

安信上证科创板综合指数增强型发起式证 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	9
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48

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	48
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	53
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	安信上证科创板综指增强发起	
基金主代码	023908	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 5 月 13 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	54,018,542.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信上证科创板综指增强发起 A	安信上证科创板综指增强发起 C
下属分级基金的交易代码	023908	023909
报告期末下属分级基金的份额总额	39,798,703.32 份	14,219,839.16 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	本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对标的指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。指数化被动投资策略以成份股在标的指数中的权重为基础，通过控制股票组合中各股票相对其在标的指数中权重的偏离，实现对跟踪误差的控制，进行指数化投资。量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评价股票超额收益预期、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。在债券和货币市场工具投资方面，将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。 此外，本基金还将采用衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
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。本基金若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	中国证券报
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)	
	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
本期已实现收益	14,556,253.45	5,028,472.00
本期利润	24,148,129.61	8,508,421.80
加权平均基金份额本期利润	0.5881	0.5728
本期加权平均净值利润率	37.08%	36.24%
本期基金份额净值增长率	44.28%	44.00%
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	27,506,479.93	9,713,709.14
期末可供分配基金份额利润	0.6911	0.6831
期末基金资产净值	78,867,263.99	28,049,709.11
期末基金份额净值	1.9817	1.9726
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	98.17%	97.26%
-------------	--------	--------

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

安信上证科创综指增强发起 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	43.02%	2.14%	52.44%	2.24%	-9.42%	-0.10%
过去六个月	44.28%	1.99%	50.92%	2.11%	-6.64%	-0.12%
过去一年	89.26%	1.69%	98.19%	1.86%	-8.93%	-0.17%
自基金合同生效起至今	98.17%	1.63%	104.04%	1.77%	-5.87%	-0.14%

安信上证科创综指增强发起 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	42.88%	2.14%	52.44%	2.24%	-9.56%	-0.10%
过去六个月	44.00%	1.99%	50.92%	2.11%	-6.92%	-0.12%
过去一年	88.49%	1.69%	98.19%	1.86%	-9.70%	-0.17%
自基金合同生效起至今	97.26%	1.63%	104.04%	1.77%	-6.78%	-0.14%

注：本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。上证科创板综合指数是由中证指数有限公司编制，由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。本基金为跟踪上证科创板综合指数的指数增强型证券投资基金，

在投资中将不低于非现金基金资产的 80% 投资于标的指数成份股及备选成份股，因此选取上证科创板综合指数收益率作为业绩比较基准，能够忠实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 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

安信上证科创板综指增强发起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



安信上证科创板综指增强发起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 5 月 13 日。

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		
朱舟扬	本基金的基金经理	2025 年 5 月 13 日	-	8 年	朱舟扬先生，哲学博士，曾任安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
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 5 月 13 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合规守信情况的说明

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。

本基金作为指数增强型基金，坚持宽基选股，淡化择时，以数量化分析为基础，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上证科创综指增强发起 A 基金份额净值为 1.9817 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.28%；安信上证科创综指增强发起 C 基金份额净值为 1.9726 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.00%；同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

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

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。

4.8 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

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满 3 年，故报告期不存在需要说明的情况。

§ 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：安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

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	7,854,057.79	6,237,155.36
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	101,485,405.94	76,374,553.19
其中：股票投资		101,445,080.46	76,374,553.19
基金投资		-	-
债券投资		40,325.48	-
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		697,697.75	198,312.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		110,037,161.48	82,810,021.48
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		2,991,178.93	1,880,296.45
应付管理人报酬		63,275.21	58,186.64
应付托管费		11,864.11	10,910.01
应付销售服务费		8,375.95	6,381.46
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	45,494.18	80,000.00
负债合计		3,120,188.38	2,035,774.56
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	54,018,542.48	58,846,098.31
未分配利润	6.4.7.8	52,898,430.62	21,928,148.61
净资产合计		106,916,973.10	80,774,246.92
负债和净资产总计		110,037,161.48	82,810,021.48

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 54,018,542.48 份，其中安信上证科创综指增强发起 A 基金份额总额 39,798,703.32 份，基金份额净值 1.9817 元；安信上证科创综指增强发起 C 基金份额总额 14,219,839.16 份，基金份额净值 1.9726 元。

6.2 利润表

会计主体：安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6
-----	-----	--	---

			月 30 日
一、营业总收入		33,165,946.14	3,889,916.18
1. 利息收入		17,546.10	9,571.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,546.10	9,571.84
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）		20,059,561.31	2,222,426.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	19,843,259.00	1,875,944.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	22,220.55	0.05
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	194,081.76	346,482.15
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	13,071,825.96	1,655,358.41
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	17,012.77	2,559.16
减：二、营业总支出		509,394.73	169,162.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	350,938.78	110,933.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,800.98	20,800.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46,357.92	17,696.49
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	46,297.05	19,732.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,656,551.41	3,720,754.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,656,551.41	3,720,754.06
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		32,656,551.41	3,720,754.06

6.3 净资产变动表

会计主体：安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

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	58,846,098.31	-	21,928,148.61	80,774,246.92
二、本期期初净资产	58,846,098.31	-	21,928,148.61	80,774,246.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,827,555.83	-	30,970,282.01	26,142,726.18
（一）、综合收益总额	-	-	32,656,551.41	32,656,551.41
（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）	-4,827,555.83	-	-1,686,269.40	-6,513,825.23
其中：1. 基金申购款	64,380,946.11	-	40,043,378.02	104,424,324.13
2. 基金赎回款	-69,208,501.94	-	-41,729,647.42	-110,938,149.36
（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	54,018,542.48	-	52,898,430.62	106,916,973.10
项目	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	127,813,881.94	-	-	127,813,881.94

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-54,569,187.43	-	3,439,580.25	-51,129,607.18
(一)、综合收益总额	-	-	3,720,754.06	3,720,754.06
(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)	-54,569,187.43	-	-281,173.81	-54,850,361.24
其中：1. 基金申购款	7,568,602.07	-	30,892.44	7,599,494.51
2. 基金赎回款	-62,137,789.50	-	-312,066.25	-62,449,855.75
(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	73,244,694.51	-	3,439,580.25	76,684,274.76

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：

刘入领

基金管理人负责人

廖维坤

主管会计工作负责人

苗杨

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金（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”）2025 年 3 月 25 日下发的证监许可[2025]583 号文“关于准予安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金注册的批复”准予注册，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《安信上证科创板综合指数增强型发起式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 2025 年 4 月 1 日至 2025 年 5 月 9 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（2025）验字第 70024611_H02 号验资报告。经向中国证监会备案，《安

信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 127,813,881.94 份，其中认购资金利息折合 46,036.55 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》及《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、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、赎回时收取赎回费用，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、赎回时收取赎回费用，且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。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。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并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信上证科创板综合指数增强型发起式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，包括上证科创板综合指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同），其他非标的指数成份股（包含主板、科创板、创业板及其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。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：本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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：上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》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。

6.4.3 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 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。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不

征收增值税。

根据财政部、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》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《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《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《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。

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	2,200,450.75
等于：本金	2,200,209.70
加：应计利息	241.05
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	5,653,607.04
等于：本金	5,652,622.73
加：应计利息	984.31
减：坏账准备	-
合计	7,854,057.79

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		84,708,970.89	-	101,445,080.46	16,736,109.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	26,000.00	2.98	40,325.48	14,322.50
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	26,000.00	2.98	40,325.48	14,322.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		84,734,970.89	2.98	101,485,405.94	16,750,432.07

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	-
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	39,671.58
其他	863.20
应付审计费	4,959.40
合计	45,494.18

注：本基金采用券商结算模式，其他负债的其他项目为提前到账未除权的股票现金红利、提前到账未除息的场内债券派息及提前到账的场内债券兑付款项等。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信上证科创综指增强发起 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	45,358,009.71	45,358,009.71
本期申购	34,130,738.70	34,130,738.70
本期赎回（以“-”号填列）	-39,690,045.09	-39,690,045.09
本期末	39,798,703.32	39,798,703.32

安信上证科创综指增强发起 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	13,488,088.60	13,488,088.60
本期申购	30,250,207.41	30,250,207.41
本期赎回（以“-”号填列）	-29,518,456.85	-29,518,456.85
本期末	14,219,839.16	14,219,839.16

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

安信上证科创综指增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,807,514.79	2,131,819.30	16,939,334.09
本期期初	14,807,514.79	2,131,819.30	16,939,334.09
本期利润	14,556,253.45	9,591,876.16	24,148,129.61
本期基金份额交易产生的变动数	-1,857,288.31	-161,614.72	-2,018,903.03
其中：基金申购款	18,200,874.07	3,228,658.70	21,429,532.77
基金赎回款	-20,058,162.38	-3,390,273.42	-23,448,435.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,506,479.93	11,562,080.74	39,068,560.67

安信上证科创综指增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,354,671.44	634,143.08	4,988,814.52
本期期初	4,354,671.44	634,143.08	4,988,814.52
本期利润	5,028,472.00	3,479,949.80	8,508,421.80
本期基金份额交易产生的变动数	330,565.70	2,067.93	332,633.63
其中：基金申购款	15,961,375.08	2,652,470.17	18,613,845.25
基金赎回款	-15,630,809.38	-2,650,402.24	-18,281,211.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,713,709.14	4,116,160.81	13,829,869.95

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	2,976.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14,569.59
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	17,546.10

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	369,925,421.19
减：卖出股票成本总额	349,714,297.03
减：交易费用	367,865.16
买卖股票差价收入	19,843,259.00

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	10.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,210.29
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	22,220.55

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	58,119.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,900.00
减：应计利息总额	7.28
减：交易费用	2.32
买卖债券差价收入	22,210.29

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	194,081.76
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	194,081.76

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	13,071,825.96
股票投资	13,057,503.46
债券投资	14,322.50
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	13,071,825.96

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	16,436.47
基金转换费收入	576.30
合计	17,012.77

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	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,666.07
合计	46,297.05

6.4.7.20 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。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 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。

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

本基金于本期及上年度可比期间均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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均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	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	350,938.78	110,933.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	142,319.05	49,652.86
应支付基金管理人的净管理费	208,619.73	61,280.52

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 0.80%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%/当年天数$$

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	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	65,800.98	20,800.02

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 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$

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		
	安信上证科创综指增强 发起 A	安信上证科创综指增强 发起 C	合计
安信基金	-	453.33	453.33
国投证券	-	61.87	61.87
招商银行	-	12,166.15	12,166.15
合计	-	12,681.35	12,681.35
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信上证科创综指增强 发起 A	安信上证科创综指增强 发起 C	合计
国投证券	-	8.67	8.67
招商银行	-	9,951.64	9,951.64
合计	-	9,960.31	9,960.31

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 类基金份额前一日的基金资产净值

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。

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。

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。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
基金合同生效日（ 2025 年 5 月 13 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,416.71	-
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	10,000,416.71	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	18.51%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生 效日）至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
基金合同生效日（ 2025 年 5 月 13 日）持有的基金份额	10,000,416.71	-
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	10,000,416.71	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	13.65%	-

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。

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		上年度可比期间 2025 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,200,450.75	2,976.51	5,975,537.31	3,083.11

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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

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	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	-

	源振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	79	883.22	1,389.61	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	16	535.84	542.88	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	30	656.40	765.60	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	42	661.92	1,961.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	60	1,062.00	5,059.20	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	55	963.60	1,975.60	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	22.68	47.61	29	657.72	1,380.69	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	130	2,558.40	18,393.70	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 6 月 23 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,384	741,418.77	1,151,488.00	-

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

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 2026 年 6 月 30 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 0.04%（2025 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	40,325.48	-
未评级	-	-
合计	40,325.48	-

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。

6.4.13.3 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。

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同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。

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。

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	7,854,057.79	-	-	-	7,854,057.79
交易性金融资产	-	-	40,325.48	101,445,080.46	101,485,405.94

应收申购款	-	-	-	697,697.75	697,697.75
资产总计	7,854,057.79	-	40,325.48	102,142,778.21	110,037,161.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,991,178.93	2,991,178.93
应付管理人报酬	-	-	-	63,275.21	63,275.21
应付托管费	-	-	-	11,864.11	11,864.11
应付销售服务费	-	-	-	8,375.95	8,375.95
其他负债	-	-	-	45,494.18	45,494.18
负债总计	-	-	-	3,120,188.38	3,120,188.38
利率敏感度缺口	7,854,057.79	-	40,325.48	99,022,589.83	106,916,973.10
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	6,237,155.36	-	-	-	6,237,155.36
交易性金融资产	-	-	-	76,374,553.19	76,374,553.19
应收申购款	-	-	-	198,312.93	198,312.93
资产总计	6,237,155.36	-	-	76,572,866.12	82,810,021.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,880,296.45	1,880,296.45
应付管理人报酬	-	-	-	58,186.64	58,186.64
应付托管费	-	-	-	10,910.01	10,910.01
应付销售服务费	-	-	-	6,381.46	6,381.46
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	2,035,774.56	2,035,774.56
利率敏感度缺口	6,237,155.36	-	-	74,537,091.56	80,774,246.92

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

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	598.02	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-586.64	-

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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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）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。

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	101,445,080.46	94.88	76,374,553.19	94.55
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	101,445,080.46	94.88	76,374,553.19	94.55

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%	7,892,627.38	5,587,385.63
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-7,892,627.38	-5,587,385.63

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	100,291,338.82	74,970,263.44
第二层次	1,162,598.02	1,359,429.25
第三层次	31,469.10	44,860.50
合计	101,485,405.94	76,374,553.19

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

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	101,445,080.46	92.19
	其中：股票	101,445,080.46	92.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	40,325.48	0.04
	其中：债券	40,325.48	0.04
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	7,854,057.79	7.14
8	其他各项资产	697,697.75	0.63
9	合计	110,037,161.48	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	70,104,888.34	65.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,852,598.54	17.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,529,082.14	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	1,311,917.94	1.23
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	91,798,486.96	85.86

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	761,323.00	0.71
C	制造业	8,041,823.50	7.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	317,968.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	291,901.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,242.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	213,026.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	6,200.00	0.01
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,646,593.50	9.02

7.2.3 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。

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

7.3.1 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	688256	寒武纪	4,182	6,672,590.10	6.24
2	688041	海光信息	15,944	5,904,063.20	5.52
3	688981	中芯国际	18,404	2,922,923.28	2.73
4	688012	中微公司	5,969	2,796,476.50	2.62
5	688008	澜起科技	5,999	1,859,090.10	1.74
6	688498	源杰科技	935	1,763,410.00	1.65
7	688795	摩尔线程	2,457	1,760,415.93	1.65
8	688802	沐曦股份	2,083	1,725,348.90	1.61
9	688521	芯原股份	4,147	1,539,117.58	1.44
10	688525	佰维存储	3,091	1,529,210.43	1.43
11	688702	盛科通信	3,395	1,324,016.05	1.24
12	688072	拓荆科技	1,384	1,151,488.00	1.08
13	688396	华润微	11,363	1,108,460.65	1.04
14	688766	普冉股份	1,285	985,081.00	0.92
15	688082	盛美上海	2,128	919,296.00	0.86
16	688110	东芯股份	4,137	842,706.90	0.79
17	688469	芯联集成	78,430	832,142.30	0.78
18	688002	睿创微纳	4,781	739,572.89	0.69
19	688146	中船特气	2,108	737,778.92	0.69
20	688036	传音控股	11,840	697,968.00	0.65
21	688627	精智达	933	667,095.00	0.62
22	688047	龙芯中科	4,264	659,512.88	0.62
23	688220	翱捷科技	5,245	652,058.40	0.61
24	688728	格科微	30,357	638,711.28	0.60
25	688775	影石创新	4,509	625,172.85	0.58
26	688322	奥比中光	4,655	607,710.25	0.57
27	688111	金山办公	2,810	598,670.50	0.56
28	688536	思瑞浦	1,588	578,174.92	0.54
29	688167	炬光科技	1,584	561,068.64	0.52
30	688120	华海清科	1,733	558,337.94	0.52
31	688099	晶晨股份	5,300	545,370.00	0.51
32	688368	晶丰明源	2,502	541,733.04	0.51
33	688025	杰普特	1,151	540,970.00	0.51
34	688361	中科飞测	1,248	536,640.00	0.50
35	688629	华丰科技	2,788	522,777.88	0.49
36	688385	复旦微电	7,273	518,492.17	0.48
37	688127	蓝特光学	5,279	515,230.40	0.48
38	688301	奕瑞科技	4,052	502,448.00	0.47

39	688472	阿特斯	46,256	500,489.92	0.47
40	688449	联芸科技	5,739	495,333.09	0.46
41	688257	新锐股份	4,854	494,622.60	0.46
42	688052	纳芯微	1,676	483,207.56	0.45
43	688372	伟测科技	2,597	483,042.00	0.45
44	688195	腾景科技	2,498	481,064.84	0.45
45	688205	德科立	2,288	476,338.72	0.45
46	688503	聚和材料	3,553	471,483.10	0.44
47	688599	天合光能	31,972	451,444.64	0.42
48	688097	博众精工	7,112	448,411.60	0.42
49	688213	思特威	4,143	443,591.01	0.41
50	688652	京仪装备	2,198	439,973.66	0.41
51	688778	厦钨新能	7,979	434,057.60	0.41
52	688388	嘉元科技	9,843	433,092.00	0.41
53	688150	莱特光电	6,306	432,717.72	0.40
54	688800	瑞可达	4,503	432,152.91	0.40
55	688347	华虹宏力	1,235	415,330.50	0.39
56	688279	峰昭科技	1,829	410,500.76	0.38
57	688548	广钢气体	7,763	404,452.30	0.38
58	688387	信科移动	20,194	400,648.96	0.37
59	688390	固德威	3,679	399,208.29	0.37
60	688559	海目星	4,745	398,200.40	0.37
61	688615	合合信息	3,518	397,885.80	0.37
62	688593	新相微	9,940	386,864.80	0.36
63	688005	容百科技	12,623	386,263.80	0.36
64	688172	燕东微	4,599	384,752.34	0.36
65	688336	三生国健	7,201	382,373.10	0.36
66	688059	华锐精密	1,892	377,851.32	0.35
67	688126	沪硅产业	9,391	374,606.99	0.35
68	688107	安路科技	7,947	362,383.20	0.34
69	688090	瑞松科技	3,372	358,949.40	0.34
70	688209	英集芯	12,287	357,305.96	0.33
71	688378	奥来德	5,760	357,120.00	0.33
72	688249	晶合集成	5,984	353,235.52	0.33
73	688208	道通科技	13,958	351,602.02	0.33
74	688486	龙迅股份	5,524	351,215.92	0.33
75	688262	国芯科技	8,048	347,915.04	0.33
76	688182	灿勤科技	8,040	346,282.80	0.32
77	688506	百利天恒	1,169	343,721.07	0.32
78	688166	博瑞医药	9,606	336,306.06	0.31
79	688677	海泰新光	3,320	335,751.60	0.31
80	688409	富创精密	1,093	334,731.25	0.31
81	688717	艾罗能源	4,031	332,839.67	0.31

82	688063	派能科技	6,218	331,232.86	0.31
83	688698	伟创电气	6,287	329,753.15	0.31
84	688231	隆达股份	8,892	326,603.16	0.31
85	688568	中科星图	7,851	325,580.97	0.30
86	688693	锆威特	3,132	325,571.40	0.30
87	688239	航宇科技	5,416	324,039.28	0.30
88	688230	芯导科技	4,049	319,101.69	0.30
89	688202	美迪西	3,953	319,046.63	0.30
90	688620	安凯微	19,547	316,661.40	0.30
91	688720	艾森股份	3,101	313,201.00	0.29
92	688518	联赢激光	10,105	312,244.50	0.29
93	688601	力芯微	5,152	311,953.60	0.29
94	688018	乐鑫科技	2,420	309,566.40	0.29
95	688653	康希通信	17,742	308,355.96	0.29
96	688710	益诺思	4,573	307,305.60	0.29
97	688226	威腾电气	7,169	307,048.27	0.29
98	688210	统联精密	7,483	303,136.33	0.28
99	688173	希荻微	15,831	303,005.34	0.28
100	688697	纽威数控	22,282	302,812.38	0.28
101	688678	福立旺	12,469	301,375.73	0.28
102	688512	慧智微	18,825	300,635.25	0.28
103	688660	电气风电	34,795	299,932.90	0.28
104	688758	赛分科技	13,597	299,269.97	0.28
105	688307	中润光学	3,732	298,373.40	0.28
106	688539	高华科技	9,284	295,973.92	0.28
107	688365	光云科技	18,714	295,119.78	0.28
108	688183	生益电子	2,213	293,001.20	0.27
109	688275	万润新能	2,290	292,089.50	0.27
110	688577	浙海德曼	6,339	290,516.37	0.27
111	688552	航天南湖	10,324	290,414.12	0.27
112	688095	福昕软件	4,886	290,374.98	0.27
113	688108	赛诺医疗	15,654	290,068.62	0.27
114	688683	莱尔科技	7,617	288,836.64	0.27
115	688049	炬芯科技	6,122	287,183.02	0.27
116	688400	凌云光	4,330	286,646.00	0.27
117	688543	国科军工	7,170	282,856.50	0.26
118	688087	英科再生	8,460	282,733.20	0.26
119	688069	德林海	7,486	279,676.96	0.26
120	688679	通源环境	6,628	278,972.52	0.26
121	688553	汇宇制药	26,190	278,399.70	0.26
122	688130	晶华微	9,759	274,423.08	0.26
123	688676	金盘科技	3,236	273,895.04	0.26
124	688175	高凌信息	10,805	271,745.75	0.25

125	688045	必易微	3,362	271,582.36	0.25
126	688633	星球石墨	9,110	270,840.30	0.25
127	688516	奥特维	4,633	265,887.87	0.25
128	688178	万德斯	7,707	260,573.67	0.24
129	688176	亚虹医药	26,240	260,300.80	0.24
130	688215	瑞晟智能	6,466	259,674.56	0.24
131	688148	芳源股份	30,163	258,798.54	0.24
132	688156	路德科技	8,544	258,456.00	0.24
133	688171	纬德信息	5,853	257,297.88	0.24
134	688315	诺禾致源	20,421	255,466.71	0.24
135	688350	富淼科技	7,311	252,448.83	0.24
136	688510	航亚科技	10,501	250,763.88	0.23
137	688091	上海谊众	6,175	248,235.00	0.23
138	688155	先惠技术	3,059	247,442.51	0.23
139	688299	长阳科技	14,764	246,706.44	0.23
140	688607	康众医疗	4,810	245,310.00	0.23
141	688228	开普云	3,144	243,156.96	0.23
142	688191	智洋创新	6,784	242,188.80	0.23
143	688626	翔宇医疗	5,389	238,517.14	0.22
144	688636	智明达	6,473	234,516.79	0.22
145	688523	航天环宇	4,456	233,494.40	0.22
146	688141	杰华特	1,512	232,092.00	0.22
147	688558	国盛智科	7,014	230,480.04	0.22
148	688291	金橙子	3,928	229,709.44	0.21
149	688162	巨一科技	9,713	229,615.32	0.21
150	688410	山外山	15,378	220,828.08	0.21
151	688159	有方科技	4,959	220,130.01	0.21
152	688200	华峰测控	400	210,040.00	0.20
153	688035	德邦科技	2,237	205,356.60	0.19
154	688373	盟科药业	44,696	202,472.88	0.19
155	688609	九联科技	18,008	198,268.08	0.19
156	688458	美芯晟	4,662	194,685.12	0.18
157	688223	晶科能源	39,986	189,933.50	0.18
158	688360	德马科技	10,592	189,596.80	0.18
159	688488	艾迪药业	14,589	187,468.65	0.18
160	688538	和辉光电	70,094	182,244.40	0.17
161	688658	悦康药业	14,005	180,104.30	0.17
162	688560	明冠新材	14,852	175,996.20	0.16
163	688529	豪森智能	11,093	174,492.89	0.16
164	688522	纳睿雷达	8,411	168,388.22	0.16
165	688267	中触媒	8,469	166,839.30	0.16
166	688573	信宇人	9,399	166,550.28	0.16
167	688618	三旺通信	5,395	166,004.15	0.16

168	688531	日联科技	930	165,391.20	0.15
169	688046	药康生物	6,786	164,221.20	0.15
170	688737	中自科技	8,203	157,005.42	0.15
171	688081	兴图新科	3,608	147,495.04	0.14
172	688395	正弦电气	6,526	144,224.60	0.13
173	688701	卓锦股份	18,219	137,189.07	0.13
174	688777	中控技术	1,130	132,775.00	0.12
175	688319	欧林生物	2,961	130,224.78	0.12
176	688021	奥福科技	6,006	116,276.16	0.11
177	688475	萤石网络	4,219	115,389.65	0.11
178	688311	盟升电子	4,192	109,788.48	0.10
179	688718	唯赛勃	6,580	105,082.60	0.10
180	688480	赛恩斯	1,108	97,049.72	0.09
181	688100	威胜信息	3,155	96,511.45	0.09
182	688489	三未信安	4,137	93,909.90	0.09
183	688271	联影医疗	912	92,321.76	0.09
184	688435	英方软件	2,807	89,824.00	0.08
185	688037	芯源微	200	87,810.00	0.08
186	688709	成都华微	2,293	87,340.37	0.08
187	688117	圣诺生物	3,134	84,712.02	0.08
188	688519	南亚新材	221	83,988.84	0.08
189	688199	久日新材	2,294	79,211.82	0.07
190	688203	海正生材	7,871	78,552.58	0.07
191	688292	浩瀚深度	4,161	77,394.60	0.07
192	688151	华强科技	5,010	74,498.70	0.07
193	688236	春立医疗	4,438	64,173.48	0.06
194	688576	西山科技	1,599	63,720.15	0.06
195	688418	震有科技	1,308	62,888.64	0.06
196	688285	高铁电气	8,402	60,242.34	0.06
197	688235	百济神州	222	56,523.42	0.05
198	688655	迅捷兴	1,049	56,184.44	0.05
199	688699	明微电子	634	51,956.30	0.05
200	688128	中国电研	1,775	42,138.50	0.04
201	688113	联测科技	1,196	41,979.60	0.04
202	688391	钜泉科技	1,044	37,448.28	0.04
203	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.03
204	688158	优刻得	933	34,297.08	0.03
205	688055	龙腾光电	4,515	26,006.40	0.02
206	688377	迪威尔	1,102	25,985.16	0.02
207	688177	百奥泰	1,524	25,633.68	0.02
208	688375	国博电子	241	25,136.30	0.02
209	688513	苑东生物	456	20,045.76	0.02
210	688575	亚辉龙	2,147	18,807.72	0.02

211	688112	鼎阳科技	214	15,720.44	0.01
212	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.01
213	688157	松井股份	539	14,224.21	0.01
214	688755	汉邦科技	512	14,110.72	0.01
215	688187	时代电气	200	13,732.00	0.01
216	688153	唯捷创芯	401	12,880.12	0.01
217	688569	铁科轨道	792	12,790.80	0.01
218	688085	三友医疗	1,019	12,197.43	0.01
219	688500	慧辰股份	200	9,066.00	0.01
220	688269	凯立新材	279	8,847.09	0.01
221	688371	菲沃泰	200	7,798.00	0.01
222	688349	三一重能	415	6,299.70	0.01
223	688429	时创能源	616	6,277.04	0.01
224	688612	威迈斯	202	5,977.18	0.01
225	688567	孚能科技	569	5,974.50	0.01
226	688310	迈得医疗	353	5,425.61	0.01
227	688225	亚信安全	436	5,415.12	0.01
228	688252	天德钰	220	5,280.00	0.00
229	688517	金冠电气	294	5,139.12	0.00
230	688051	佳华科技	200	4,596.00	0.00
231	688306	均普智能	211	2,131.10	0.00
232	688009	中国通号	408	1,942.08	0.00

7.3.2 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	002384	东山精密	1,000	262,350.00	0.25
2	300115	长盈精密	9,300	259,842.00	0.24
3	301536	星辰科技	2,000	257,420.00	0.24
4	601231	环旭电子	7,900	255,960.00	0.24
5	603920	世运电路	5,300	254,612.00	0.24
6	000603	盛达资源	11,000	254,100.00	0.24
7	002460	赣锋锂业	3,800	248,520.00	0.23
8	002497	雅化集团	12,100	246,477.00	0.23
9	002922	伊戈尔	7,500	246,000.00	0.23
10	002466	天齐锂业	4,000	245,280.00	0.23
11	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.22
12	300857	协创数据	700	237,930.00	0.22
13	600418	江淮汽车	9,200	237,636.00	0.22
14	605196	华通线缆	9,100	237,510.00	0.22
15	600499	科达制造	17,000	234,600.00	0.22
16	300919	中伟新材	5,300	231,875.00	0.22
17	600026	中远海能	12,900	231,426.00	0.22

18	002415	海康威视	6,700	229,140.00	0.21
19	000975	山金国际	13,300	226,100.00	0.21
20	002532	天山铝业	20,600	221,038.00	0.21
21	600346	恒力石化	12,400	219,604.00	0.21
22	002064	华峰化学	22,900	217,321.00	0.20
23	002414	高德红外	16,100	213,486.00	0.20
24	002266	浙富控股	42,100	213,026.00	0.20
25	603685	晨丰科技	7,300	208,050.00	0.19
26	301012	扬电科技	8,800	206,712.00	0.19
27	002402	和而泰	8,000	206,640.00	0.19
28	000933	神火股份	9,500	201,400.00	0.19
29	000703	恒逸石化	13,900	188,623.00	0.18
30	600595	中孚实业	32,300	181,526.00	0.17
31	601699	潞安环能	12,000	171,360.00	0.16
32	600309	万华化学	2,400	164,184.00	0.15
33	603626	科森科技	8,500	157,250.00	0.15
34	603121	华培动力	13,300	156,275.00	0.15
35	002865	钧达股份	2,400	143,232.00	0.13
36	300677	英科医疗	3,600	141,012.00	0.13
37	301358	湖南裕能	1,700	128,979.00	0.12
38	002475	立讯精密	1,700	119,680.00	0.11
39	300432	富临精工	4,500	90,405.00	0.08
40	301181	标榜股份	3,700	85,618.00	0.08
41	002271	东方雨虹	7,000	83,090.00	0.08
42	603703	盛洋科技	7,200	79,920.00	0.07
43	300223	北京君正	300	74,670.00	0.07
44	601061	中信金属	6,800	73,236.00	0.07
45	300587	天铁科技	18,700	71,995.00	0.07
46	002273	水晶光电	2,000	70,960.00	0.07
47	300055	万邦达	10,400	66,872.00	0.06
48	603308	应流股份	1,100	66,440.00	0.06
49	000938	紫光股份	2,300	66,378.00	0.06
50	603933	睿能科技	2,800	63,140.00	0.06
51	301662	宏工科技	620	62,818.40	0.06
52	601975	招商南油	14,800	55,204.00	0.05
53	601899	紫金矿业	1,800	45,252.00	0.04
54	301176	逸豪新材	600	40,800.00	0.04
55	603799	华友钴业	700	33,782.00	0.03
56	301606	绿联科技	500	30,510.00	0.03
57	600815	厦工股份	10,900	28,013.00	0.03
58	002493	荣盛石化	2,500	26,875.00	0.03
59	002759	ST 天际	1,100	26,829.00	0.03
60	601898	中煤能源	2,200	26,796.00	0.03

61	300269	联建光电	4,300	23,693.00	0.02
62	600489	中金黄金	1,300	23,465.00	0.02
63	688820	盛合晶微	130	18,393.70	0.02
64	000301	东方盛虹	1,500	17,175.00	0.02
65	002001	新 和 成	600	17,052.00	0.02
66	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.02
67	600426	华鲁恒升	600	14,352.00	0.01
68	002648	卫星化学	600	14,094.00	0.01
69	000425	徐工机械	1,700	13,753.00	0.01
70	600801	华新建材	700	10,920.00	0.01
71	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
72	300736	百邦科技	200	6,200.00	0.01
73	301479	弘景光电	100	6,020.00	0.01
74	600875	东方电气	200	5,754.00	0.01
75	000547	航天发展	300	5,745.00	0.01
76	600188	兖矿能源	300	5,331.00	0.00
77	601872	招商轮船	300	5,271.00	0.00
78	600988	赤峰黄金	200	5,264.00	0.00
79	603459	红板科技	60	5,059.20	0.00
80	300322	硕贝德	200	5,040.00	0.00
81	300582	英飞特	400	4,872.00	0.00
82	002251	步步高	1,400	4,732.00	0.00
83	000592	平潭发展	700	4,683.00	0.00
84	301275	汉朔科技	100	4,490.00	0.00
85	002379	宏桥控股	300	4,431.00	0.00
86	600331	宏达股份	400	4,396.00	0.00
87	300846	首都在线	200	4,242.00	0.00
88	600989	宝丰能源	200	4,066.00	0.00
89	300490	华自科技	300	3,969.00	0.00
90	300139	晓程科技	100	3,655.00	0.00
91	688712	北芯生命	55	1,975.60	0.00
92	603435	嘉德利	42	1,961.82	0.00
93	601112	振石股份	79	1,389.61	0.00
94	688781	视涯科技	29	1,380.69	0.00
95	603352	至信股份	30	765.60	0.00
96	603293	埃泰克	16	542.88	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	688525	佰维存储	3,452,539.42	4.27

2	688498	源杰科技	2,640,031.06	3.27
3	688256	寒武纪	2,513,408.91	3.11
4	688795	摩尔线程	2,373,289.58	2.94
5	688387	信科移动	2,329,136.76	2.88
6	688802	沐曦股份	2,210,044.88	2.74
7	688981	中芯国际	2,196,285.62	2.72
8	688702	盛科通信	2,001,267.96	2.48
9	688041	海光信息	1,969,693.69	2.44
10	688521	芯原股份	1,954,145.08	2.42
11	688036	传音控股	1,844,782.93	2.28
12	688375	国博电子	1,787,951.05	2.21
13	688167	炬光科技	1,620,691.72	2.01
14	688111	金山办公	1,550,020.51	1.92
15	688449	联芸科技	1,493,126.62	1.85
16	688548	广钢气体	1,443,925.77	1.79
17	688728	格科微	1,419,758.98	1.76
18	688368	晶丰明源	1,384,014.94	1.71
19	688766	普冉股份	1,354,977.71	1.68
20	688146	中船特气	1,341,082.53	1.66

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	688256	寒武纪	3,069,779.15	3.80
2	688525	佰维存储	3,018,966.73	3.74
3	688041	海光信息	2,238,350.42	2.77
4	688521	芯原股份	2,107,376.86	2.61
5	688498	源杰科技	2,050,049.59	2.54
6	688387	信科移动	2,023,037.69	2.50
7	688548	广钢气体	1,921,448.39	2.38
8	688111	金山办公	1,908,808.44	2.36
9	688981	中芯国际	1,895,138.62	2.35
10	688260	昀冢科技	1,842,168.85	2.28
11	688375	国博电子	1,836,606.37	2.27
12	688072	拓荆科技	1,771,242.91	2.19
13	688702	盛科通信	1,641,291.39	2.03
14	688183	生益电子	1,532,977.37	1.90
15	688449	联芸科技	1,522,840.06	1.89
16	688655	迅捷兴	1,504,645.30	1.86
17	688146	中船特气	1,451,084.66	1.80

18	688036	传音控股	1,396,416.96	1.73
19	688538	和辉光电	1,374,743.96	1.70
20	688396	华润微	1,365,121.53	1.69

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	361,727,320.84
卖出股票收入（成交）总额	369,925,421.19

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

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）	40,325.48	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,325.48	0.04

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

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	118068	迪威转债	250	39,325.46	0.04
2	118071	华峰转债	10	1,000.02	0.00

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

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

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

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

报告期内本基金投资的前十名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。

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	697,697.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	697,697.75
---	----	------------

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

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

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 (%)
安信上证 科创综指 增强发起 A	4,979	7,993.31	10,000,416.71	25.13	29,798,286.61	74.87
安信上证 科创综指 增强发起 C	3,074	4,625.84	0.00	0.00	14,219,839.16	100.00
合计	7,911	6,828.28	10,000,416.71	18.51	44,018,125.77	81.49

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	安信上证科创综指增强发起 A	30,517.17	0.08
	安信上证科创综指增强发起 C	1,401.72	0.01
	合计	31,918.89	0.06

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	安信上证科创综指增强发起 A	0~10
	安信上证科创综指增强发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信上证科创综指增强发起 A	0
	安信上证科创综指增强发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 （%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,416.71	18.51	10,000,416.71	18.51	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,416.71	18.51	10,000,416.71	18.51	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
基金合同生效日（2025 年 5 月 13 日）基金份额总额	80,441,242.90	47,372,639.04

本报告期期初基金份额总额	45,358,009.71	13,488,088.60
本报告期基金总申购份额	34,130,738.70	30,250,207.41
减：本报告期基金总赎回份额	39,690,045.09	29,518,456.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,798,703.32	14,219,839.16

§ 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。

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 (%)	
国新证券	2	731,566,814.84	100.00	135,995.59	100.00	-
国投证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)
国新证券	58,119.89	100.00	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	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
2	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
3	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
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下	上海证券报、中国证券报、	2026 年 3 月 27 日

	105 只基金 2025 年年度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
5	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
6	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

§ 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上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

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