

安信红利量化选股股票型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	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	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 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	41
7.7 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	41

7.8 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	41
7.9 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	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 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	43
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
11.1 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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信红利量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	安信红利量化选股股票	
基金主代码	025411	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 23 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	67,628,596.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信红利量化选股股票 A	安信红利量化选股股票 C
下属分级基金的交易代码	025411	025412
报告期末下属分级基金的 份额总额	49,569,903.74 份	18,058,693.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选符合红利主题界定的股票，通过数量化方法及基本面分析进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略。2、债券投资策略。3、衍生品投资策略。4、资产支持证券投资策略。5、融资业务策略。6、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率*10%
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货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王卫峰	张姗
	联系电话	0755-82509999	400-61-95555
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008-088-088	400-61-95555
传真		0755-82799292	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518026	518040
法定代表人	刘入领	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	安信红利量化选股股票 A	安信红利量化选股股票 C
本期已实现收益	8,321,308.30	2,195,067.13
本期利润	1,816,315.41	-296,129.04
加权平均基金份额本期利润	0.0236	-0.0134
本期加权平均净值利润率	2.23%	-1.27%
本期基金份额净值增长率	-5.17%	-5.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-2,954,558.45	-1,098,496.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0596	-0.0608
期末基金资产净值	46,615,345.29	16,960,196.34
期末基金份额净值	0.9404	0.9392
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-3.39%	-3.68%

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

安信红利量化选股股票 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	-10.31%	0.91%	-11.08%	0.83%	0.77%	0.08%
过去六个月	-5.17%	0.96%	-7.78%	0.89%	2.61%	0.07%
自基金合同生效起至今	-3.39%	0.82%	-6.72%	0.77%	3.33%	0.05%

安信红利量化选股股票 C

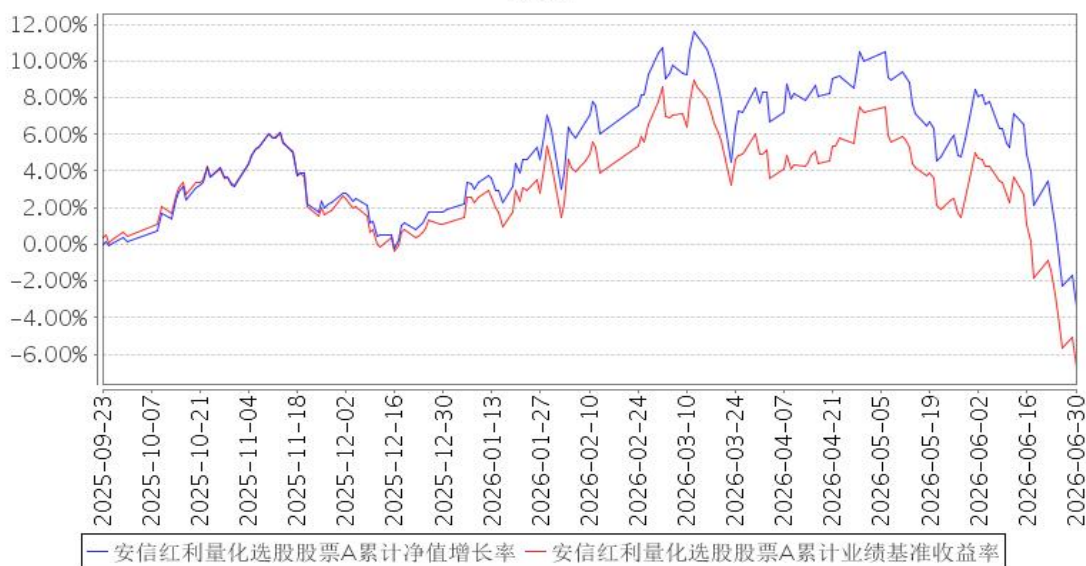
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.40%	0.91%	-11.08%	0.83%	0.68%	0.08%
过去六个月	-5.36%	0.96%	-7.78%	0.89%	2.42%	0.07%
自基金合同生效起至今	-3.68%	0.82%	-6.72%	0.77%	3.04%	0.05%

注：根据《安信红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率*10%。中证红利指数选取 100 只现金股息率高、分红较为稳定，并具有一定规模及流动性的上市公司证券作为指数样本，以反映高股息率上市公司证券的整体表现。中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

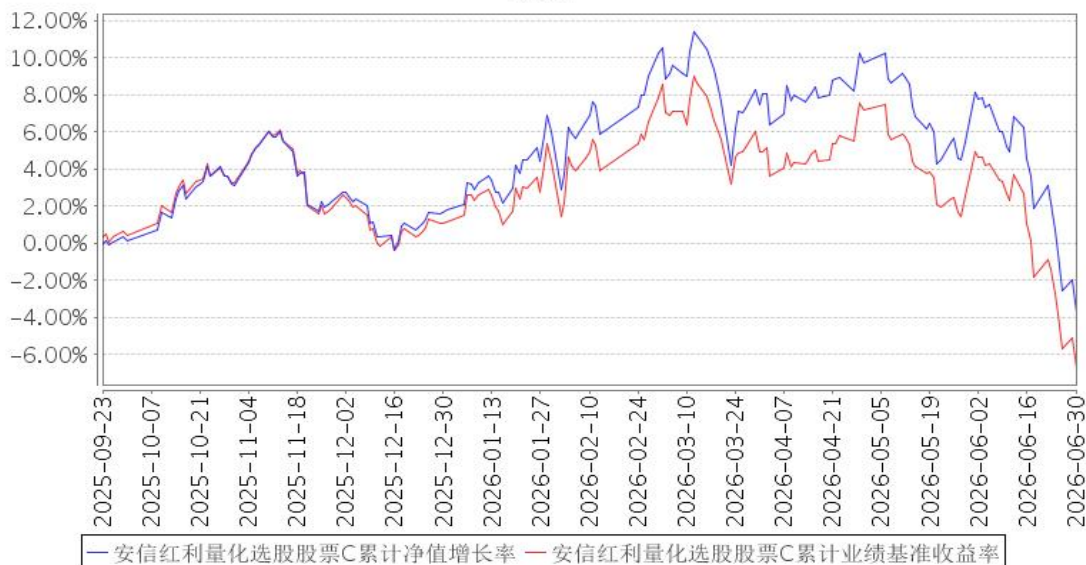
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

安信红利量化选股股票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



安信红利量化选股股票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、本基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 23 日，截至本报告末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同约定，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（以下简称“公司”）是一家提供资产管理服务的专业机构。公司经中国证监会批准于 2011 年 12 月 6 日在深圳市福田区注册成立，注册资本 5.0625 亿元。公司的经营范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。

公司的愿景是在资产管理领域成为国内一流、广受尊敬的机构。目前公司已搭建较为齐全的产品线，多元化的投资策略和不同风险收益特征的产品较好地满足了投资者各类理财需求。

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		
施荣盛	本基金的基金经理，量化投资部副总经理（主持工作）	2025 年 9 月 23 日	-	13 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理、基金经理、总经理助理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部副总经理（主持工作）。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、安信红利量化选股股票型证券投资基金、安信创业板指数增强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。

4.3.2 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 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

从量化投资的风格因子层面看，2026 年上半年，贝塔、动量、成长等因子表现较好，账面市值比、盈利等因子表现不佳。从行业层面看，电子、通信、建筑材料、机械设备等行业表现较好，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁行业表现不佳。

2026 年上半年，全球经济与政治格局在多重不确定因素交织下运行。美国与以色列对伊朗的军事行动以及持续演化的中东地缘冲突，对全球能源供应和大宗商品市场造成扰动，推动油价上涨并加剧通胀压力。同时，贸易摩擦、供应链调整以及主要经济体增长放缓进一步提升了全球经济运行的不确定性。主要经济体在通胀韧性与增长压力之间寻求平衡，货币政策分化持续影响全球金融市场表现，投资者风险偏好有所波动，资本市场整体呈现较高波动特征。国内方面，中国经济在复杂外部环境下保持较强韧性，宏观政策持续发挥托底作用，通过扩大内需、稳定投资、促进消费以及培育新质生产力等方式推动经济结构持续优化。科技创新、高端制造、人工智能等新兴产业加速发展，成为经济增长的重要驱动力，产业升级与自主创新能力不断增强。尽管外部需求压力和部分领域盈利修复仍面临挑战，但中国经济展现出较强的内生增长动力和政策调节能力。资本市场方面，2026 年上半年市场结构分化特征明显，人工智能产业链成为全球资本市场的重要投资主线。二季度以来，随着算力需求持续提升，AI 行情逐步由模型与应用端向上游基础设

施扩散，半导体、存储、服务器、数据中心等相关产业链受到市场关注，科技成长方向表现活跃。与此同时，价值与红利类资产阶段性承压，在市场风险偏好提升和成长风格占优的环境下，部分高股息、防御类资产出现回调，整体表现弱于科技成长板块。

本基金采用中证红利指数增强型策略进行运作，坚持宽基选股，淡化择时，以量化分析为基础，多维度选股，行业分散，覆盖 A 股多板块优质股票。本基金主要采用以“大数据+AI 算法”为基础的量化投资方法，基于对股票市场和上市公司相关数据进行深度挖掘，通过决策树、神经网络等机器学习和深度学习模型预测个股收益率，再采用组合优化和风险管理模型控制本基金和基准的跟踪误差和最大回撤。力争在控制跟踪误差的基础上，获取超越基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信红利量化选股股票 A 基金份额净值为 0.9404 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.17%；安信红利量化选股股票 C 基金份额净值为 0.9392 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.36%；同期业绩比较基准收益率为-7.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，中国经济有望在政策支持与产业升级推动下延续稳中向好的发展态势，宏观政策将继续围绕扩大内需、稳定增长和培育新质生产力展开，推动经济结构持续优化。但同时仍需关注全球地缘政治冲突、贸易摩擦以及主要经济体货币政策变化对外部需求和金融市场的潜在影响。预计下半年证券市场仍将呈现结构性机会特征，科技创新、高端制造、人工智能产业链有望继续成为重要投资方向，同时随着市场风险偏好的变化，优质消费、高股息等具有长期价值的资产也将提供配置机会。投资过程中需关注“政策+产业趋势”的协同效应，把握科技自主化、产业升级以及经济转型中的结构性机会。此外，市场风格切换和行业轮动或将持续加快，需要通过多维度分析和量化方法，在控制风险的基础上挖掘不同产业链中的超额收益机会。

量化投资的风格因子层面，2026 年下半年核心矛盾仍在于经济结构转型过程中防御需求与产业成长机会之间的平衡。一方面，宏观经济修复仍需时间，外部环境不确定性以及市场波动可能使质量、低波动等防御型因子保持一定吸引力；另一方面，人工智能、高端制造、新质生产力等产业趋势持续演进，有望为成长、动量等因子提供结构性机会。下半年需重点关注产业趋势演绎与市场交易拥挤风险，关注成长因子持续表现过程中估值扩张的可持续性，同时警惕部分热门方向的阶段性过热风险。此外，随着市场风格轮动加快，应注重多因子均衡配置，挖掘质量、成长、波动率等因子的综合收益机会，并关注价值、红利类资产在市场环境变化中的配置价值。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 1,481,869.96 元，其中本基金 A 类分配金额为 1,103,513.93 元，C 类分配金额为 378,356.03 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

4.8 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

无。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信红利量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,946,315.60	15,825,420.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	59,998,692.14	187,489,900.36
其中：股票投资		59,998,692.14	187,489,900.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		33,145.45	271,788.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		64,978,153.19	203,587,108.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,244,378.10	4,545,622.06
应付管理人报酬		70,654.21	216,998.04
应付托管费		11,775.70	36,166.35
应付销售服务费		6,268.97	15,160.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	69,534.58	25,559.70
负债合计		1,402,611.56	4,839,506.30
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	67,628,596.75	196,058,365.03
未分配利润	6.4.7.8	-4,053,055.12	2,689,237.61
净资产合计		63,575,541.63	198,747,602.64
负债和净资产总计		64,978,153.19	203,587,108.94

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 67,628,596.75 份，其中安信红利量化选股股票 A 基金份额总额 49,569,903.74 份，基金份额净值 0.9404 元；安信红利量化选股股票 C 基金份额总额 18,058,693.01 份，基金份额净值 0.9392 元。

6.2 利润表

会计主体：安信红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,375,204.10
1. 利息收入		25,764.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,764.87
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）		11,011,564.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,487,891.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,523,673.11
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,996,189.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	334,064.14
减：二、营业总支出		855,017.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	629,952.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,991.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46,748.57
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	73,325.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,520,186.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,520,186.37
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,520,186.37

6.3 净资产变动表

会计主体：安信红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	196,058,365.03	-	2,689,237.61	198,747,602.64
二、本期期初净资产	196,058,365.03	-	2,689,237.61	198,747,602.64
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-128,429,768.28	-	-6,742,292.73	-135,172,061.01
(一)、综合收益总额	-	-	1,520,186.37	1,520,186.37

(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)	-128,429,768.28	-	-6,780,609.14	-135,210,377.42
其中：1. 基金申购款	27,134,002.35	-	1,710,871.79	28,844,874.14
2. 基金赎回款	-155,563,770.63	-	-8,491,480.93	-164,055,251.56
(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)	-	-	-1,481,869.96	-1,481,869.96
四、本期期末净资产	67,628,596.75	-	-4,053,055.12	63,575,541.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信红利量化选股股票型证券投资基金(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”)证监许可[2025]1030 号《关于准予安信红利量化选股股票型证券投资基金注册的批复》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《安信红利量化选股股票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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 256,573,479.58 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0163 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《安信红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 256,611,460.76 份，其中认购资金利息折合 37,981.18 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《安信红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》和《安信红利量化选股股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费/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

服务费的基金份额，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，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信红利量化选股股票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，包括国内依法发行和上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、公开发行的次级债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、信用衍生品、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关规定参与融资业务。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。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），投资于本基金界定的红利主题相关股票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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率*90%+中债综合全价指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》《安信红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年中期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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101 号《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》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	958,503.60
等于：本金	958,382.48
加：应计利息	121.12
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	3,987,812.00
等于：本金	3,987,296.44
加：应计利息	515.56
减：坏账准备	-
合计	4,946,315.60

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	67,402,921.84	-	59,998,692.14	-7,404,229.70
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	67,402,921.84	-	59,998,692.14	-7,404,229.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	110.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	9,916.99
合计	69,534.58

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信红利量化选股股票 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	155,744,995.51	155,744,995.51
本期申购	18,008,986.11	18,008,986.11
本期赎回（以“-”号填列）	-124,184,077.88	-124,184,077.88
本期末	49,569,903.74	49,569,903.74

安信红利量化选股股票 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,313,369.52	40,313,369.52
本期申购	9,125,016.24	9,125,016.24
本期赎回（以“-”号填列）	-31,379,692.75	-31,379,692.75
本期末	18,058,693.01	18,058,693.01

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）。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信红利量化选股股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,137,997.00	1,018,181.53	2,156,178.53
本期期初	1,137,997.00	1,018,181.53	2,156,178.53
本期利润	8,321,308.30	-6,504,992.89	1,816,315.41
本期基金份额交易产生的变动数	-4,309,139.54	-1,514,398.92	-5,823,538.46
其中：基金申购款	1,238,782.71	-66,813.78	1,171,968.93
基金赎回款	-5,547,922.25	-1,447,585.14	-6,995,507.39
本期已分配利润	-1,103,513.93	-	-1,103,513.93
本期末	4,046,651.83	-7,001,210.28	-2,954,558.45

安信红利量化选股股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	269,366.20	263,692.88	533,059.08
本期期初	269,366.20	263,692.88	533,059.08
本期利润	2,195,067.13	-2,491,196.17	-296,129.04
本期基金份额交易产生的变动数	-639,726.83	-317,343.85	-957,070.68
其中：基金申购款	513,432.68	25,470.18	538,902.86
基金赎回款	-1,153,159.51	-342,814.03	-1,495,973.54
本期已分配利润	-378,356.03	-	-378,356.03
本期末	1,446,350.47	-2,544,847.14	-1,098,496.67

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,867.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	21,880.61
结算备付金利息收入	-
其他	16.27
合计	25,764.87

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。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	240,431,755.30
减：卖出股票成本总额	230,686,171.93
减：交易费用	257,692.33
买卖股票差价收入	9,487,891.04

6.4.7.11 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,523,673.11
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	1,523,673.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,996,189.06
股票投资	-8,996,189.06
债券投资	-
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	-8,996,189.06

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	326,363.49
基金转换费收入	7,700.65
合计	334,064.14

6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,900.73
合计	73,325.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据基金管理人于 2026 年 3 月 19 日发布的《安信基金管理有限责任公司关于公司股权变更的公告》，中广核财务有限责任公司不再为基金管理人的股东。本次股权变更后，基金管理人股权结构变更为国投证券股份有限公司（出资比例 39.88%）、五矿资本控股有限公司（出资比例 39.84%）、佛山市顺德区新碧贸易有限公司（出资比例 20.28%）。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	629,952.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	310,925.27
应支付基金管理人的净管理费	319,026.83

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%/ \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,991.97

注：基金托管费每日计提，按月支付，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信红利量化选股 票 A	安信红利量化选股 票 C	合计
安信基金	-	482.03	482.03
国投证券	-	19.79	19.79
招商银行	-	753.00	753.00
合计	-	1,254.82	1,254.82

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：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	958, 503. 60	3, 867. 99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

安信红利量化选股股票 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 6 月 25 日	-	2026 年 6 月 25 日	0. 2190	942, 660. 67	160, 853. 26	1, 103, 513. 93	-
合计	-	-	-	0. 2190	942, 660. 67	160, 853. 26	1, 103, 513. 93	-
安信红利量化选股股票 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 6 月 25 日	-	2026 年 6 月 25 日	0. 2060	338, 496. 92	39, 859. 11	378, 356. 03	-
合计	-	-	-	0. 2060	338, 496. 92	39, 859. 11	378, 356. 03	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	174	1,945.32	3,060.66	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	18	602.82	610.74	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	73	1,597.24	1,862.96	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	43	677.68	2,008.53	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	66	1,168.20	5,565.12	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限（若有）内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管人招商银行，其他银行存款存放在国新证券股份有限公司、开源证券股份有限公司和大同证券有限责任公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,946,315.60	-	-	-	4,946,315.60
交易性金融资产	-	-	-	59,998,692.14	59,998,692.14
应收申购款	-	-	-	33,145.45	33,145.45
资产总计	4,946,315.60	-	-	60,031,837.59	64,978,153.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,244,378.10	1,244,378.10
应付管理人报酬	-	-	-	70,654.21	70,654.21
应付托管费	-	-	-	11,775.70	11,775.70
应付销售服务费	-	-	-	6,268.97	6,268.97
其他负债	-	-	-	69,534.58	69,534.58
负债总计	-	-	-	1,402,611.56	1,402,611.56
利率敏感度缺口	4,946,315.60	-	-	58,629,226.03	63,575,541.63
上年度末 2025 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	15,825,420.53	-	-	-	15,825,420.53
交易性金融资产	-	-	-	187,489,900.36	187,489,900.36
应收申购款	-	-	-	271,788.05	271,788.05
资产总计	15,825,420.53	-	-	187,761,688.41	203,587,108.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,545,622.06	4,545,622.06
应付管理人报酬	-	-	-	216,998.04	216,998.04
应付托管费	-	-	-	36,166.35	36,166.35
应付销售服务费	-	-	-	15,160.15	15,160.15
其他负债	-	-	-	25,559.70	25,559.70
负债总计	-	-	-	4,839,506.30	4,839,506.30
利率敏感度缺口	15,825,420.53	-	-	182,922,182.11	198,747,602.64

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2026 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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股票和债券，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。本基金股票投资占基金资产的比例为 80% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），投资于本基金界定的红利主题相关股票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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	59,998,692.14	94.37	187,489,900.36	94.34
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	59,998,692.14	94.37	187,489,900.36	94.34

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,972,074.50	6,287,382.87
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,972,074.50	-6,287,382.87

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	59,975,474.13	187,469,995.75
第二层次	10,110.00	-
第三层次	13,108.01	19,904.61
合计	59,998,692.14	187,489,900.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的

不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	59,998,692.14	92.34
	其中：股票	59,998,692.14	92.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,946,315.60	7.61
8	其他各项资产	33,145.45	0.05
9	合计	64,978,153.19	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	5,680.00	0.01
B	采矿业	15,007,615.00	23.61

C	制造业	16,642,886.87	26.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	836,346.00	1.32
E	建筑业	2,168,946.00	3.41
F	批发和零售业	968,627.00	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	4,775,988.00	7.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,499.00	0.09
J	金融业	13,495,832.00	21.23
K	房地产业	774,318.00	1.22
L	租赁和商务服务业	2,794,042.00	4.39
M	科学研究和技术服务业	4,804.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	989,910.27	1.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,354,686.00	2.13
S	综合	122,512.00	0.19
	合计	59,998,692.14	94.37

7.2.2 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。

7.3 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

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	601699	潞安环能	103,100	1,472,268.00	2.32
2	600256	广汇能源	293,300	1,448,902.00	2.28
3	600188	兖矿能源	76,400	1,357,628.00	2.14
4	600546	山煤国际	122,700	1,341,111.00	2.11
5	603565	中谷物流	119,400	1,171,314.00	1.84
6	601168	西部矿业	43,100	1,169,734.00	1.84
7	600985	淮北矿业	83,000	1,166,150.00	1.83
8	601225	陕西煤业	55,900	1,137,565.00	1.79
9	600295	鄂尔多斯	104,500	1,120,240.00	1.76
10	000983	山西焦煤	192,000	1,113,600.00	1.75
11	601919	中远海控	81,100	1,075,386.00	1.69
12	601838	成都银行	60,700	1,074,390.00	1.69
13	600348	华阳股份	130,600	999,090.00	1.57
14	600153	建发股份	124,400	986,492.00	1.55
15	601666	平煤股份	134,100	958,815.00	1.51

16	601000	唐山港	229,000	950,350.00	1.49
17	600015	华夏银行	146,000	932,940.00	1.47
18	600755	厦门国贸	166,200	900,804.00	1.42
19	600282	南钢股份	192,200	882,198.00	1.39
20	601229	上海银行	98,700	856,716.00	1.35
21	002756	永兴材料	15,100	855,264.00	1.35
22	601658	邮储银行	172,700	851,411.00	1.34
23	601825	沪农商行	109,700	821,653.00	1.29
24	600016	民生银行	253,700	816,914.00	1.28
25	002043	兔宝宝	73,500	814,380.00	1.28
26	002563	森马服饰	160,100	806,904.00	1.27
27	601998	中信银行	116,100	804,573.00	1.27
28	000933	神火股份	37,700	799,240.00	1.26
29	601398	工商银行	112,900	798,203.00	1.26
30	601818	光大银行	274,900	794,461.00	1.25
31	601169	北京银行	160,500	786,450.00	1.24
32	600064	南京高科	108,600	774,318.00	1.22
33	601328	交通银行	119,600	769,028.00	1.21
34	600273	嘉化能源	116,300	758,276.00	1.19
35	601988	中国银行	131,400	751,608.00	1.18
36	600039	四川路桥	93,400	730,388.00	1.15
37	002416	爱施德	79,700	714,112.00	1.12
38	000157	中联重科	101,500	707,455.00	1.11
39	601668	中国建筑	163,000	707,420.00	1.11
40	600741	华域汽车	44,700	693,744.00	1.09
41	601939	建设银行	71,200	685,656.00	1.08
42	002233	塔牌集团	97,900	682,363.00	1.07
43	601598	中国外运	136,600	677,536.00	1.07
44	000672	上峰材料	28,400	672,512.00	1.06
45	601077	渝农商行	109,100	666,601.00	1.05
46	600461	洪城环境	72,300	655,038.00	1.03
47	600057	厦门象屿	119,800	649,316.00	1.02
48	600757	长江传媒	87,600	640,356.00	1.01
49	600028	中国石化	141,800	632,428.00	0.99
50	600971	恒源煤电	86,700	598,230.00	0.94
51	600502	安徽建工	133,300	579,855.00	0.91
52	601098	中南传媒	56,300	553,992.00	0.87
53	603967	中创物流	53,100	549,585.00	0.86
54	601216	君正集团	122,600	546,796.00	0.86
55	600938	中国海油	19,800	537,570.00	0.85
56	600177	雅戈尔	69,700	524,841.00	0.83
57	601997	贵阳银行	95,600	490,428.00	0.77
58	601963	重庆银行	47,500	478,800.00	0.75

59	002540	亚太科技	97,300	454,391.00	0.71
60	301109	军信股份	32,600	406,196.00	0.64
61	601318	中国平安	8,100	386,694.00	0.61
62	600919	江苏银行	35,800	385,924.00	0.61
63	601101	昊华能源	28,800	304,128.00	0.48
64	002266	浙富控股	59,900	303,094.00	0.48
65	601088	中国神华	7,600	296,704.00	0.47
66	002271	东方雨虹	24,900	295,563.00	0.46
67	000589	贵州轮胎	72,100	292,726.00	0.46
68	000408	藏格矿业	4,100	284,212.00	0.45
69	002376	新北洋	49,200	282,900.00	0.44
70	600346	恒力石化	15,800	279,818.00	0.44
71	600737	中粮糖业	21,700	267,561.00	0.42
72	301662	宏工科技	2,635	266,978.20	0.42
73	002532	天山铝业	24,100	258,593.00	0.41
74	000906	浙商中拓	50,800	256,032.00	0.40
75	600398	海澜之家	47,100	246,333.00	0.39
76	601001	晋控煤业	14,000	243,460.00	0.38
77	600801	华新建材	15,500	241,800.00	0.38
78	605196	华通线缆	8,900	232,290.00	0.37
79	002415	海康威视	6,500	222,300.00	0.35
80	002572	索菲亚	30,100	219,730.00	0.35
81	601857	中国石油	24,800	215,264.00	0.34
82	002867	周大生	17,300	192,895.00	0.30
83	688679	通源环境	4,503	189,531.27	0.30
84	002154	报喜鸟	52,300	186,188.00	0.29
85	603381	永臻股份	11,000	169,510.00	0.27
86	603567	珍宝岛	38,000	166,440.00	0.26
87	002267	陕天然气	25,200	164,808.00	0.26
88	002737	葵花药业	14,300	160,303.00	0.25
89	002064	华峰化学	16,700	158,483.00	0.25
90	603187	海容冷链	13,100	150,519.00	0.24
91	600805	悦达投资	30,400	122,512.00	0.19
92	600350	山东高速	10,900	121,317.00	0.19
93	601886	江河集团	14,700	118,041.00	0.19
94	601009	南京银行	11,900	117,691.00	0.19
95	301181	标榜股份	4,900	113,386.00	0.18
96	600901	江苏金租	19,000	109,250.00	0.17
97	601006	大秦铁路	22,300	102,803.00	0.16
98	000651	格力电器	2,700	101,250.00	0.16
99	601566	九牧王	11,600	94,308.00	0.15
100	688553	汇宇制药	8,762	93,140.06	0.15
101	002887	绿茵生态	8,700	91,089.00	0.14

102	002206	海 利 得	17,500	90,475.00	0.14
103	301536	星宸科技	700	90,097.00	0.14
104	601339	百隆东方	12,700	85,979.00	0.14
105	301608	博实结	1,700	85,442.00	0.13
106	600373	中文传媒	12,600	83,538.00	0.13
107	002440	闰土股份	8,100	83,025.00	0.13
108	603889	新澳股份	15,230	77,825.30	0.12
109	601019	山东出版	12,000	76,800.00	0.12
110	603121	华培动力	6,500	76,375.00	0.12
111	001378	德冠新材	4,210	75,401.10	0.12
112	601916	浙商银行	27,500	72,325.00	0.11
113	600499	科达制造	5,100	70,380.00	0.11
114	002757	南兴股份	3,500	63,175.00	0.10
115	002758	浙农股份	7,800	61,620.00	0.10
116	000429	粤高速 A	4,500	61,425.00	0.10
117	300587	天铁科技	15,700	60,445.00	0.10
118	301012	扬电科技	2,500	58,725.00	0.09
119	300457	赢合科技	2,600	54,808.00	0.09
120	603383	顶点软件	2,000	53,120.00	0.08
121	002270	华明装备	2,700	50,895.00	0.08
122	603239	浙江仙通	3,400	50,354.00	0.08
123	688175	高凌信息	1,964	49,394.60	0.08
124	000900	现代投资	13,500	46,710.00	0.07
125	688215	瑞晟智能	1,145	45,983.20	0.07
126	600096	云天化	1,400	42,560.00	0.07
127	600815	厦工股份	14,900	38,293.00	0.06
128	000895	双汇发展	1,700	38,080.00	0.06
129	300982	苏文电能	2,200	33,242.00	0.05
130	301077	星华新材	1,200	27,096.00	0.04
131	000951	中国重汽	1,200	23,412.00	0.04
132	300919	中伟新材	500	21,875.00	0.03
133	601288	农业银行	3,500	21,245.00	0.03
134	000404	长虹华意	2,700	21,222.00	0.03
135	002601	龙佰集团	1,100	18,128.00	0.03
136	300906	日月明	700	17,451.00	0.03
137	600148	长春一东	1,100	15,961.00	0.03
138	600535	天士力	1,200	15,876.00	0.02
139	603619	中曼石油	800	14,968.00	0.02
140	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.02
141	002478	常宝股份	2,100	12,978.00	0.02
142	601187	厦门银行	1,900	12,977.00	0.02
143	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02
144	601128	常熟银行	1,700	9,894.00	0.02

145	688543	国科军工	200	7,890.00	0.01
146	600012	皖通高速	500	7,880.00	0.01
147	600426	华鲁恒升	300	7,176.00	0.01
148	002545	东方铁塔	400	6,488.00	0.01
149	301397	溯联股份	200	6,472.00	0.01
150	605028	世茂能源	300	6,390.00	0.01
151	600233	圆通速递	400	6,300.00	0.01
152	002772	众兴菌业	500	5,680.00	0.01
153	603459	红板科技	66	5,565.12	0.01
154	603162	海通发展	600	5,382.00	0.01
155	300564	筑博设计	400	4,804.00	0.01
156	688267	中触媒	212	4,176.40	0.01
157	000683	博源化工	700	4,032.00	0.01
158	003023	彩虹集团	200	3,888.00	0.01
159	601112	振石股份	174	3,060.66	0.00
160	688349	三一重能	200	3,036.00	0.00
161	603277	银都股份	300	2,994.00	0.00
162	002558	巨人网络	100	2,756.00	0.00
163	300616	尚品宅配	200	2,084.00	0.00
164	603435	嘉德利	43	2,008.53	0.00
165	603352	至信股份	73	1,862.96	0.00
166	603998	方盛制药	200	1,806.00	0.00
167	300061	旗天科技	200	1,398.00	0.00
168	300154	瑞凌股份	100	752.00	0.00
169	300532	今天国际	100	623.00	0.00
170	603293	埃泰克	18	610.74	0.00
171	600527	江南高纤	200	428.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601168	西部矿业	2,899,037.00	1.46
2	600502	安徽建工	2,810,855.00	1.41
3	601988	中国银行	2,242,670.00	1.13
4	002756	永兴材料	2,007,713.00	1.01
5	002416	爱施德	1,880,332.00	0.95
6	600755	厦门国贸	1,752,791.00	0.88
7	000672	上峰材料	1,707,708.00	0.86
8	000983	山西焦煤	1,630,331.00	0.82
9	601666	平煤股份	1,620,215.00	0.82
10	600971	恒源煤电	1,539,581.00	0.77

11	600188	兖矿能源	1,480,055.00	0.74
12	000408	藏格矿业	1,455,189.00	0.73
13	601699	潞安环能	1,450,777.00	0.73
14	000933	神火股份	1,441,783.00	0.73
15	601916	浙商银行	1,351,376.00	0.68
16	600295	鄂尔多斯	1,348,166.00	0.68
17	601939	建设银行	1,343,345.00	0.68
18	002563	森马服饰	1,318,008.00	0.66
19	600256	广汇能源	1,317,326.00	0.66
20	600273	嘉化能源	1,201,144.00	0.60

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

7.4.2 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	600188	兖矿能源	4,637,628.60	2.33
2	002756	永兴材料	4,351,910.00	2.19
3	600273	嘉化能源	3,748,939.00	1.89
4	600938	中国海油	3,728,362.00	1.88
5	000933	神火股份	3,458,007.00	1.74
6	601857	中国石油	3,421,265.00	1.72
7	600096	云天化	3,326,741.00	1.67
8	600398	海澜之家	3,207,346.00	1.61
9	002867	周大生	3,148,489.00	1.58
10	601088	中国神华	3,083,204.00	1.55
11	600028	中国石化	3,065,927.00	1.54
12	600901	江苏金租	2,996,921.00	1.51
13	601168	西部矿业	2,859,782.00	1.44
14	600919	江苏银行	2,856,139.00	1.44
15	601101	昊华能源	2,854,704.00	1.44
16	601166	兴业银行	2,834,568.00	1.43
17	600016	民生银行	2,831,252.00	1.42
18	600039	四川路桥	2,783,275.00	1.40
19	601009	南京银行	2,756,278.00	1.39
20	601988	中国银行	2,630,381.00	1.32

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。

7.4.3 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	112,191,152.77
卖出股票收入（成交）总额	240,431,755.30

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，内蒙古鄂尔多斯资源股份有限公司、山西潞安环保能源开发股份有限公司、上海中谷物流股份有限公司、兖矿能源集团股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，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。

7.12.3 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	33,145.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,145.45

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 (%)
安信红利 量化选股 股票 A	965	51,367.78	99,798.92	0.20	49,470,104.82	99.80
安信红利 量化选股 股票 C	356	50,726.67	0.00	0.00	18,058,693.01	100.00
合计	1,307	51,743.38	99,798.92	0.15	67,528,797.83	99.85

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）。

8.2 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	安信红利量化选股股票 A	644,325.39	1.30
	安信红利量化选股股票 C	0.95	0.00
	合计	644,326.34	0.95

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）。

8.3 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、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	安信红利量化选股股票 A	10~50
	安信红利量化选股股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经 理持有本开 放式基金	安信红利量化选股股票 A	0~10
	安信红利量化选股股票 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信红利量化选股股票 A	安信红利量化选股股票 C
基金合同生效日（2025 年 9 月 23 日）基金份额总额	187,468,317.85	69,143,142.91
本报告期期初基金份额总额	155,744,995.51	40,313,369.52
本报告期基金总申购份额	18,008,986.11	9,125,016.24
减：本报告期基金总赎回份额	124,184,077.88	31,379,692.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,569,903.74	18,058,693.01

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期内，基金管理人高级管理人员人事变动情况如下：经公司第五届董事会第十五次会议审议通过，乔江晖女士于 2026 年 3 月 9 日卸任公司副总经理职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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容诚会计师事务所（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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人未受到相关监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员未受到相关监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
开源证券	2	178,724,007.76	50.69	81,475.73	70.93	-
大同证券	2	107,613,531.61	30.52	21,079.23	18.35	-
国新证券	2	66,215,632.75	18.78	12,310.17	10.72	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
开源证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-

国新 证券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

10.8 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	关于恢复安信红利量化选股股票型证券投资基金非个人投资者大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报	2026 年 1 月 16 日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下 104 只基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026 年 1 月 21 日
3	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	2026 年 3 月 10 日
4	安信基金管理有限责任公司关于公司股权变更的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2026 年 3 月 19 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下 105 只基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026 年 3 月 27 日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下 106 只基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026 年 4 月 21 日
7	安信基金管理有限责任公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司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	2026 年 6 月 1 日
8	关于暂停安信红利量化选股股票型证券投资基金非个人投资者大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报	2026 年 6 月 22 日
9	关于安信红利量化选股股票型证券投资基金 2026 年第一次分红的公告	上海证券报	2026 年 6 月 24 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2026 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信红利量化选股股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信红利量化选股股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信红利量化选股股票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。

12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 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

2026 年 8 月 28 日