

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证
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	5
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 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	38
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 市场中性策略执行情况	46
7.13 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 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	48
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	安信阿尔法定开混合	
基金主代码	005280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 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	45,593,975.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
下属分级基金的交 易代码	005280	009624
报告期末下属分级 基金的份额总额	11,474,600.85 份	34,119,375.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用 Alpha 多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建 Alpha 股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进

	行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	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)	
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
本期已实现收益	768,982.54	2,012,259.20
本期利润	267,101.46	638,744.20
加权平均基金份额本期利润	0.0215	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.83%	1.54%

本期基金份额净值增长率	1.85%	1.55%
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	1,956,580.49	4,373,450.05
期末可供分配基金份额利润	0.1705	0.1282
期末基金资产净值	13,483,602.07	38,677,328.74
期末基金份额净值	1.1751	1.1336
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	17.51%	3.31%

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

安信阿尔法定开混合 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	-0.53%	0.42%	0.37%	0.00%	-0.90%	0.42%
过去六个月	1.85%	0.36%	0.74%	0.01%	1.11%	0.35%
过去一年	0.91%	0.32%	1.50%	0.00%	-0.59%	0.32%
过去三年	-1.60%	0.28%	4.50%	0.00%	-6.10%	0.28%
过去五年	-3.24%	0.25%	7.50%	0.00%	-10.74%	0.25%
过去七年	19.00%	0.25%	10.51%	0.00%	8.49%	0.25%
自基金合同生效起至今	17.51%	0.23%	12.86%	0.00%	4.65%	0.23%

安信阿尔法定开混合 C

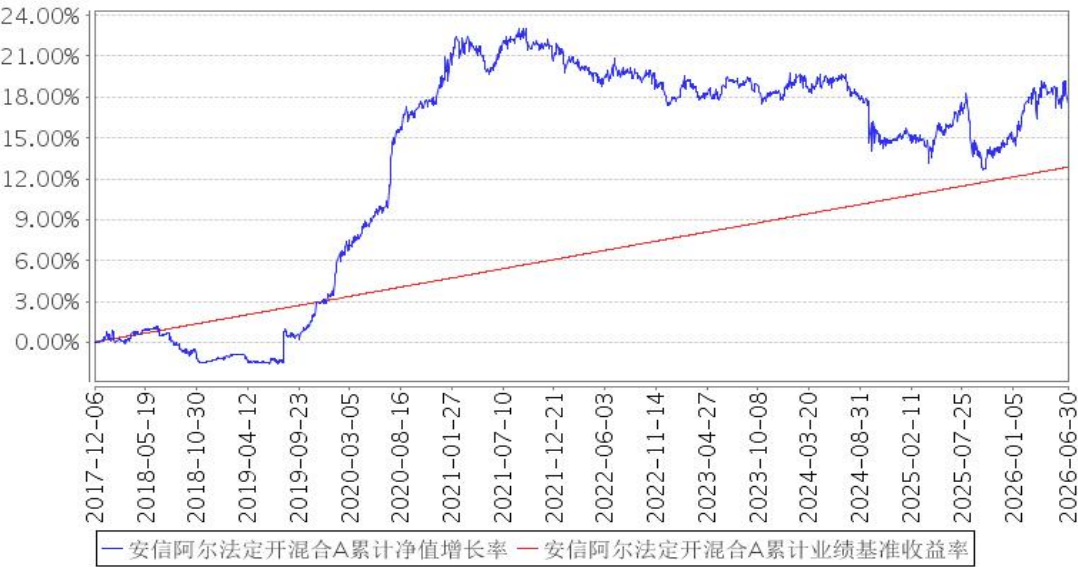
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	------------	-----	-----

	率①	准差②		准差④		
过去三个月	-0.68%	0.42%	0.37%	0.00%	-1.05%	0.42%
过去六个月	1.55%	0.36%	0.74%	0.01%	0.81%	0.35%
过去一年	0.30%	0.32%	1.50%	0.00%	-1.20%	0.32%
过去三年	-3.37%	0.28%	4.50%	0.00%	-7.87%	0.28%
过去五年	-6.11%	0.25%	7.50%	0.00%	-13.61%	0.25%
自基金合同生效起 至今	3.31%	0.25%	9.08%	0.00%	-5.77%	0.25%

注：根据《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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

安信阿尔法定开混合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



安信阿尔法定开混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 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。
- 3、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

§ 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	本基金的	2025 年 3	-	13 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券

盛	基金经 理，量 化投 资部 副 总 经 理 （主 持 工 作）	月 11 日			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

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。

本基金以资产配置为核心，灵活运用市场中性（量化对冲）、可转债、纯债、以及股票多头等资产和策略，通过资产与策略间的低相关性甚至负相关性，构建稳健的投资组合，力争达成绝对收益的目标。

首先，通过科学的资产配置方法将不同资产和策略有机结合，最大化组合的风险调整收益。量化投资的资产配置方法结合宏观经济环境、市场情绪和风险偏好等信息，动态调整各资产和策略的权重，确保组合在不同市场环境下的稳健性。主要是通过资产间的低相关性或负相关性，分散风险、优化收益，使得组合在任何单一资产或策略表现不佳时，仍能依靠其他资产或策略的补充实现绝对收益的目标。

市场中性（量化对冲）策略是本基金追求绝对收益的核心工具之一，其目标是通过量化模型优选股票组合并剥离市场系统性风险，从而专注于获取稳健的阿尔法收益。具体而言，本基金基于“大数据+AI 算法”构建量化模型，自下而上筛选出具有超额收益潜力的股票，再采用组合优化和风险管理模型构建指数增强的投资组合形成多头组合。随后，通过股指期货等对冲工具对冲掉市场的系统性风险，使投资组合的表现与市场波动无关。该策略的优势在于其低波动性和稳健

性，即使市场整体表现低迷，也能依靠阿尔法收益为组合创造绝对收益的价值。

可转债是一种兼具股性与债性的资产，具有独特的风险收益特征，是固收+基金的重要组成部分。其债性提供了较高的安全边际，而股性则赋予了参与市场上涨的潜力。本基金从量化投资的角度出发，挖掘可转债的有效因子，结合多因子体系和机器学习方法，构建兼顾绝对收益与回撤控制的投资组合。在市场波动较大或趋势不明朗时，可转债策略能够通过债性保护组合的安全性，而在市场反弹时则通过股性捕捉收益，实现灵活应对市场变化的目标。

纯债策略以利率债为主，强调资产的安全性和流动性。纯债策略能够在风险事件发生时、或市场不确定性较高时发挥“避风港”的作用，为组合提供稳健的收益来源和风险缓冲。

股票多头策略主要在市场被低估或风险偏好较高时使用，通过构建股票多头组合捕捉市场反弹和上涨的收益。本基金以量化分析为基础，基于对股票市场和上市公司相关数据进行深度挖掘，通过决策树和神经网络等机器学习模型，优选行业分散、兼具红利与成长属性的优质股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信阿尔法定开混合 A 基金份额净值为 1.1751 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.85%；安信阿尔法定开混合 C 基金份额净值为 1.1336 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

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

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：安信稳健阿尔法定期开放混合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	1,248,929.03	4,187,443.70
结算备付金		2,164,988.68	2,038,131.90
存出保证金		4,866,406.91	4,827,751.16
交易性金融资产	6.4.7.2	42,176,343.64	40,472,713.37
其中：股票投资		42,176,343.64	40,472,713.37
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		1,915,413.19	1,482,747.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,372,081.45	53,008,787.14
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		-	-
应付管理人报酬		45,893.76	43,533.11
应付托管费		9,178.76	8,706.62
应付销售服务费		20,422.82	18,415.08
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	135,655.30	70,410.80
负债合计		211,150.64	141,065.61
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	45,593,975.99	46,949,287.78
未分配利润	6.4.7.8	6,566,954.82	5,918,433.75
净资产合计		52,160,930.81	52,867,721.53
负债和净资产总计		52,372,081.45	53,008,787.14

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 45,593,975.99 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额 11,474,600.85 份，基金份额净值 1.1751 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额 34,119,375.14 份，基金份额净值 1.1336 元。

6.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,415,326.58	1,014,498.90
1. 利息收入		13,156.34	52,867.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,156.34	24,460.94
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		-	28,406.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		3,275,290.07	2,560,747.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,636,555.93	2,509,477.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	2,106.20
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	-3,739,846.85	-463,930.02
股利收益	6.4.7.15	378,580.99	513,094.25
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	-1,875,396.08	-1,605,283.63
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	2,276.25	6,167.37
减：二、营业总支出		509,480.92	437,387.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	277,119.90	254,947.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,423.98	50,989.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	122,871.79	72,759.32
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	55.54
其中：卖出回购金融资产 支出		-	55.54
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	4,615.40
8. 其他费用	6.4.7.19	54,065.25	54,020.17
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		905,845.66	577,111.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		905,845.66	577,111.13
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		905,845.66	577,111.13

6.3 净资产变动表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合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	46,949,287.78	-	5,918,433.75	52,867,721.53
二、本期期初净资产	46,949,287.78	-	5,918,433.75	52,867,721.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,355,311.79	-	648,521.07	-706,790.72
(一)、综合收益总额	-	-	905,845.66	905,845.66
(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)	-1,355,311.79	-	-257,324.59	-1,612,636.38
其中：1. 基金申购款	7,707,340.21	-	1,136,174.39	8,843,514.60
2. 基金赎回款	-9,062,652.00	-	-1,393,498.98	-10,456,150.98
(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	45,593,975.99	-	6,566,954.82	52,160,930.81
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	44,732,113.16	-	6,153,367.11	50,885,480.27
二、本期期初净资产	44,732,113.16	-	6,153,367.11	50,885,480.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,762,226.65	-	776,948.29	4,539,174.94
(一)、综合收益总额	-	-	577,111.13	577,111.13

（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）	3,762,226.65	-	199,837.16	3,962,063.81
其中：1. 基金申购款	12,480,695.40	-	1,522,416.45	14,003,111.85
2. 基金赎回款	-8,718,468.75	-	-1,322,579.29	-10,041,048.04
（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	48,494,339.81	-	6,930,315.40	55,424,655.21

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

安信稳健阿尔法定期开放混合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”）于 2015 年 11 月 20 日下发的中国证监会证监许可[2015]2684 号文“关于准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合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，以定期开放方式运行，存续期限不定。本基金募集期间为 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 30 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（2017）验字 60962175_H11 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,298,649.48 份，其中认购资金利息折合 143.77 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。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2020 年 5 月 28 日发布的《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》以及更新的《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本基金自 2020 年 6 月 12 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、且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；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、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、银行存款等固定收益类资产，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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和持有债券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和持有债券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货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。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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	1,248,929.03
等于：本金	1,248,791.80
加：应计利息	137.23
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,248,929.03

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		42,386,283.73	-	42,176,343.64	-209,940.09
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		42,386,283.73	-	42,176,343.64	-209,940.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-40,216,920.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	-40,216,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-40,216,920.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	-15.00	-21,824,100.00	1,800.00
IF2612	IF2612	-13.00	-18,569,460.00	-178,440.00
合计				-176,640.00
减：可抵销期货 暂收款				-176,640.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	86,524.32
其中：交易所市场	86,524.32
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	39,671.58
应付审计费	4,959.40
应付银行间账户维护费	4,500.00
合计	135,655.30

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 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	12,194,305.14	12,194,305.14
本期申购	1,373,293.06	1,373,293.06
本期赎回（以“-”号填列）	-2,092,997.35	-2,092,997.35
本期末	11,474,600.85	11,474,600.85

安信阿尔法定开混合 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	34,754,982.64	34,754,982.64
本期申购	6,334,047.15	6,334,047.15
本期赎回（以“-”号填列）	-6,969,654.65	-6,969,654.65
本期末	34,119,375.14	34,119,375.14

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

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,297,497.45	577,622.29	1,875,119.74
本期期初	1,297,497.45	577,622.29	1,875,119.74
本期利润	768,982.54	-501,881.08	267,101.46

本期基金份额交易产生的变动数	-109,899.50	-23,320.48	-133,219.98
其中：基金申购款	217,801.29	31,287.27	249,088.56
基金赎回款	-327,700.79	-54,607.75	-382,308.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,956,580.49	52,420.73	2,009,001.22

安信阿尔法定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,419,602.07	1,623,711.94	4,043,314.01
本期期初	2,419,602.07	1,623,711.94	4,043,314.01
本期利润	2,012,259.20	-1,373,515.00	638,744.20
本期基金份额交易产生的变动数	-58,411.22	-65,693.39	-124,104.61
其中：基金申购款	753,611.16	133,474.67	887,085.83
基金赎回款	-812,022.38	-199,168.06	-1,011,190.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,373,450.05	184,503.55	4,557,953.60

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	4,935.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,195.44
其他	25.75
合计	13,156.34

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	170,023,731.81
减：卖出股票成本总额	163,127,621.53
减：交易费用	259,554.35
买卖股票差价收入	6,636,555.93

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-3,739,846.85

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	378,580.99
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	378,580.99

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	-2,104,146.08
股票投资	-2,104,146.08
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	228,750.00
权证投资	-
期货投资	228,750.00
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	-1,875,396.08

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	2,276.25
合计	2,276.25

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	434.27
银行间账户维护费	9,000.00
合计	54,065.25

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

金额单位：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1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国投证券	5,992,525.58	1.78	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国投证券	2,013.42	1.32	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
-	-	-	-	-

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

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

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	277,119.90	254,947.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	33,516.70	36,170.97
应支付基金管理人的净管理费	243,603.20	218,776.88

注：1) 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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$

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

2) 基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,423.98	50,989.49

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		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计

安信基金	-	104,898.61	104,898.61
国投证券	-	119.41	119.41
招商银行	-	9.05	9.05
合计	-	105,027.07	105,027.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	62,317.45	62,317.45
国投证券	-	351.60	351.60
招商银行	-	5.20	5.20
合计	-	62,674.25	62,674.25

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 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	7,192,950.91
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	-	7,192,950.91
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	15.78%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

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

份额单位：份

安信阿尔法定开混合 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
安信乾盛 财富管理 （深圳）有 限公司	22,702,279.25	49.79	22,702,279.25	48.35

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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 1 月 1 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	1,248,929.03	4,935.15	1,353,614.29	5,946.69

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 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	-

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

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

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：无）。

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	1,248,929.03	-	-	-	1,248,929.03
结算备付金	2,164,988.68	-	-	-	2,164,988.68
存出保证金	4,866,406.91	-	-	-	4,866,406.91
交易性金融资产	-	-	-	42,176,343.64	42,176,343.64
应收清算款	-	-	-	1,915,413.19	1,915,413.19
资产总计	8,280,324.62	-	-	44,091,756.83	52,372,081.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,893.76	45,893.76
应付托管费	-	-	-	9,178.76	9,178.76
应付销售服务费	-	-	-	20,422.82	20,422.82
其他负债	-	-	-	135,655.30	135,655.30
负债总计	-	-	-	211,150.64	211,150.64
利率敏感度缺口	8,280,324.62	-	-	43,880,606.19	52,160,930.81
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	4,187,443.70	-	-	-	4,187,443.70
结算备付金	2,038,131.90	-	-	-	2,038,131.90
存出保证金	4,827,751.16	-	-	-	4,827,751.16
交易性金融资产	-	-	-	40,472,713.37	40,472,713.37
应收清算款	-	-	-	1,482,747.01	1,482,747.01

资产总计	11,053,326.76	-	-	41,955,460.38	53,008,787.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	43,533.11	43,533.11
应付托管费	-	-	-	8,706.62	8,706.62
应付销售服务费	-	-	-	18,415.08	18,415.08
其他负债	-	-	-	70,410.80	70,410.80
负债总计	-	-	-	141,065.61	141,065.61
利率敏感度缺口	11,053,326.76	-	-	41,814,394.77	52,867,721.53

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。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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	42,176,343.64	80.86	40,472,713.37	76.55
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	42,176,343.64	80.86	40,472,713.37	76.55

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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%	2,511,663.87	2,061,688.58
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-2,511,663.87	-2,061,688.58

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	42,166,233.64	40,181,116.37
第二层次	10,110.00	291,597.00
第三层次	—	—
合计	42,176,343.64	40,472,713.37

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	42,176,343.64	80.53
	其中：股票	42,176,343.64	80.53
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	3,413,917.71	6.52
8	其他各项资产	6,781,820.10	12.95
9	合计	52,372,081.45	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	5,627.00	0.01
B	采矿业	2,680,729.38	5.14
C	制造业	27,269,095.12	52.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	335,893.00	0.64
E	建筑业	230,509.00	0.44
F	批发和零售业	249,084.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,306,081.00	2.50
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,430,139.86	4.66
J	金融业	6,061,826.00	11.62
K	房地产业	229,612.00	0.44
L	租赁和商务服务业	572,764.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	498,040.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	306,943.28	0.59
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	42,176,343.64	80.86

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	300308	中际旭创	1,800	2,286,000.00	4.38
2	300750	宁德时代	4,400	1,729,244.00	3.32
3	300502	新易盛	1,440	874,080.00	1.68
4	601899	紫金矿业	32,700	822,078.00	1.58
5	601318	中国平安	17,000	811,580.00	1.56
6	002475	立讯精密	10,800	760,320.00	1.46
7	688256	寒武纪	446	711,615.30	1.36
8	600519	贵州茅台	600	711,294.00	1.36
9	002384	东山精密	2,600	682,110.00	1.31
10	601138	工业富联	8,900	642,135.00	1.23
11	601398	工商银行	79,000	558,530.00	1.07
12	603259	药明康德	4,000	498,040.00	0.95
13	603986	兆易创新	600	489,000.00	0.94
14	600150	中国船舶	12,900	435,891.00	0.84
15	688521	芯原股份	1,174	435,718.36	0.84
16	300408	三环集团	2,600	433,940.00	0.83
17	000338	潍柴动力	15,700	427,825.00	0.82
18	600887	伊利股份	17,400	416,904.00	0.80
19	002415	海康威视	11,800	403,560.00	0.77
20	600309	万华化学	5,700	389,937.00	0.75
21	601211	国泰海通	20,800	378,560.00	0.73
22	000100	TCL 科技	61,600	358,512.00	0.69
23	600016	民生银行	111,300	358,386.00	0.69
24	601328	交通银行	55,100	354,293.00	0.68
25	301308	江波龙	500	351,900.00	0.67
26	601601	中国太保	12,100	345,092.00	0.66
27	601658	邮储银行	68,000	335,240.00	0.64
28	002460	赣锋锂业	4,900	320,460.00	0.61
29	000938	紫光股份	11,100	320,346.00	0.61
30	601225	陕西煤业	15,700	319,495.00	0.61
31	601688	华泰证券	15,300	315,486.00	0.60
32	603799	华友钴业	6,500	313,690.00	0.60
33	002466	天齐锂业	5,000	306,600.00	0.59
34	688396	华润微	3,059	298,405.45	0.57
35	600000	浦发银行	34,100	293,601.00	0.56
36	688981	中芯国际	1,830	290,640.60	0.56
37	601766	中国中车	55,800	290,160.00	0.56

38	000425	徐工机械	35,800	289,622.00	0.56
39	605117	德业股份	2,660	282,438.80	0.54
40	600489	中金黄金	15,600	281,580.00	0.54
41	600104	上汽集团	28,200	275,232.00	0.53
42	600875	东方电气	9,500	273,315.00	0.52
43	601100	恒立液压	2,500	268,900.00	0.52
44	600893	航发动力	6,900	264,546.00	0.51
45	601818	光大银行	91,000	262,990.00	0.50
46	002558	巨人网络	9,500	261,820.00	0.50
47	002027	分众传媒	53,400	258,456.00	0.50
48	000301	东方盛虹	22,400	256,480.00	0.49
49	002648	卫星化学	10,900	256,041.00	0.49
50	002236	大华股份	15,400	253,946.00	0.49
51	600019	宝钢股份	46,300	251,409.00	0.48
52	600346	恒力石化	14,100	249,711.00	0.48
53	002532	天山铝业	23,200	248,936.00	0.48
54	002493	荣盛石化	23,000	247,250.00	0.47
55	600570	恒生电子	11,600	245,804.00	0.47
56	000975	山金国际	14,400	244,800.00	0.47
57	600026	中远海能	13,600	243,984.00	0.47
58	600188	兖矿能源	13,700	243,449.00	0.47
59	000333	美的集团	3,200	241,696.00	0.46
60	600196	复星医药	10,700	240,429.00	0.46
61	000157	中联重科	34,400	239,768.00	0.46
62	002001	新 和 成	8,400	238,728.00	0.46
63	688620	安凯微	14,714	238,366.80	0.46
64	600115	中国东航	62,500	238,125.00	0.46
65	002709	天赐材料	4,600	236,578.00	0.45
66	600233	圆通速递	15,000	236,250.00	0.45
67	601872	招商轮船	13,400	235,438.00	0.45
68	600515	海南机场	83,800	229,612.00	0.44
69	601988	中国银行	40,100	229,372.00	0.44
70	688472	阿特斯	21,177	229,135.14	0.44
71	601668	中国建筑	52,700	228,718.00	0.44
72	601998	中信银行	32,800	227,304.00	0.44
73	600372	中航机载	20,900	226,765.00	0.43
74	003816	中国广核	57,000	222,870.00	0.43
75	600426	华鲁恒升	9,200	220,064.00	0.42
76	301536	星辰科技	1,700	218,807.00	0.42
77	601898	中煤能源	17,891	217,912.38	0.42
78	600989	宝丰能源	10,700	217,531.00	0.42
79	300033	同花顺	900	216,900.00	0.42
80	688047	龙芯中科	1,392	215,300.64	0.41

81	002402	和而泰	8,300	214,389.00	0.41
82	300014	亿纬锂能	3,200	208,096.00	0.40
83	603703	盛洋科技	18,700	207,570.00	0.40
84	601600	中国铝业	25,100	206,322.00	0.40
85	601888	中国中免	3,800	204,098.00	0.39
86	300857	协创数据	600	203,940.00	0.39
87	605196	华通线缆	7,800	203,580.00	0.39
88	688775	影石创新	1,462	202,706.30	0.39
89	300661	圣邦股份	1,400	200,872.00	0.39
90	000617	中油资本	30,400	200,336.00	0.38
91	002266	浙富控股	39,100	197,846.00	0.38
92	002049	紫光国微	2,200	195,250.00	0.37
93	002602	世纪华通	13,600	191,760.00	0.37
94	600018	上港集团	40,200	189,744.00	0.36
95	688653	康希通信	10,864	188,816.32	0.36
96	301012	扬电科技	8,000	187,920.00	0.36
97	000807	云铝股份	8,300	183,762.00	0.35
98	601231	环旭电子	5,600	181,440.00	0.35
99	002371	北方华创	200	176,912.00	0.34
100	002074	国轩高科	6,400	176,064.00	0.34
101	600050	中国联通	44,000	176,000.00	0.34
102	600015	华夏银行	27,500	175,725.00	0.34
103	002028	思源电气	1,000	173,000.00	0.33
104	688036	传音控股	2,927	172,546.65	0.33
105	601058	赛轮轮胎	14,800	170,644.00	0.33
106	600418	江淮汽车	6,300	162,729.00	0.31
107	601018	宁波港	51,600	162,540.00	0.31
108	688012	中微公司	339	158,821.50	0.30
109	002736	国信证券	15,400	153,846.00	0.29
110	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.29
111	300803	指南针	1,600	146,672.00	0.28
112	603121	华培动力	12,200	143,350.00	0.27
113	600499	科达制造	9,700	133,860.00	0.26
114	600938	中国海油	4,900	133,035.00	0.26
115	300055	万邦达	20,300	130,529.00	0.25
116	000708	中信特钢	10,300	129,986.00	0.25
117	688239	航宇科技	2,146	128,395.18	0.25
118	600845	宝信软件	7,700	128,051.00	0.25
119	601939	建设银行	12,900	124,227.00	0.24
120	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.24
121	600919	江苏银行	11,300	121,814.00	0.23
122	601166	兴业银行	7,200	119,232.00	0.23
123	600547	山东黄金	5,100	117,759.00	0.23

124	688469	芯联集成	10,836	114,969.96	0.22
125	002115	三维通信	10,700	110,210.00	0.21
126	002064	华峰化学	11,600	110,084.00	0.21
127	300582	英飞特	9,000	109,620.00	0.21
128	603239	浙江仙通	7,400	109,594.00	0.21
129	688679	通源环境	2,592	109,097.28	0.21
130	002865	钧达股份	1,800	107,424.00	0.21
131	301662	宏工科技	1,055	106,892.60	0.20
132	002369	卓翼科技	19,300	104,799.00	0.20
133	688778	厦钨新能	1,846	100,422.40	0.19
134	601061	中信金属	9,200	99,084.00	0.19
135	688215	瑞晟智能	2,392	96,062.72	0.18
136	300590	移为通信	6,600	94,710.00	0.18
137	002922	伊戈尔	2,600	85,280.00	0.16
138	600031	三一重工	4,900	84,672.00	0.16
139	300442	润泽科技	1,000	83,070.00	0.16
140	600028	中国石化	18,000	80,280.00	0.15
141	601857	中国石油	9,200	79,856.00	0.15
142	601127	赛力斯	1,300	79,625.00	0.15
143	300919	中伟新材	1,800	78,750.00	0.15
144	600690	海尔智家	3,800	77,558.00	0.15
145	601360	三六零	8,900	77,341.00	0.15
146	002241	歌尔股份	3,400	76,602.00	0.15
147	300647	超频三	12,800	76,160.00	0.15
148	688041	海光信息	200	74,060.00	0.14
149	300999	金龙鱼	3,100	72,106.00	0.14
150	688175	高凌信息	2,794	70,269.10	0.13
151	300450	先导智能	1,700	69,224.00	0.13
152	600900	长江电力	2,600	68,822.00	0.13
153	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.13
154	002142	宁波银行	2,100	62,349.00	0.12
155	601995	中金公司	1,600	57,840.00	0.11
156	603685	晨丰科技	2,000	57,000.00	0.11
157	601169	北京银行	11,100	54,390.00	0.10
158	603920	世运电路	1,100	52,844.00	0.10
159	688615	合合信息	460	52,026.00	0.10
160	601881	中国银河	4,100	51,537.00	0.10
161	000895	双汇发展	2,300	51,520.00	0.10
162	601699	潞安环能	3,500	49,980.00	0.10
163	600362	江西铜业	1,100	47,630.00	0.09
164	600815	厦工股份	18,200	46,774.00	0.09
165	600741	华域汽车	3,000	46,560.00	0.09
166	000603	盛达资源	2,000	46,200.00	0.09

167	002017	东信和平	3,000	43,890.00	0.08
168	688195	腾景科技	223	42,945.34	0.08
169	600999	招商证券	2,000	42,200.00	0.08
170	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.08
171	301391	卡莱特	700	39,970.00	0.08
172	600482	中国动力	1,200	39,360.00	0.08
173	601088	中国神华	1,000	39,040.00	0.07
174	603928	兴业股份	2,580	38,184.00	0.07
175	688095	福昕软件	640	38,035.20	0.07
176	000166	申万宏源	7,900	34,760.00	0.07
177	600795	国电电力	7,300	34,091.00	0.07
178	605388	均瑶健康	5,900	28,497.00	0.05
179	002329	皇氏集团	10,600	28,302.00	0.05
180	000977	浪潮信息	400	28,000.00	0.05
181	002660	茂硕电源	4,100	26,650.00	0.05
182	600148	长春一东	1,700	24,667.00	0.05
183	300389	艾比森	1,900	24,358.00	0.05
184	002414	高德红外	1,800	23,868.00	0.05
185	688683	莱尔科技	611	23,169.12	0.04
186	601788	光大证券	1,600	23,088.00	0.04
187	300098	高新兴	4,600	21,114.00	0.04
188	601238	广汽集团	4,000	20,320.00	0.04
189	300628	亿联网络	600	20,292.00	0.04
190	600801	华新建材	1,300	20,280.00	0.04
191	603381	永臻股份	1,300	20,033.00	0.04
192	300270	中威电子	1,500	19,515.00	0.04
193	603421	鼎信通讯	3,100	19,065.00	0.04
194	301181	标榜股份	800	18,512.00	0.04
195	688223	晶科能源	3,514	16,691.50	0.03
196	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.03
197	301358	湖南裕能	200	15,174.00	0.03
198	000725	京东方 A	1,700	14,756.00	0.03
199	603933	睿能科技	600	13,530.00	0.03
200	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.02
201	002054	德美化工	1,700	11,305.00	0.02
202	002518	科士达	200	10,718.00	0.02
203	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02
204	601728	中国电信	1,500	7,785.00	0.01
205	300269	联建光电	1,400	7,714.00	0.01
206	300587	天铁科技	1,700	6,545.00	0.01
207	601059	信达证券	400	6,476.00	0.01
208	301122	采纳股份	200	5,882.00	0.01
209	600540	新赛股份	1,700	5,627.00	0.01

210	603993	洛阳钼业	300	5,265.00	0.01
211	300906	日月明	100	2,493.00	0.00
212	603030	全筑股份	900	1,791.00	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	300308	中际旭创	2,706,722.00	5.12
2	603986	兆易创新	1,430,531.00	2.71
3	300502	新易盛	1,401,248.00	2.65
4	688256	寒武纪	1,207,369.74	2.28
5	300750	宁德时代	1,136,944.00	2.15
6	002475	立讯精密	982,654.00	1.86
7	600519	贵州茅台	964,407.00	1.82
8	601138	工业富联	933,876.00	1.77
9	688981	中芯国际	932,685.81	1.76
10	603993	洛阳钼业	925,468.00	1.75
11	603799	华友钴业	910,687.00	1.72
12	601225	陕西煤业	900,171.00	1.70
13	601899	紫金矿业	889,262.00	1.68
14	688209	英集芯	885,362.58	1.67
15	600150	中国船舶	869,388.00	1.64
16	688008	澜起科技	860,911.60	1.63
17	600016	民生银行	820,121.00	1.55
18	300274	阳光电源	811,273.00	1.53
19	002384	东山精密	783,983.00	1.48
20	688653	康希通信	766,329.73	1.45

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	300308	中际旭创	2,450,877.00	4.64
2	603986	兆易创新	2,140,189.00	4.05
3	300502	新易盛	1,480,146.00	2.80
4	603993	洛阳钼业	1,249,050.00	2.36
5	300750	宁德时代	1,199,579.00	2.27
6	000333	美的集团	1,165,768.00	2.21

7	688008	澜起科技	1,147,210.56	2.17
8	601166	兴业银行	1,096,031.00	2.07
9	600519	贵州茅台	1,092,514.00	2.07
10	600176	中国巨石	1,008,632.00	1.91
11	002916	深南电路	988,527.00	1.87
12	601899	紫金矿业	947,706.00	1.79
13	601138	工业富联	922,718.00	1.75
14	603296	华勤技术	880,741.00	1.67
15	688209	英集芯	874,719.98	1.65
16	000725	京东方 A	836,833.00	1.58
17	300274	阳光电源	830,691.00	1.57
18	600183	生益科技	827,389.00	1.57
19	688256	寒武纪	791,824.84	1.50
20	002938	鹏鼎控股	788,519.00	1.49

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	166,935,397.88
卖出股票收入（成交）总额	170,023,731.81

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

现阶段本基金主要使用股指期货对冲市场系统性风险。基金经理根据对冲比率、期现市场相

关性等因素，计算需要对冲的股指期货合约手数，并对风险敞口进行实时跟踪与动态调整。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 42,176,343.64 元，占基金资产净值的比例为 80.86%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 40,393,560.00 元，占基金资产净值的比例为 77.44%，空头合约市值占股票资产的比例为 95.77%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 2,896,709.08 元，公允价值变动损益为-1,875,396.08 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，立讯精密工业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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	4,866,406.91
2	应收清算款	1,915,413.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,781,820.10

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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 (%)
安信阿尔法 法定开混合 A	688	16,678.20	429.57	0.00	11,474,171.28	100.00
安信阿尔法 法定开混合 C	264	129,240.06	31,214,607.41	91.49	2,904,767.73	8.51
合计	937	48,659.53	31,215,036.98	68.46	14,378,939.01	31.54

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

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	83.36

8.3 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	安信阿尔法定开混合 A	83,736.82	0.73
	安信阿尔法定开混合 C	-	-

	合计	83,736.82	0.18
--	----	-----------	------

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）。

8.4 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	安信阿尔法定开混合 A	0~10
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	0~10
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	0~10

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	10,298,649.48	-
本报告期期初基金份额总额	12,194,305.14	34,754,982.64
本报告期基金总申购份额	1,373,293.06	6,334,047.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,092,997.35	6,969,654.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,474,600.85	34,119,375.14

§ 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 (%)	
东方财富证券	2	205,657,171.89	61.04	93,780.42	61.32	-
广发证券	2	49,387,080.03	14.66	22,520.55	14.73	-
东方证券	2	24,019,480.08	7.13	10,952.69	7.16	-

华源证券	2	19,911,551.10	5.91	9,079.84	5.94	—
长江证券	2	19,331,555.50	5.74	8,815.35	5.76	—
天风证券	2	12,646,115.51	3.75	5,766.71	3.77	—
国投证券	3	5,992,525.58	1.78	2,013.42	1.32	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
山西证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	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。

本报告期本基金新增券商交易单元：天风证券、广发证券、兴业证券。

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 (%)
东方财富证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
财通证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—

山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2026 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2026 年 3 月 10 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	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2026 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2026 年 6 月 9 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）

机构	1	20260101-20260630	22,702,279.25	-	-	22,702,279.25	49.79
----	---	-------------------	---------------	---	---	---------------	-------

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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