,500	51,330.00	0.14
154	601568	北元集团	12,200	51,240.00	0.14
155	601399	国机重装	16,600	51,128.00	0.14

156	300476	胜宏科技	1,200	50,508.00	0.13
157	603056	德邦股份	3,500	50,155.00	0.13
158	002738	中矿资源	1,400	49,700.00	0.13
159	600516	方大炭素	10,200	49,266.00	0.13
160	688120	华海清科	300	48,897.00	0.13
161	002266	浙富控股	15,500	48,360.00	0.13
162	300058	蓝色光标	5,200	48,256.00	0.13
163	603556	海兴电力	1,300	48,087.00	0.13
164	600299	安迪苏	3,800	47,690.00	0.13
165	600282	南钢股份	9,800	45,962.00	0.12
166	002690	美亚光电	3,100	45,942.00	0.12
167	600755	厦门国贸	6,900	45,816.00	0.12
168	300136	信维通信	1,800	45,792.00	0.12
169	300017	网宿科技	4,300	45,451.00	0.12
170	601615	明阳智能	3,600	45,396.00	0.12
171	300024	机器人	2,500	44,875.00	0.12
172	000883	湖北能源	8,900	44,322.00	0.12
173	688361	中科飞测	500	43,775.00	0.12
174	688469	芯联集成	8,500	43,605.00	0.12
175	603786	科博达	700	43,260.00	0.12
176	002465	海格通信	3,900	42,822.00	0.11
177	688122	西部超导	1,000	42,820.00	0.11
178	600109	国金证券	4,900	42,777.00	0.11
179	002532	天山铝业	5,400	42,498.00	0.11
180	002195	岩山科技	10,700	42,479.00	0.11
181	002673	西部证券	5,200	42,380.00	0.11
182	603605	珀莱雅	500	42,350.00	0.11
183	000783	长江证券	6,200	42,284.00	0.11
184	603606	东方电缆	800	42,040.00	0.11
185	002281	光迅科技	800	41,736.00	0.11
186	300496	中科创达	700	41,692.00	0.11
187	600848	上海临港	4,100	41,410.00	0.11
188	300395	菲利华	1,100	41,371.00	0.11
189	603707	健友股份	3,100	41,137.00	0.11
190	000728	国元证券	4,900	40,964.00	0.11
191	300223	北京君正	600	40,920.00	0.11
192	301358	湖南裕能	900	40,788.00	0.11
193	002353	杰瑞股份	1,100	40,689.00	0.11
194	601228	广州港	11,900	40,341.00	0.11
195	603160	汇顶科技	500	40,270.00	0.11
196	600895	张江高科	1,500	40,200.00	0.11
197	002223	鱼跃医疗	1,100	40,139.00	0.11
198	600153	建发股份	3,800	39,976.00	0.11
198	601216	君正集团	7,600	39,976.00	0.11

199	300012	华测检测	3,200	39,776.00	0.11
200	688047	龙芯中科	300	39,684.00	0.11
201	000937	冀中能源	6,200	39,184.00	0.10
202	600007	中国国贸	1,600	39,136.00	0.10
203	002850	科达利	400	39,072.00	0.10
204	600720	中交设计	4,400	38,984.00	0.10
205	688213	思特威	500	38,860.00	0.10
206	600578	京能电力	11,000	38,720.00	0.10
207	300803	指南针	400	38,380.00	0.10
208	600688	上海石化	12,700	38,354.00	0.10
209	300699	光威复材	1,100	38,115.00	0.10
210	300866	安克创新	390	38,079.60	0.10
211	002821	凯莱英	500	38,045.00	0.10
212	600862	中航高科	1,500	37,890.00	0.10
213	601233	桐昆股份	3,200	37,760.00	0.10
214	002607	中公教育	11,100	37,740.00	0.10
215	300142	沃森生物	3,100	37,448.00	0.10
216	300037	新宙邦	1,000	37,440.00	0.10
217	300474	景嘉微	400	37,396.00	0.10
218	688525	佰维存储	600	37,182.00	0.10
219	000750	国海证券	8,600	36,808.00	0.10
220	002472	双环传动	1,200	36,744.00	0.10
221	000009	中国宝安	4,000	36,600.00	0.10
222	600098	广州发展	5,700	36,594.00	0.10
223	600369	西南证券	7,700	35,959.00	0.10
224	300114	中航电测	500	35,890.00	0.10
225	603596	伯特利	800	35,672.00	0.09
226	002436	兴森科技	3,200	35,552.00	0.09
227	300604	长川科技	800	35,304.00	0.09
228	300383	光环新网	2,400	35,016.00	0.09
229	688249	晶合集成	1,500	35,010.00	0.09
230	002261	拓维信息	1,900	34,789.00	0.09
231	000932	华菱钢铁	8,300	34,694.00	0.09
232	601696	中银证券	3,100	34,596.00	0.09
233	000733	振华科技	800	33,736.00	0.09
234	603893	瑞芯微	300	33,018.00	0.09
235	601997	贵阳银行	5,500	33,000.00	0.09
236	688002	睿创微纳	700	32,907.00	0.09
237	600497	驰宏锌锗	5,900	32,863.00	0.09
238	688180	君实生物	1,200	32,796.00	0.09
239	688052	纳芯微	250	32,575.00	0.09
240	600141	兴发集团	1,500	32,550.00	0.09
241	300919	中伟股份	900	32,508.00	0.09
242	601456	国联证券	2,400	32,448.00	0.09

243	688017	绿的谐波	300	32,418.00	0.09
244	000021	深科技	1,700	32,402.00	0.09
245	603338	浙江鼎力	500	32,260.00	0.09
246	300073	当升科技	800	32,224.00	0.09
247	600909	华安证券	5,300	32,118.00	0.09
248	002065	东华软件	4,400	31,944.00	0.09
249	000997	新大陆	1,600	31,920.00	0.08
250	002064	华峰化学	3,900	31,902.00	0.08
251	600155	华创云信	4,300	31,820.00	0.08
252	600673	东阳光	2,800	31,612.00	0.08
253	300751	迈为股份	300	31,545.00	0.08
254	600132	重庆啤酒	500	31,510.00	0.08
255	688521	芯原股份	600	31,458.00	0.08
256	603129	春风动力	200	31,414.00	0.08
257	000729	燕京啤酒	2,600	31,304.00	0.08
258	603087	甘李药业	700	30,870.00	0.08
259	300001	特锐德	1,400	30,730.00	0.08
260	002410	广联达	2,600	30,576.00	0.08
261	300763	锦浪科技	500	30,535.00	0.08
262	601061	中信金属	4,200	30,492.00	0.08
263	002318	久立特材	1,300	30,433.00	0.08
264	600521	华海药业	1,700	30,379.00	0.08
265	600704	物产中大	6,000	30,360.00	0.08
266	002739	万达电影	2,500	30,350.00	0.08
267	600637	东方明珠	3,900	30,264.00	0.08
268	601666	平煤股份	3,000	30,060.00	0.08
269	600118	中国卫星	1,100	30,030.00	0.08
270	688578	艾力斯	500	29,950.00	0.08
271	600060	海信视像	1,500	29,910.00	0.08
272	603179	新泉股份	700	29,890.00	0.08
273	002385	大北农	6,900	29,877.00	0.08
274	002841	视源股份	800	29,528.00	0.08
275	002624	完美世界	2,800	28,924.00	0.08
276	002044	美年健康	6,300	28,917.00	0.08
277	601179	中国西电	3,800	28,842.00	0.08
278	300144	宋城演艺	3,100	28,799.00	0.08
279	002432	九安医疗	700	28,546.00	0.08
280	300003	乐普医疗	2,500	28,350.00	0.08
281	600699	均胜电子	1,800	28,206.00	0.08
282	002407	多氟多	2,340	28,080.00	0.07
283	002568	百润股份	1,000	28,010.00	0.07
284	000426	兴业银锡	2,500	27,800.00	0.07
285	600392	盛和资源	2,700	27,756.00	0.07
286	688536	思瑞浦	300	27,750.00	0.07

287	000723	美锦能源	6,100	27,511.00	0.07
288	000683	远兴能源	4,900	27,391.00	0.07
289	600008	首创环保	8,300	27,224.00	0.07
290	600170	上海建工	10,200	27,030.00	0.07
291	300558	贝达药业	500	26,965.00	0.07
292	688385	复旦微电	700	26,873.00	0.07
293	000960	锡业股份	1,900	26,657.00	0.07
294	600763	通策医疗	600	26,640.00	0.07
295	000629	钒钛股份	9,200	26,496.00	0.07
296	300251	光线传媒	2,800	26,432.00	0.07
297	600872	中炬高新	1,200	26,424.00	0.07
298	300529	健帆生物	900	26,406.00	0.07
299	000703	恒逸石化	4,200	26,376.00	0.07
300	300373	扬杰科技	600	26,112.00	0.07
301	600580	卧龙电驱	1,500	25,785.00	0.07
302	002500	山西证券	4,100	25,748.00	0.07
303	000830	鲁西化工	2,200	25,718.00	0.07
304	600316	洪都航空	800	25,696.00	0.07
305	002603	以岭药业	1,600	25,616.00	0.07
306	600998	九州通	5,000	25,600.00	0.07
307	300285	国瓷材料	1,500	25,560.00	0.07
308	002939	长城证券	3,100	25,420.00	0.07
309	300390	天华新能	1,100	25,355.00	0.07
310	600325	华发股份	4,400	25,344.00	0.07
311	600498	烽火通信	1,300	25,298.00	0.07
312	603077	和邦生物	12,400	25,296.00	0.07
313	300748	金力永磁	1,400	25,032.00	0.07
314	002926	华西证券	3,000	24,930.00	0.07
315	002958	青农商行	8,200	24,928.00	0.07
316	601880	辽港股份	14,400	24,912.00	0.07
317	600348	华阳股份	3,500	24,815.00	0.07
318	600021	上海电力	2,700	24,759.00	0.07
319	000591	太阳能	5,200	24,752.00	0.07
320	002025	航天电器	500	24,280.00	0.06
321	600208	衢州发展	8,200	24,272.00	0.06
322	603000	人民网	1,100	24,244.00	0.06
323	000893	亚钾国际	1,200	24,192.00	0.06
324	600754	锦江酒店	900	24,174.00	0.06
325	300146	汤臣倍健	2,000	24,100.00	0.06
326	002683	广东宏大	900	23,832.00	0.06
327	002414	高德红外	3,200	23,776.00	0.06
328	600546	山煤国际	2,000	23,660.00	0.06
329	000998	隆平高科	2,100	23,457.00	0.06
330	300212	易华录	1,000	23,400.00	0.06

331	688114	华大智造	500	23,395.00	0.06
332	603885	吉祥航空	1,700	23,290.00	0.06
333	688065	凯赛生物	600	23,280.00	0.06
334	002653	海思科	700	23,275.00	0.06
335	601001	晋控煤业	1,700	23,239.00	0.06
336	600486	扬农化工	400	23,148.00	0.06
337	000519	中兵红箭	1,600	23,120.00	0.06
337	002429	兆驰股份	4,000	23,120.00	0.06
338	600859	王府井	1,500	23,115.00	0.06
339	300677	英科医疗	900	22,752.00	0.06
340	002756	永兴材料	600	22,632.00	0.06
341	002507	涪陵榨菜	1,600	22,608.00	0.06
342	688563	航材股份	400	22,336.00	0.06
343	300601	康泰生物	1,300	22,295.00	0.06
344	601918	新集能源	3,100	22,258.00	0.06
345	002439	启明星辰	1,400	22,148.00	0.06
346	688005	容百科技	700	22,085.00	0.06
347	688278	特宝生物	300	22,011.00	0.06
348	603444	吉比特	100	21,884.00	0.06
349	002430	杭氧股份	1,000	21,800.00	0.06
350	688220	翱捷科技	400	21,636.00	0.06
351	300118	东方日升	1,800	21,564.00	0.06
352	300765	新诺威	800	21,272.00	0.06
353	300070	碧水源	4,200	21,252.00	0.06
354	603899	晨光股份	700	21,175.00	0.06
355	000785	居然智家	5,900	21,063.00	0.06
356	300676	华大基因	500	20,985.00	0.06
357	300573	兴齐眼药	300	20,934.00	0.06
358	688772	珠海冠宇	1,300	20,904.00	0.06
359	603529	爱玛科技	500	20,510.00	0.05
360	688234	天岳先进	400	20,480.00	0.05
361	688363	华熙生物	400	20,416.00	0.05
362	000987	越秀资本	2,900	20,358.00	0.05
363	601155	新城控股	1,700	20,332.00	0.05
364	600416	湘电股份	1,800	20,322.00	0.05
365	601156	东航物流	1,200	20,244.00	0.05
366	601991	大唐发电	7,000	19,950.00	0.05
367	000958	电投产融	3,200	19,936.00	0.05
368	601866	中远海发	7,600	19,836.00	0.05
369	600435	北方导航	2,000	19,520.00	0.05
370	002268	电科网安	1,200	19,500.00	0.05
371	002240	盛新锂能	1,400	19,292.00	0.05
372	300567	精测电子	300	19,290.00	0.05
373	688301	奕瑞科技	200	19,114.00	0.05

374	300009	安科生物	2,200	19,008.00	0.05
375	601611	中国核建	2,100	18,984.00	0.05
376	002368	太极股份	800	18,944.00	0.05
377	002572	索菲亚	1,100	18,898.00	0.05
378	603486	科沃斯	400	18,800.00	0.05
379	688349	三一重能	597	18,435.36	0.05
380	600995	南网储能	1,800	18,216.00	0.05
381	603290	斯达半导	200	17,964.00	0.05
382	000709	河钢股份	8,000	17,680.00	0.05
383	600517	国网英大	3,200	17,632.00	0.05
384	603712	七一二	900	17,523.00	0.05
385	000027	深圳能源	2,700	17,496.00	0.05
386	600959	江苏有线	5,200	17,420.00	0.05
387	601636	旗滨集团	3,100	17,391.00	0.05
388	002299	圣农发展	1,200	17,376.00	0.05
389	600378	昊华科技	600	17,346.00	0.05
390	600129	太极集团	700	17,304.00	0.05
391	000778	新兴铸管	4,500	17,280.00	0.05
392	301308	江波龙	200	17,200.00	0.05
393	600499	科达制造	2,200	17,160.00	0.05
394	603737	三棵树	400	17,040.00	0.05
395	000403	派林生物	800	16,904.00	0.04
396	300888	稳健医疗	400	16,832.00	0.04
397	601212	白银有色	6,000	16,680.00	0.04
398	600056	中国医药	1,500	16,650.00	0.04
399	603868	飞科电器	400	16,608.00	0.04
400	603882	金域医学	600	16,518.00	0.04
401	002487	大金重工	800	16,392.00	0.04
402	600884	杉杉股份	2,200	16,390.00	0.04
403	688390	固德威	400	16,360.00	0.04
404	600373	中文传媒	1,300	16,315.00	0.04
405	603728	鸣志电器	300	16,200.00	0.04
406	688297	中无人机	400	16,112.00	0.04
407	688387	信科移动	2,700	16,092.00	0.04
408	601106	中国一重	5,500	16,005.00	0.04
409	000032	深桑达 A	900	15,876.00	0.04
410	600801	华新水泥	1,300	15,730.00	0.04
411	003031	中瓷电子	300	15,717.00	0.04
412	000825	太钢不锈	4,500	15,660.00	0.04
413	601598	中国外运	2,900	15,515.00	0.04
414	301301	川宁生物	1,300	15,418.00	0.04
415	600329	达仁堂	500	15,400.00	0.04
416	002372	伟星新材	1,200	15,156.00	0.04
417	688331	荣昌生物	500	15,055.00	0.04

418	002019	亿帆医药	1,400	15,008.00	0.04
419	600663	陆家嘴	1,500	14,760.00	0.04
420	601608	中信重工	3,500	14,700.00	0.04
421	002080	中材科技	1,100	14,388.00	0.04
422	603688	石英股份	500	14,365.00	0.04
423	600126	杭钢股份	3,000	14,340.00	0.04
424	002531	天顺风能	1,800	14,238.00	0.04
425	600764	中国海防	500	14,160.00	0.04
426	601965	中国汽研	800	14,096.00	0.04
427	603650	彤程新材	400	13,988.00	0.04
428	600500	中化国际	3,460	13,909.20	0.04
429	688032	禾迈股份	122	13,742.08	0.04
430	603456	九洲药业	1,000	13,680.00	0.04
431	603233	大参林	900	13,554.00	0.04
432	688561	奇安信	500	13,415.00	0.04
433	600350	山东高速	1,300	13,364.00	0.04
434	688425	铁建重工	3,000	13,200.00	0.04
435	603185	弘元绿能	800	13,000.00	0.03
436	688516	奥特维	300	12,993.00	0.03
437	001286	陕西能源	1,400	12,992.00	0.03
438	688248	南网科技	400	12,836.00	0.03
439	300957	贝泰妮	300	12,807.00	0.03
440	600808	马钢股份	4,000	12,360.00	0.03
441	000967	盈峰环境	2,400	11,928.00	0.03
442	002867	周大生	800	11,624.00	0.03
443	600339	中油工程	3,200	11,456.00	0.03
444	002153	石基信息	1,600	11,424.00	0.03
445	000898	鞍钢股份	4,700	11,280.00	0.03
446	003022	联泓新科	800	11,016.00	0.03
447	000537	中绿电	1,200	10,944.00	0.03
448	688520	神州细胞	300	10,869.00	0.03
449	300140	节能环保	1,800	10,782.00	0.03
450	600295	鄂尔多斯	1,100	10,736.00	0.03
451	600032	浙江新能	1,400	10,360.00	0.03
452	688172	燕东微	500	10,025.00	0.03
453	688375	国博电子	200	9,872.00	0.03
454	301267	华夏眼科	500	9,520.00	0.03
455	600361	创新新材	2,400	9,264.00	0.02
456	003035	南网能源	2,200	9,196.00	0.02
457	000959	首钢股份	3,000	9,150.00	0.02
458	688475	萤石网络	300	9,057.00	0.02
459	301498	乖宝宠物	100	7,832.00	0.02
460	001203	大中矿业	900	7,794.00	0.02
461	000539	粤电力 A	1,700	7,701.00	0.02

462	603826	坤彩科技	400	7,700.00	0.02
463	301165	锐捷网络	100	7,220.00	0.02
464	688819	天能股份	248	6,750.56	0.02
465	688153	唯捷创芯	200	6,692.00	0.02
466	601858	中国科传	300	6,114.00	0.02
467	688295	中复神鹰	300	5,979.00	0.02
468	601158	重庆水务	1,100	5,390.00	0.01
469	688276	百克生物	200	5,022.00	0.01
470	603341	龙旗科技	100	4,675.00	0.01
471	600956	新天绿能	600	4,524.00	0.01

### 8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300502	新易盛	6,800	785,944.00	2.09
2	002028	思源电气	7,600	552,520.00	1.47
3	601058	赛轮轮胎	35,000	501,550.00	1.34
4	300394	天孚通信	4,400	401,984.00	1.07
5	600066	宇通客车	14,500	382,510.00	1.02
6	688169	石头科技	1,600	350,864.00	0.93
7	300750	宁德时代	800	212,800.00	0.57
8	601318	中国平安	3,300	173,745.00	0.46
9	600036	招商银行	3,800	149,340.00	0.40
10	600985	淮北矿业	9,000	126,630.00	0.34
11	300776	帝尔激光	1,800	114,444.00	0.30
12	000333	美的集团	1,500	112,830.00	0.30
13	600900	长江电力	3,700	109,335.00	0.29
14	600030	中信证券	3,000	87,510.00	0.23
15	002594	比亚迪	300	84,798.00	0.23
16	601899	紫金矿业	5,000	75,600.00	0.20
17	688029	南微医学	1,000	67,590.00	0.18
18	600276	恒瑞医药	1,400	64,260.00	0.17
19	300357	我武生物	3,100	62,992.00	0.17
20	600377	宁沪高速	4,100	62,771.00	0.17
21	002475	立讯精密	1,500	61,140.00	0.16
22	600887	伊利股份	1,900	57,342.00	0.15
23	688981	中芯国际	600	56,772.00	0.15
24	601816	京沪高铁	9,000	55,440.00	0.15
25	300760	迈瑞医疗	200	51,000.00	0.14
26	000725	京东方 A	11,300	49,607.00	0.13
27	603259	药明康德	800	44,032.00	0.12
28	601088	中国神华	1,000	43,480.00	0.12
29	600309	万华化学	600	42,810.00	0.11

30	603317	天味食品	3,100	41,354.00	0.11
31	300124	汇川技术	700	41,006.00	0.11
32	000063	中兴通讯	1,000	40,400.00	0.11
33	002371	北方华创	100	39,100.00	0.10
34	601668	中国建筑	6,400	38,400.00	0.10
35	600941	中国移动	300	35,448.00	0.09
36	600660	福耀玻璃	500	31,200.00	0.08
37	601766	中国中车	3,700	31,006.00	0.08
38	002714	牧原股份	800	30,752.00	0.08
39	600406	国电南瑞	1,200	30,264.00	0.08
40	600028	中国石化	4,500	30,060.00	0.08
41	601012	隆基绿能	1,900	29,849.00	0.08
42	600031	三一重工	1,800	29,664.00	0.08
43	002230	科大讯飞	600	28,992.00	0.08
44	002027	分众传媒	3,100	21,793.00	0.06
45	600436	片仔癀	100	21,450.00	0.06
46	601888	中国中免	300	20,103.00	0.05
47	000792	盐湖股份	1,200	19,752.00	0.05
48	000938	紫光股份	700	19,481.00	0.05
49	600019	宝钢股份	2,700	18,900.00	0.05
50	300015	爱尔眼科	1,400	18,550.00	0.05
51	601600	中国铝业	2,400	17,640.00	0.05
52	600893	航发动力	400	16,580.00	0.04
53	300408	三环集团	400	15,404.00	0.04
54	000002	万科 A	2,100	15,246.00	0.04
55	603042	华脉科技	1,000	15,050.00	0.04
56	003027	同兴科技	1,000	15,040.00	0.04
57	603993	洛阳钼业	2,200	14,630.00	0.04
58	600009	上海机场	400	13,660.00	0.04
59	600426	华鲁恒升	500	10,805.00	0.03
60	600415	小商品城	800	10,728.00	0.03
61	300122	智飞生物	400	10,520.00	0.03
62	600176	中国巨石	700	7,973.00	0.02

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	2,557,224.00	7.37
2	300394	天孚通信	1,998,091.00	5.76
3	601058	赛轮轮胎	1,766,908.00	5.09
4	002028	思源电气	1,708,988.00	4.92

5	600066	宇通客车	1,387,922.00	4.00
6	002517	恺英网络	1,348,750.00	3.89
7	601168	西部矿业	1,307,250.00	3.77
8	600398	海澜之家	1,199,642.80	3.46
9	002273	水晶光电	1,197,576.00	3.45
10	002128	电投能源	1,167,254.00	3.36
11	601128	常熟银行	1,132,223.00	3.26
12	002078	太阳纸业	1,124,261.00	3.24
13	600873	梅花生物	1,122,052.00	3.23
14	688169	石头科技	1,078,426.78	3.11
15	000830	鲁西化工	1,041,914.00	3.00
16	688099	晶晨股份	1,040,907.27	3.00
17	000933	神火股份	1,019,491.00	2.94
18	601000	唐山港	1,018,674.00	2.94
19	601666	平煤股份	1,014,551.00	2.92
20	000975	山金国际	1,013,326.00	2.92
21	600282	南钢股份	1,009,539.00	2.91
22	601077	渝农商行	1,006,269.00	2.90
23	600988	赤峰黄金	999,435.00	2.88
24	000423	东阿阿胶	995,128.00	2.87
25	600642	申能股份	988,643.00	2.85
26	600985	淮北矿业	988,463.00	2.85
27	002463	沪电股份	978,874.00	2.82
28	600901	江苏金租	973,721.00	2.81
29	600519	贵州茅台	962,737.00	2.77
30	002966	苏州银行	951,291.00	2.74
31	300207	欣旺达	946,192.00	2.73
32	600096	云天化	920,321.00	2.65
33	601717	郑煤机	916,907.00	2.64
34	601997	贵阳银行	914,390.00	2.63
35	600498	烽火通信	903,976.00	2.60
36	601098	中南传媒	899,224.00	2.59
37	002138	顺络电子	886,630.00	2.55
38	300866	安克创新	882,171.00	2.54
39	000513	丽珠集团	877,439.00	2.53
40	000400	许继电气	875,659.00	2.52
41	600529	山东药玻	859,108.00	2.48
42	600153	建发股份	836,192.00	2.41
43	601665	齐鲁银行	824,795.00	2.38
44	600582	天地科技	823,857.00	2.37
45	601318	中国平安	822,543.00	2.37
46	600298	安琪酵母	815,933.00	2.35
47	603939	益丰药房	813,637.60	2.34
48	601577	长沙银行	811,074.00	2.34

49	300002	神州泰岳	807,704.00	2.33
50	300724	捷佳伟创	803,056.00	2.31
51	600161	天坛生物	797,183.00	2.30
52	688387	信科移动	790,953.58	2.28
53	688617	惠泰医疗	789,772.38	2.28
54	600549	厦门钨业	779,373.00	2.25
55	600862	中航高科	776,407.00	2.24
56	688538	和辉光电	770,933.69	2.22
57	002203	海亮股份	770,730.00	2.22
58	002155	湖南黄金	768,303.00	2.21
59	002984	森麒麟	764,491.00	2.20
60	002056	横店东磁	757,273.00	2.18
61	002595	豪迈科技	754,829.00	2.17
62	002262	恩华药业	754,410.82	2.17
63	600967	内蒙一机	752,676.00	2.17
64	000563	陕国投 A	747,798.00	2.15
65	002223	鱼跃医疗	745,003.00	2.15
66	002756	永兴材料	744,370.38	2.14
67	601568	北元集团	741,467.00	2.14
68	600350	山东高速	738,133.00	2.13
69	000932	华菱钢铁	735,772.00	2.12
70	300001	特锐德	730,894.00	2.11
71	300009	安科生物	729,160.00	2.10
72	600511	国药股份	711,664.00	2.05
73	002152	广电运通	698,278.00	2.01
74	688188	柏楚电子	695,409.10	2.00

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	1,811,101.00	5.22
2	300394	天孚通信	1,651,323.00	4.76
3	601058	赛轮轮胎	1,574,711.00	4.54
4	002463	沪电股份	1,453,211.00	4.19
5	000933	神火股份	1,237,892.00	3.57
6	300866	安克创新	1,227,353.00	3.54
7	600066	宇通客车	1,224,470.00	3.53
8	000975	山金国际	1,189,500.00	3.43
9	600153	建发股份	1,155,602.00	3.33
10	002028	思源电气	1,134,116.00	3.27

11	600282	南钢股份	1,115,855.00	3.22
12	601168	西部矿业	1,113,073.00	3.21
13	601000	唐山港	1,109,458.00	3.20
14	600161	天坛生物	1,109,032.60	3.20
15	002128	电投能源	1,071,695.00	3.09
16	000830	鲁西化工	1,054,871.00	3.04
17	600498	烽火通信	1,041,505.00	3.00
18	601077	渝农商行	1,031,306.00	2.97
19	600519	贵州茅台	1,028,620.00	2.96
20	600096	云天化	1,021,909.00	2.94
21	002273	水晶光电	993,958.00	2.86
22	600873	梅花生物	981,974.00	2.83
23	600398	海澜之家	975,280.00	2.81
24	601666	平煤股份	974,622.00	2.81
25	600985	淮北矿业	970,439.00	2.80
26	600988	赤峰黄金	952,967.00	2.75
27	000423	东阿阿胶	947,035.00	2.73
28	601997	贵阳银行	933,707.00	2.69
29	002517	恺英网络	927,026.00	2.67
30	601128	常熟银行	923,575.50	2.66
31	600642	申能股份	916,209.00	2.64
32	600582	天地科技	902,438.00	2.60
33	600967	内蒙一机	901,855.00	2.60
34	688387	信科移动	900,132.58	2.59
35	688538	和辉光电	896,626.94	2.58
36	002223	鱼跃医疗	876,227.00	2.52
37	002078	太阳纸业	863,912.00	2.49
38	002966	苏州银行	861,705.00	2.48
39	600298	安琪酵母	856,655.00	2.47
40	300009	安科生物	846,987.00	2.44
41	600350	山东高速	846,055.00	2.44
42	688169	石头科技	844,401.18	2.43
43	601098	中南传媒	837,492.00	2.41
44	000932	华菱钢铁	817,908.00	2.36
45	600901	江苏金租	817,016.00	2.35
46	000563	陕国投 A	802,106.00	2.31
47	002429	兆驰股份	798,290.00	2.30
48	600862	中航高科	780,965.00	2.25
49	002152	广电运通	779,147.00	2.24
50	601568	北元集团	773,214.00	2.23
51	002595	豪迈科技	769,100.10	2.22
52	300017	网宿科技	763,919.00	2.20
53	002203	海亮股份	760,326.00	2.19
54	600497	驰宏锌锗	757,561.00	2.18

55	000513	丽珠集团	755,137.00	2.18
56	600755	厦门国贸	752,951.00	2.17
57	002056	横店东磁	751,581.00	2.17
58	300001	特锐德	740,232.00	2.13
59	601318	中国平安	739,347.00	2.13
60	601717	郑煤机	737,653.00	2.13
61	000060	中金岭南	736,369.00	2.12
62	300724	捷佳伟创	731,402.00	2.11
63	688099	晶晨股份	730,488.29	2.10
64	601298	青岛港	729,628.00	2.10
65	603338	浙江鼎力	727,184.55	2.10
66	600820	隧道股份	726,660.00	2.09
67	000581	威孚高科	717,932.00	2.07
68	603939	益丰药房	714,025.16	2.06
69	601958	金钼股份	713,976.00	2.06
70	601966	玲珑轮胎	711,589.00	2.05
71	600546	山煤国际	706,911.00	2.04
72	600517	国网英大	699,822.00	2.02
73	002155	湖南黄金	697,998.00	2.01

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	276,220,745.22
卖出股票收入（成交）总额	276,539,235.48

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	30,971.57	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	30,971.57	0.08
----	----	-----------	------

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113691	和邦转债	280	30,971.57	0.08

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与研判，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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思源电气（代码：002028 SZ）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. 思源电气股份有限公司

2024 年 10 月 1 日，思源电气股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局北京市西城区税务局广安门外税务所责令改正。

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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	12,496.22
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,496.22

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
安信中证 500 指数增强 A	801	8,166.98	0.00	0.00	6,541,749.58	100.00
安信中证 500 指数增强 C	851	17,682.63	8,950,674.88	59.48	6,097,241.77	40.52
合计	1,592	13,561.35	8,950,674.88	41.46	12,638,991.35	58.54

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信中证 500 指数增强 A	334,846.45	5.12
	安信中证 500 指数增强 C	0.56	0.00
	合计	334,847.01	1.55

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、	安信中证 500 指数增强 A	10~50

基金投资和研究部门 负责人持有本开放式 基金	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	10^50
本基金基金经理持有 本开放式基金	安信中证 500 指数增强 A	0
	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2018 年 11 月 29 日) 基金份额总额	451,841.35	247,296,198.16
本报告期期初基金 份额总额	7,517,092.35	13,105,889.91
本报告期基金总申 购份额	3,188,453.04	20,262,722.33
减：本报告期基金总 赎回份额	4,163,795.81	18,320,695.59
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	6,541,749.58	15,047,916.65

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的本基金审计费为人民币 10,000.00 元，其中本基金承担 4,972.24 元，其他部分由本基金管理人承担。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已完成整改
其他	无

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国投证券	2	552,754,500. 70	100.00	280,009.01	100.00	-
东方财富	2	5,480.00	0.00	2.86	0.00	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，本基金管理人制定了相应的内部管理规定，明确了证券公司提供证券交易及研究服务的准入标准和程序。准入标准主要包括财务状况、经营行为规范、合规风控能力、交易能力及研究服务能力。对于拟新增合作的证券公司，管理人开展尽职调查，并根据调查结果发起内部评估流程，评估通过后签订合作协议。本基金管理人根据规定于 2024 年 7 月 1 日调整了交易佣金费率，调整后被动股票型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国投证券	14,746.07	100.00	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日
2	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 19 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
6	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下	证券日报, 证券时报, 中	2024 年 3 月 28 日

	86 只基金 2023 年年度报告提示性公告	国证券报, 上海证券报	
8	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 19 日
9	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
10	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 26 日
11	安信基金管理有限责任公司关于旗下 89 只基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 7 月 18 日
12	安信基金管理有限责任公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 8 月 23 日
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年中期报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 8 月 29 日
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下 92 只基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 10 月 24 日
15	安信基金管理有限责任公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 11 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20240101-20241024	8,861,394.07	-	8,861,394.07	-	-
	2	20241025-20241231	-	8,922,917.51	-	8,922,917.51	41.33

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件;
- 2、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 4、《安信中证 500 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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 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

2025 年 3 月 28 日