

安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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	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	11
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	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	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	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	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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53

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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	58
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	安信中证 500 指数增强	
基金主代码	005965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 29 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,535,451.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005965	005966
报告期末下属分级基金的份额总额	5,715,857.05 份	6,819,594.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。量化增强策略主要采用超额收益模型、风险模型和成本模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。在股指期货投资方面，将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。在债券投资方面，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期，进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。此外，本基金还将采用资产配置策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理

	人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王卫峰	柴飞犇
	联系电话	0755-82509999	0574-81851181
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		4008-088-088	0574-83895886
传真		0755-82799292	0574-89103213
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		518026	315100
法定代表人		刘入领	庄灵君

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)	
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	1,655,447.75	1,487,358.22
本期利润	2,368,740.21	2,107,262.08
加权平均基金份额本期利润	0.4720	0.4666

本期加权平均净值利润率	18.65%	18.73%
本期基金份额净值增长率	21.94%	21.69%
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	8,793,344.22	9,927,533.00
期末可供分配基金份额利润	1.5384	1.4557
期末基金资产净值	16,089,559.61	18,617,943.25
期末基金份额净值	2.8149	2.7301
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	181.49%	173.01%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.75%	1.59%	17.61%	1.56%	3.14%	0.03%
过去六个月	21.94%	1.56%	19.93%	1.58%	2.01%	-0.02%
过去一年	51.37%	1.32%	49.68%	1.35%	1.69%	-0.03%
过去三年	57.29%	1.26%	48.15%	1.41%	9.14%	-0.15%
过去五年	42.78%	1.19%	31.61%	1.30%	11.17%	-0.11%
过去七年	144.65%	1.23%	78.59%	1.29%	66.06%	-0.06%
自基金合同生效起至今	181.49%	1.24%	98.18%	1.32%	83.31%	-0.08%

安信中证 500 指数增强 C

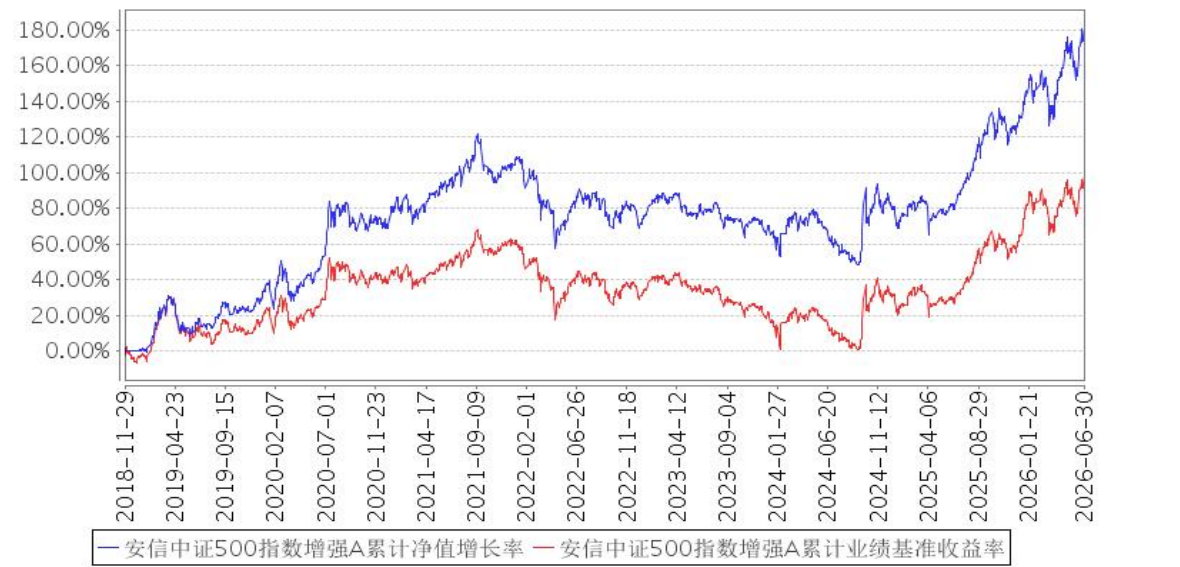
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.64%	1.59%	17.61%	1.56%	3.03%	0.03%
过去六个月	21.69%	1.56%	19.93%	1.58%	1.76%	-0.02%
过去一年	50.73%	1.32%	49.68%	1.35%	1.05%	-0.03%
过去三年	55.38%	1.26%	48.15%	1.41%	7.23%	-0.15%
过去五年	39.93%	1.19%	31.61%	1.30%	8.32%	-0.11%
过去七年	137.86%	1.23%	78.59%	1.29%	59.27%	-0.06%
自基金合同生效起至今	173.01%	1.24%	98.18%	1.32%	74.83%	-0.08%

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 11 月 29 日。

2、本基金合同约定，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	2021 年 12 月 31 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。
--	--	--	--	--	-------------------

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，中国经济在延续的稳增长政策支持下，总体保持平稳运行与温和复苏态势，其中二季度增速较一季度小幅提升。驱动经济修复的核心动力来自高技术产业的持续领先发展以及促消费、扩投资等宏观政策的协同发力，高技术制造、装备制造、信息技术服务等新质生产力相关领域继续较快扩张，成为稳定经济增长和改善增长质量的重要力量，在工业生产、投资、出口等领域带动经济结构优化与外贸结构升级，尤其对新兴市场出口占比显著提高，机电产品、高

新技术产品出口保持较强韧性。同时，政策驱动的设备更新与消费刺激为制造业韧性与消费温和回暖提供支撑，货币环境维持适度宽松，更强调通过结构性工具和财政协同支持重点领域。不过，经济运行也面临诸多挑战：内需修复仍不均衡，居民消费意愿、房地产链条和部分传统投资需求偏弱，传统行业仍处在去产能、调结构和修复盈利的过程中；工业品价格在大宗商品波动、供需结构改善以及“反内卷”政策影响下有所修复，但居民端价格温和，说明需求尚未出现全面过热；外部环境变化极大，一季度美国、以色列与伊朗产生军事冲突，进而引发整个中东地区战争升级以及霍尔木兹海峡的封闭，后双方谈判过程极为曲折，造成原油、黄金、白银及多国权益市场远超历史平均水平的剧烈波动，二季度初美伊阶段性停火使全球能源供给压力较一季度明显减轻，大宗商品价格自高位回落，但地缘冲突、全球贸易摩擦和主要经济体政策变化对风险偏好仍形成扰动。总体来看，上半年宏观经济并非单纯依靠需求全面回升驱动，而是在高技术产业、先进制造和外贸韧性支撑下保持稳定，同时继续消化地产、消费和传统投资偏弱带来的压力，经济运行呈现稳中求进、结构优化的阶段性特征。

承接上述宏观格局，上半年权益市场呈现流动性充裕、波动加大、成长风格逐步确立主导的鲜明特征。一季度，市场在乐观情绪推动下上证指数保持多日连阳、多个指数持续创新高，展现市场的乐观情绪，后受美以与伊朗军事冲突冲击，全球各类资产剧烈波动，中国由于早已因石油安全缘故布局原油进口多元化，影响相比周边国家如日本、韩国等较小，但相比前期波动率依然有较大提升；市值风格方面，以中证 500 为代表的中盘股表现亮眼，微盘股涨幅突出，成长股与价值股分化不明显，红利相关及现金流相关的指数表现相对稳健、受外部冲击较小。进入二季度，随着美伊阶段性停火落地，市场风险偏好逐步修复，A 股表现出鲜明的成长占优和结构分化特征，市场风险偏好集中向科技成长方向倾斜，AI 算力、半导体、CPO、PCB、通信设备等方向反复活跃，科创 50、创业板指等成长风格指数显著跑赢主要宽基指数，多次成为指数上行的核心牵引；电子、通信等板块涨幅居前，但这种行情并非全面普涨，而是资金围绕少数高景气产业链集中定价。同时，AI 产业链在季内出现较大波动，部分交易日科技板块回撤明显，反映高拥挤度和高估值下的阶段性扰动，但主线地位并未被根本削弱。相较之下，微盘股和红利相关资产表现一般，成长主线吸引了活跃资金和融资资金，市场宽度不足时非主线小市值品种缺乏持续增量资金承接。以中证 500 为代表的中盘成长与制造业相关资产受益于产业升级和风险偏好修复，整体表现优于传统大盘价值风格，但内部同样呈现明显分化，AI、先进制造、电子通信和高端装备相关的方向是上涨的核心驱动因素。

本基金在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上，通过数量化模型进行投资组合优化。主要投资目标是运用量化多因子模型，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、分析师

预期，技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素构建相对基准有稳定超额收益的投资组合，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的。并根据开发的多指标体系灵活配置不同风格的量化选股策略，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 2.8149 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.94%；安信中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 2.7301 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.69%；同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

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，中国经济预计延续温和复苏态势，结构性分化进一步深化。支撑因素集中在新质生产力领域：AI 算力与半导体国产替代进程加快，高技术制造、装备制造与信息技术服务等新动能持续扩张；在深入整治“反内卷”式竞争、加快产能去化的政策背景下，部分行业供需矛盾有望缓解，工业品价格延续修复，带动企业利润改善；消费政策扩围与基建投资提速有望阶段性托底内需。同时需关注房地产链条能否企稳、居民消费意愿回升力度，以及地缘局势反复与全球贸易摩擦对外需及大宗商品价格的扰动。

资金与市场层面，下半年流动性有望维持合理充裕，货币政策更注重结构性工具与财政协同，外资对 A 股的配置预计随外部不确定性收敛而有所提升，尤其在业绩超预期、高股息及成长型较好的板块，有利于资本市场估值修复。风格上，在 AI 科技产业趋势与中盘成长基本面支撑下，成长风格或仍具相对优势，但经过前期上涨后部分科技板块拥挤度与估值已较快抬升，需警惕阶段性波动与风格再平衡风险；红利、现金流类资产在利率维持低位环境下仍具长期配置价值。

在下半年，我们将持续致力于优化和完善量化选股模型，以适应实际的宏观经济环境，并据此配置相应的量化投资策略。我们将特别关注那些具有高质量且有良好业绩的行业和公司，以期实现更为稳健的投资回报。

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

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金

合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,686,952.13	1,187,591.86
结算备付金		1,827.32	1,818.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	32,516,441.60	14,500,099.30
其中：股票投资		32,516,441.60	14,500,099.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		23,960.12	15,493.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		35,229,181.17	15,705,002.50
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		452,503.50	161,347.29
应付管理人报酬		22,676.99	10,254.35
应付托管费		2,834.63	1,281.83
应付销售服务费		6,650.40	1,862.38
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	37,012.79	6,818.59
负债合计		521,678.31	181,564.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,535,451.54	6,796,118.32
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	22,172,051.32	8,727,319.74
净资产合计		34,707,502.86	15,523,438.06
负债和净资产总计		35,229,181.17	15,705,002.50

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 12,535,451.54 份，其中安信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 5,715,857.05 份，基金份额净值 2.8149 元；安信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 6,819,594.49 份，基金份额净值 2.7301 元。

6.2 利润表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		4,604,789.74	1,828,162.41
1. 利息收入		5,239.52	10,421.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,239.52	10,421.84
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）		3,214,887.82	215,560.41

其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,007,683.42	-173,925.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,310.65	4,043.10
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	-	61,043.68
股利收益	6.4.7.15	202,893.75	324,398.74
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,333,196.32	1,597,267.86
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	51,466.08	4,912.30
减：二、营业总支出		128,787.45	203,642.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	94,647.37	137,508.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,830.92	17,188.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,309.16	48,724.59
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		-	220.77
8. 其他费用	6.4.7.19	-	-
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		4,476,002.29	1,624,519.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		4,476,002.29	1,624,519.61
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		4,476,002.29	1,624,519.61

6.3 净资产变动表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	6,796,118.32	-	8,727,319.74	15,523,438.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,796,118.32	-	8,727,319.74	15,523,438.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,739,333.22	-	13,444,731.58	19,184,064.80
（一）、综合收益总额	-	-	4,476,002.29	4,476,002.29
（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）	5,739,333.22	-	8,968,729.29	14,708,062.51
其中：1. 基金申购款	16,367,226.32	-	25,281,348.14	41,648,574.46
2. 基金赎回款	-10,627,893.10	-	-16,312,618.85	-26,940,511.95
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,535,451.54	-	22,172,051.32	34,707,502.86
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	21,589,666.23	-	15,978,397.25	37,568,063.48
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	21,589,666.23	-	15,978,397.25	37,568,063.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,196,526.58	-	-825,945.78	-4,022,472.36
(一)、综合收益总额	-	-	1,624,519.61	1,624,519.61
(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)	-3,196,526.58	-	-2,450,465.39	-5,646,991.97
其中：1. 基金申购款	885,514.30	-	664,601.19	1,550,115.49
2. 基金赎回款	-4,082,040.88	-	-3,115,066.58	-7,197,107.46
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	18,393,139.65	-	15,152,451.47	33,545,591.12

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	廖维坤	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2018 年 3 月 16 日下发的证监许可[2018]490 号文“关于准予安信中证

500 指数增强型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2018 年 9 月 14 日至 2018 年 11 月 27 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字 60962175_H14 号验资报告，经向中国证监会备案，《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 29 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 247,748,039.51 份，其中认购资金利息折合 9,517.36 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

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

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

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

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	469,817.51
等于：本金	469,731.03
加：应计利息	86.48
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	2,217,134.62
等于：本金	2,217,100.03
加：应计利息	34.59
减：坏账准备	-
合计	2,686,952.13

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		30,656,959.25	-	32,516,441.60	1,859,482.35
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	30,656,959.25	-	32,516,441.60	1,859,482.35

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	926.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,079.59
其中：交易所市场	36,079.59
银行间市场	-
应付利息	-
其他	7.20
合计	37,012.79

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

安信中证 500 指数增强 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	4,264,017.28	4,264,017.28
本期申购	4,777,138.44	4,777,138.44
本期赎回（以“-”号填列）	-3,325,298.67	-3,325,298.67

本期末	5,715,857.05	5,715,857.05
-----	--------------	--------------

安信中证 500 指数增强 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	2,532,101.04	2,532,101.04
本期申购	11,590,087.88	11,590,087.88
本期赎回（以“-”号填列）	-7,302,594.43	-7,302,594.43
本期末	6,819,594.49	6,819,594.49

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

安信中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,132,016.91	446,999.08	5,579,015.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,132,016.91	446,999.08	5,579,015.99
本期利润	1,655,447.75	713,292.46	2,368,740.21
本期基金份额交易产生的变动数	2,005,879.56	420,066.80	2,425,946.36
其中：基金申购款	6,710,231.69	913,288.87	7,623,520.56
基金赎回款	-4,704,352.13	-493,222.07	-5,197,574.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,793,344.22	1,580,358.34	10,373,702.56

安信中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,875,322.50	272,981.25	3,148,303.75
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,875,322.50	272,981.25	3,148,303.75
本期利润	1,487,358.22	619,903.86	2,107,262.08
本期基金份额交易产生的变动数	5,564,852.28	977,930.65	6,542,782.93
其中：基金申购款	15,534,352.91	2,123,474.67	17,657,827.58
基金赎回款	-9,969,500.63	-1,145,544.02	-11,115,044.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,927,533.00	1,870,815.76	11,798,348.76

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	1,489.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,741.17
结算备付金利息收入	9.15
其他	-
合计	5,239.52

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	164,312,614.57
减：卖出股票成本总额	161,133,781.10
减：交易费用	171,150.05
买卖股票差价收入	3,007,683.42

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	0.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,310.32
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	4,310.65

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	8,711.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,400.00

减：应计利息总额	0.33
减：交易费用	0.35
买卖债券差价收入	4,310.32

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	202,893.75
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	202,893.75

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	1,333,196.32
股票投资	1,333,196.32
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	1,333,196.32

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	46,067.62
基金转换费收入	5,398.46
合计	51,466.08

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

本报告期内本基金管理人承担了本基金的部分或全部审计费、信息披露费（如有）和银行间账户维护费（如有）。

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	342,129,541.65	100.00	188,710,680.94	100.00

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	67,057.52	100.00	36,079.59	100.00
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（%）
国投证券	36,987.69	100.00	15,647.09	100.00

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

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

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	94,647.37	137,508.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	42,494.31	27,955.16
应支付基金管理人的净管理费	52,153.06	109,553.69

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

$$H=E\times 0.80\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	11,830.92	17,188.59

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

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

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		
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	合计
安信基金	-	1.69	1.69
国投证券	-	693.10	693.10
宁波银行	-	383.94	383.94
合计	-	1,078.73	1,078.73
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	合计
安信基金	-	31,741.79	31,741.79
国投证券	-	1,830.95	1,830.95
宁波银行	-	411.60	411.60
合计	-	33,984.34	33,984.34

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 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 11	-	-

月 29 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
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
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日(2018 年 11 月 29 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	8, 922, 917. 51
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	-	8, 922, 917. 51
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	48. 51%

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 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
国投证券	2, 217, 134. 62	3, 741. 17	1, 384, 508. 45	6, 998. 29
宁波银行	469, 817. 51	1, 489. 20	521, 619. 42	1, 344. 68

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人宁波银行保管, 按约定利率计息。

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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	2,686,952.13	-	-	-	2,686,952.13
结算备付金	1,827.32	-	-	-	1,827.32
交易性金融资产	-	-	-	32,516,441.60	32,516,441.60
应收申购款	-	-	-	23,960.12	23,960.12
资产总计	2,688,779.45	-	-	32,540,401.72	35,229,181.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	452,503.50	452,503.50

应付管理人报酬	-	-	-	22,676.99	22,676.99
应付托管费	-	-	-	2,834.63	2,834.63
应付销售服务费	-	-	-	6,650.40	6,650.40
其他负债	-	-	-	37,012.79	37,012.79
负债总计	-	-	-	521,678.31	521,678.31
利率敏感度缺口	2,688,779.45	-	-	32,018,723.41	34,707,502.86
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	1,187,591.86	-	-	-	1,187,591.86
结算备付金	1,818.17	-	-	-	1,818.17
交易性金融资产	-	-	-	14,500,099.30	14,500,099.30
应收申购款	-	-	-	15,493.17	15,493.17
资产总计	1,189,410.03	-	-	14,515,592.47	15,705,002.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	161,347.29	161,347.29
应付管理人报酬	-	-	-	10,254.35	10,254.35
应付托管费	-	-	-	1,281.83	1,281.83
应付销售服务费	-	-	-	1,862.38	1,862.38
其他负债	-	-	-	6,818.59	6,818.59
负债总计	-	-	-	181,564.44	181,564.44
利率敏感度缺口	1,189,410.03	-	-	14,334,028.03	15,523,438.06

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。本基金投资于股票资产的比例占基金资产

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

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	32,516,441.60	93.69	14,500,099.30	93.41
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	32,516,441.60	93.69	14,500,099.30	93.41

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%	2,218,362.43	790,310.98
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-2,218,362.43	-790,310.98

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	32,516,441.60	14,500,099.30
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	32,516,441.60	14,500,099.30

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	32,516,441.60	92.30
	其中：股票	32,516,441.60	92.30
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	2,688,779.45	7.63
8	其他各项资产	23,960.12	0.07
9	合计	35,229,181.17	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	896,296.00	2.58
C	制造业	21,545,463.22	62.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	824,568.00	2.38
E	建筑业	309,380.00	0.89
F	批发和零售业	580,232.00	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	495,639.00	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,661,282.14	4.79
J	金融业	1,282,454.00	3.70
K	房地产业	38,988.00	0.11
L	租赁和商务服务业	258,690.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	351,336.00	1.01

N	水利、环境和公共设施管理业	661,724.00	1.91
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	126,077.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	29,032,129.36	83.65

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	-	-
C	制造业	2,435,380.24	7.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,810.00	0.16
E	建筑业	14,500.00	0.04
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	32,042.00	0.09
J	金融业	250,994.00	0.72
K	房地产业	267,062.00	0.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	429,524.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	3,484,312.24	10.04

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	300604	长川科技	1,800	614,556.00	1.77
2	300857	协创数据	1,800	611,820.00	1.76
3	688361	中科飞测	1,400	602,000.00	1.73
4	300475	香农芯创	1,800	540,000.00	1.56
5	300223	北京君正	2,000	497,800.00	1.43
6	300054	鼎龙股份	4,500	476,865.00	1.37
7	002851	麦格米特	2,700	451,386.00	1.30
8	601869	长飞光纤	800	436,720.00	1.26
9	300395	菲利华	3,200	427,936.00	1.23
10	600498	烽火通信	5,800	426,880.00	1.23
11	688469	芯联集成	40,200	426,522.00	1.23
12	688002	睿创微纳	2,700	417,663.00	1.20
13	002185	华天科技	18,500	412,735.00	1.19
14	301526	国际复材	8,700	406,029.00	1.17
15	001389	广合科技	1,600	379,600.00	1.09
16	688498	源杰科技	200	377,200.00	1.09
17	688052	纳芯微	1,300	374,803.00	1.08
18	688301	奕瑞科技	3,000	372,000.00	1.07
19	600392	盛和资源	12,200	363,194.00	1.05
20	300346	南大光电	3,900	361,335.00	1.04
21	600105	永鼎股份	5,300	357,644.00	1.03
22	002821	凯莱英	2,200	356,400.00	1.03
23	002273	水晶光电	10,000	354,800.00	1.02
24	300458	全志科技	8,880	350,404.80	1.01
25	600601	方正科技	24,500	339,080.00	0.98
26	300001	特锐德	8,900	336,687.00	0.97
27	301536	星辰科技	2,600	334,646.00	0.96
28	301377	鼎泰高科	600	330,540.00	0.95
29	300373	扬杰科技	2,100	330,183.00	0.95
30	300623	捷捷微电	7,200	323,928.00	0.93
31	300953	震裕科技	2,400	320,880.00	0.92
32	002025	航天电器	4,200	320,124.00	0.92
33	301358	湖南裕能	4,200	318,654.00	0.92
34	000060	中金岭南	41,600	314,912.00	0.91
35	600909	华安证券	28,000	311,080.00	0.90
36	000032	深桑达 A	12,400	309,380.00	0.89
37	002266	浙富控股	60,900	308,154.00	0.89
38	300012	华测检测	22,100	306,306.00	0.88

39	000783	长江证券	31,400	306,150.00	0.88
40	688187	时代电气	4,400	302,104.00	0.87
41	300432	富临精工	15,000	301,350.00	0.87
42	600497	驰宏锌锗	24,700	299,117.00	0.86
43	603345	安井食品	3,700	296,703.00	0.85
44	601000	唐山港	70,100	290,915.00	0.84
45	688018	乐鑫科技	2,260	289,099.20	0.83
46	000683	博源化工	50,100	288,576.00	0.83
47	688188	柏楚电子	2,666	284,462.20	0.82
48	002850	科达利	1,500	283,950.00	0.82
49	000951	中国重汽	14,500	282,895.00	0.82
50	001309	德明利	300	282,870.00	0.82
51	688563	航材股份	5,452	279,305.96	0.80
52	600711	盛屯矿业	25,400	278,638.00	0.80
53	002487	大金重工	4,800	278,256.00	0.80
54	688676	金盘科技	3,267	276,518.88	0.80
55	601665	齐鲁银行	47,400	273,498.00	0.79
56	000039	中集集团	33,600	272,496.00	0.79
57	001286	陕西能源	26,700	270,738.00	0.78
58	000932	华菱钢铁	76,900	266,843.00	0.77
59	000598	兴蓉环境	40,900	262,578.00	0.76
60	603833	欧派家居	8,700	261,957.00	0.75
61	600546	山煤国际	23,500	256,855.00	0.74
62	002624	完美世界	20,500	254,610.00	0.73
63	688582	芯动联科	3,900	253,500.00	0.73
64	600583	海油工程	50,200	252,506.00	0.73
65	002064	华峰化学	26,500	251,485.00	0.72
66	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.72
67	688266	泽璟制药	2,089	243,702.74	0.70
68	300919	中伟新材	5,500	240,625.00	0.69
69	603766	隆鑫通用	20,100	239,793.00	0.69
70	688019	安集科技	700	237,622.00	0.68
71	603816	顾家家居	10,600	237,016.00	0.68
72	600595	中孚实业	41,900	235,478.00	0.68
73	688561	奇安信	9,663	231,718.74	0.67
74	600153	建发股份	28,900	229,177.00	0.66
75	688617	惠泰医疗	1,239	224,952.84	0.65
76	600483	福能股份	20,900	212,971.00	0.61
77	601156	东航物流	12,700	204,724.00	0.59
78	600292	电投水电	16,900	203,476.00	0.59
79	600566	济川药业	9,100	201,929.00	0.58
80	688347	华虹宏力	500	168,150.00	0.48
81	600901	江苏金租	28,100	161,575.00	0.47

82	300140	节能环保	30,200	150,094.00	0.43
83	688220	翱捷科技	1,200	149,184.00	0.43
84	688120	华海清科	400	128,872.00	0.37
85	300567	精测电子	400	127,040.00	0.37
86	300144	宋城演艺	21,700	126,077.00	0.36
87	300748	金力永磁	3,700	114,145.00	0.33
88	002436	兴森科技	2,000	101,900.00	0.29
89	300073	当升科技	2,100	100,884.00	0.29
90	002008	大族激光	600	90,066.00	0.26
91	601108	财通证券	9,900	85,635.00	0.25
92	600109	国金证券	9,100	79,898.00	0.23
93	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.22
94	300570	太辰光	300	74,013.00	0.21
95	300136	信维通信	600	71,550.00	0.21
96	300002	神州泰岳	9,100	71,071.00	0.20
97	688343	云天励飞	800	65,328.00	0.19
98	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.18
99	002812	恩捷股份	800	53,528.00	0.15
100	688235	百济神州	200	50,922.00	0.15
101	002444	巨星科技	1,600	49,760.00	0.14
102	300957	贝泰妮	1,500	47,265.00	0.14
103	600642	申能股份	5,100	44,523.00	0.13
104	600295	鄂尔多斯	3,800	40,736.00	0.12
105	603650	彤程新材	400	39,192.00	0.11
106	300558	贝达药业	600	39,042.00	0.11
107	601155	新城控股	3,800	38,988.00	0.11
108	300454	深信服	400	38,480.00	0.11
109	600968	海油发展	11,300	37,629.00	0.11
110	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.10
111	601233	桐昆股份	1,500	32,475.00	0.09
112	600816	建元信托	13,300	32,452.00	0.09
113	002223	鱼跃医疗	1,200	30,792.00	0.09
114	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.09
115	002429	兆驰股份	2,900	30,131.00	0.09
116	301498	乖宝宠物	700	28,413.00	0.08
117	000733	振华科技	500	28,320.00	0.08
118	688166	博瑞医药	800	28,008.00	0.08
119	688248	南网科技	400	27,672.00	0.08
120	600299	安迪苏	3,400	26,690.00	0.08
121	688777	中控技术	200	23,500.00	0.07
122	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.07
123	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.06
124	601699	潞安环能	1,500	21,420.00	0.06

125	600879	航天电子	1,000	21,290.00	0.06
126	300285	国瓷材料	200	20,636.00	0.06
127	002683	广东宏大	700	20,503.00	0.06
128	600801	华新建材	1,300	20,280.00	0.06
129	600141	兴发集团	400	18,788.00	0.05
130	300017	网宿科技	1,400	18,214.00	0.05
131	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.05
132	002966	苏州银行	2,600	18,096.00	0.05
133	301611	珂玛科技	100	18,007.00	0.05
134	002738	中矿资源	300	17,697.00	0.05
135	300487	蓝晓科技	300	17,655.00	0.05
136	300759	康龙化成	600	17,358.00	0.05
137	000960	锡业股份	400	17,076.00	0.05
138	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.05
139	600060	海信视像	600	16,722.00	0.05
140	002601	龙佰集团	1,000	16,480.00	0.05
141	000893	亚钾国际	400	16,356.00	0.05
142	002131	利欧股份	3,300	15,675.00	0.05
143	001203	大中矿业	500	14,975.00	0.04
144	603156	养元饮品	300	14,721.00	0.04
145	000528	柳 工	1,900	14,345.00	0.04
146	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.04
147	600369	西南证券	3,500	14,070.00	0.04
148	000415	渤海租赁	3,400	13,838.00	0.04
149	600348	华阳股份	1,800	13,770.00	0.04
150	000883	湖北能源	3,100	13,392.00	0.04
151	002984	森麒麟	1,000	13,070.00	0.04
152	600008	首创环保	4,800	13,056.00	0.04
153	603308	应流股份	200	12,080.00	0.03
154	000878	云南铜业	700	11,116.00	0.03
155	601112	振石股份	600	10,938.00	0.03
156	002065	东华软件	1,400	9,996.00	0.03
157	300037	新宙邦	100	9,285.00	0.03
158	000537	绿发电力	1,000	7,310.00	0.02
159	000034	神州数码	200	5,550.00	0.02
160	000519	中兵红箭	200	4,214.00	0.01

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	600641	先导基电	6,700	267,062.00	0.77
2	688981	中芯国际	1,600	254,112.00	0.73
3	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.73

4	301371	敷尔佳	9,300	241,800.00	0.70
5	600030	中信证券	8,200	235,586.00	0.68
6	300478	杭州高新	6,200	227,478.00	0.66
7	688710	益诺思	3,200	215,040.00	0.62
8	300938	信测标准	4,300	214,484.00	0.62
9	300681	英搏尔	7,400	211,788.00	0.61
10	300606	金太阳	4,900	208,544.00	0.60
11	688388	嘉元科技	4,680	205,920.00	0.59
12	300502	新易盛	300	182,100.00	0.52
13	301227	森鹰窗业	7,000	176,470.00	0.51
14	688667	菱电电控	1,200	160,380.00	0.46
15	603223	恒通股份	4,200	54,810.00	0.16
16	688620	安凯微	3,100	50,220.00	0.14
17	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.12
18	300467	迅游科技	700	26,026.00	0.07
19	688511	天微电子	844	25,497.24	0.07
20	688323	瑞华泰	400	22,600.00	0.07
21	603186	华正新材	100	22,530.00	0.06
22	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.06
23	601939	建设银行	1,600	15,408.00	0.04
24	605289	罗曼股份	100	14,500.00	0.04
25	688199	久日新材	400	13,812.00	0.04
26	688609	九联科技	1,200	13,212.00	0.04
27	600888	新疆众和	800	12,712.00	0.04
28	301295	美硕科技	300	12,654.00	0.04
29	603519	立霸股份	800	12,240.00	0.04
30	301002	崧盛股份	300	11,580.00	0.03
31	300767	震安科技	500	11,145.00	0.03
32	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.03
33	301280	珠城科技	200	10,114.00	0.03
34	301045	天禄科技	100	8,908.00	0.03
35	603150	万朗磁塑	100	7,080.00	0.02
36	300277	汽轮科技	400	6,016.00	0.02
37	301122	采纳股份	200	5,882.00	0.02

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	300604	长川科技	1,213,300.00	7.82
2	688002	睿创微纳	1,206,177.36	7.77
3	300857	协创数据	1,127,469.00	7.26

4	300001	特锐德	1,025,894.00	6.61
5	600487	亨通光电	1,012,482.00	6.52
6	000426	兴业银锡	965,690.00	6.22
7	688777	中控技术	963,355.80	6.21
8	601168	西部矿业	961,105.00	6.19
9	600988	赤峰黄金	957,077.00	6.17
10	600497	驰宏锌锗	898,155.00	5.79
11	300136	信维通信	896,737.00	5.78
12	002532	天山铝业	889,257.00	5.73
13	601108	财通证券	888,032.00	5.72
14	001286	陕西能源	878,756.00	5.66
15	002558	巨人网络	866,903.00	5.58
16	300757	罗博特科	841,441.00	5.42
17	002008	大族激光	840,023.00	5.41
18	000039	中集集团	831,166.00	5.35
19	001389	广合科技	825,263.00	5.32
20	300223	北京君正	818,305.00	5.27
21	688361	中科飞测	811,196.20	5.23
22	603766	隆鑫通用	805,621.00	5.19
23	600498	烽火通信	801,763.00	5.16
24	300450	先导智能	797,294.00	5.14
25	301358	湖南裕能	793,977.00	5.11
26	688120	华海清科	788,424.00	5.08
27	300395	菲利华	781,120.00	5.03
28	000933	神火股份	762,767.00	4.91
29	300454	深信服	757,166.00	4.88
30	300919	中伟新材	751,275.00	4.84
31	688281	华秦科技	745,771.44	4.80
32	600392	盛和资源	744,668.00	4.80
33	688266	泽璟制药	742,166.88	4.78
34	002624	完美世界	737,826.00	4.75
35	300458	全志科技	737,662.00	4.75
36	002273	水晶光电	734,030.00	4.73
37	300054	鼎龙股份	721,024.00	4.64
38	002436	兴森科技	715,761.00	4.61
39	000960	锡业股份	714,119.00	4.60
40	000598	兴蓉环境	706,735.00	4.55
41	300751	迈为股份	706,203.00	4.55
42	300012	华测检测	704,689.00	4.54
43	300285	国瓷材料	704,662.00	4.54
44	688347	华虹宏力	704,265.02	4.54
45	688099	晶晨股份	689,781.10	4.44
46	600483	福能股份	689,038.80	4.44

47	601665	齐鲁银行	687,727.00	4.43
48	688385	复旦微电	681,608.99	4.39
49	002738	中矿资源	680,532.00	4.38
50	300487	蓝晓科技	679,733.00	4.38
51	688525	佰维存储	678,907.15	4.37
52	300373	扬杰科技	666,262.00	4.29
53	601555	东吴证券	662,754.00	4.27
54	688220	翱捷科技	661,286.74	4.26
55	688019	安集科技	649,695.00	4.19
56	002126	银轮股份	646,200.00	4.16
57	600601	方正科技	639,505.00	4.12
58	002271	东方雨虹	636,144.00	4.10
59	002064	华峰化学	635,370.00	4.09
60	002851	麦格米特	631,791.00	4.07
61	300567	精测电子	626,867.00	4.04
62	002821	凯莱英	625,221.00	4.03
63	000060	中金岭南	621,396.00	4.00
64	000987	越秀资本	619,742.00	3.99
65	300037	新宙邦	614,903.00	3.96
66	600549	厦门钨业	614,671.00	3.96
67	300548	长芯博创	610,580.00	3.93
68	001309	德明利	609,258.00	3.92
69	601869	长飞光纤	608,721.00	3.92
70	600141	兴发集团	603,556.00	3.89
71	688375	国博电子	602,422.63	3.88
72	600808	马钢股份	597,282.00	3.85
73	002185	华天科技	596,871.39	3.84
74	688563	航材股份	596,261.31	3.84
75	002128	电投能源	589,752.00	3.80
76	000932	华菱钢铁	588,558.00	3.79
77	002850	科达利	588,027.00	3.79
78	300003	乐普医疗	585,793.00	3.77
79	300748	金力永磁	584,708.00	3.77
80	300207	欣旺达	580,126.00	3.74
81	600673	东阳光	576,341.00	3.71
82	600282	南钢股份	575,067.00	3.70
83	600352	浙江龙盛	563,297.00	3.63
84	688676	金盘科技	563,164.83	3.63
85	688615	合合信息	562,745.00	3.63
86	002517	恺英网络	556,980.00	3.59
87	000683	博源化工	556,352.00	3.58
88	688301	奕瑞科技	551,959.00	3.56
89	002444	巨星科技	550,891.00	3.55

90	603225	新凤鸣	548,423.00	3.53
91	002080	中材科技	547,952.00	3.53
92	688188	柏楚电子	547,682.20	3.53
93	688322	奥比中光	544,925.80	3.51
94	688017	绿的谐波	544,026.72	3.50
95	688052	纳芯微	542,821.00	3.50
96	600583	海油工程	539,994.00	3.48
97	300073	当升科技	532,862.00	3.43
98	688018	乐鑫科技	532,292.60	3.43
99	688156	路德科技	532,101.96	3.43
100	000783	长江证券	531,795.00	3.43
101	688710	益诺思	525,941.82	3.39
102	002156	通富微电	524,308.00	3.38
103	688561	奇安信	524,239.94	3.38
104	300308	中际旭创	522,812.00	3.37
105	301308	江波龙	522,739.00	3.37
106	603345	安井食品	520,705.00	3.35
107	300432	富临精工	520,096.00	3.35
108	002281	光迅科技	516,567.00	3.33
109	002756	永兴材料	513,922.00	3.31
110	688578	艾力斯	512,108.68	3.30
111	603979	金诚信	511,438.00	3.29
112	301377	鼎泰高科	509,676.00	3.28
113	688772	珠海冠宇	508,097.58	3.27
114	600801	华新建材	504,553.00	3.25
115	603179	新泉股份	504,411.00	3.25
116	601000	唐山港	496,919.00	3.20
117	000951	中国重汽	490,912.00	3.16
118	688568	中科星图	489,926.98	3.16
119	688213	思特威	488,058.79	3.14
120	300677	英科医疗	485,201.00	3.13
121	601666	平煤股份	481,922.00	3.10
122	688096	京源环保	480,831.79	3.10
123	688235	百济神州	480,378.26	3.09
124	688192	迪哲医药	469,665.02	3.03
125	300346	南大光电	469,418.00	3.02
126	600105	永鼎股份	469,014.00	3.02
127	002409	雅克科技	466,411.00	3.00
128	600685	中船防务	458,367.00	2.95
129	300750	宁德时代	456,069.00	2.94
130	002837	英维克	454,309.00	2.93
131	002202	金风科技	447,976.00	2.89
132	688469	芯联集成	447,193.00	2.88

133	688180	君实生物	446,588.11	2.88
134	688027	国盾量子	442,234.57	2.85
135	002266	浙富控股	441,236.00	2.84
136	002155	湖南黄金	441,076.00	2.84
137	301526	国际复材	439,407.00	2.83
138	300017	网宿科技	438,686.00	2.83
139	601939	建设银行	434,990.00	2.80
140	600546	山煤国际	433,370.00	2.79
141	600879	航天电子	432,496.00	2.79
142	002078	太阳纸业	431,997.00	2.78
143	300502	新易盛	429,299.00	2.77
144	002152	广电运通	426,284.00	2.75
145	600909	华安证券	425,819.00	2.74
146	688599	天合光能	423,234.40	2.73
147	688981	中芯国际	420,418.00	2.71
148	300390	天华新能	419,780.00	2.70
149	600096	云天化	419,006.00	2.70
150	688778	厦钨新能	417,600.00	2.69
151	600153	建发股份	417,239.00	2.69
152	300146	汤臣倍健	417,067.00	2.69
153	000415	渤海租赁	416,042.00	2.68
154	688318	财富趋势	413,131.00	2.66
155	002025	航天电器	411,517.00	2.65
156	688122	西部超导	407,928.20	2.63
157	300474	景嘉微	400,738.00	2.58
158	300475	香农芯创	399,072.00	2.57
159	301536	星辰科技	395,962.00	2.55
160	002353	杰瑞股份	391,583.00	2.52
161	601615	明阳智能	387,984.00	2.50
162	002138	顺络电子	387,936.00	2.50
163	300623	捷捷微电	387,700.00	2.50
164	300496	中科创达	387,391.00	2.50
165	600711	盛屯矿业	386,549.00	2.49
166	688617	惠泰医疗	385,823.97	2.49
167	603606	东方电缆	385,074.00	2.48
168	601156	东航物流	384,449.00	2.48
169	688166	博瑞医药	383,083.20	2.47
170	605589	圣泉集团	382,528.00	2.46
171	688498	源杰科技	382,002.00	2.46
172	688248	南网科技	379,637.72	2.45
173	000034	神州数码	377,295.00	2.43
174	300274	阳光电源	375,948.00	2.42
175	300953	震裕科技	374,074.00	2.41

176	600985	淮北矿业	373,504.00	2.41
177	603659	璞泰来	370,027.00	2.38
178	688692	达梦数据	367,694.00	2.37
179	600499	科达制造	366,094.00	2.36
180	603833	欧派家居	365,452.00	2.35
181	300724	捷佳伟创	364,691.06	2.35
182	300957	贝泰妮	360,840.00	2.32
183	603816	顾家家居	359,767.00	2.32
184	603688	石英股份	359,312.00	2.31
185	600968	海油发展	356,289.00	2.30
186	600642	申能股份	355,129.00	2.29
187	600637	东方明珠	354,059.00	2.28
188	300699	光威复材	350,699.00	2.26
189	600901	江苏金租	349,932.00	2.25
190	603129	春风动力	348,962.00	2.25
191	688387	信科移动	346,407.82	2.23
192	300681	英搏尔	346,222.00	2.23
193	601233	桐昆股份	345,996.00	2.23
194	688065	凯赛生物	345,423.09	2.23
195	300570	太辰光	345,117.00	2.22
196	688582	芯动联科	342,341.00	2.21
197	000032	深桑达 A	341,491.00	2.20
198	603920	世运电路	340,788.00	2.20
199	600704	物产中大	340,302.00	2.19
200	603806	福斯特	338,302.00	2.18
201	002340	格林美	336,565.00	2.17
202	688702	盛科通信	334,757.00	2.16
203	600739	辽宁成大	325,390.00	2.10
204	688475	萤石网络	325,132.76	2.09
205	002487	大金重工	322,060.00	2.07
206	600816	建元信托	321,749.00	2.07
207	601155	新城控股	321,222.00	2.07
208	688313	仕佳光子	320,984.06	2.07
209	600166	福田汽车	320,648.00	2.07
210	601061	中信金属	319,566.00	2.06
211	688187	时代电气	319,417.00	2.06
212	600595	中孚实业	317,999.00	2.05
213	300763	锦浪科技	317,539.00	2.05
214	601918	新集能源	317,536.00	2.05
215	300972	万辰集团	317,299.00	2.04
216	688349	三一重能	314,612.32	2.03
217	601179	中国西电	314,486.00	2.03
218	000703	恒逸石化	314,033.00	2.02

219	605358	立昂微	313,225.00	2.02
220	600030	中信证券	311,851.00	2.01
221	301371	敷尔佳	311,048.00	2.00

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	600487	亨通光电	1,420,648.00	9.15
2	002532	天山铝业	1,128,552.00	7.27
3	600988	赤峰黄金	1,039,786.00	6.70
4	688777	中控技术	1,012,687.60	6.52
5	300604	长川科技	998,052.00	6.43
6	601168	西部矿业	993,657.00	6.40
7	002008	大族激光	969,961.00	6.25
8	000426	兴业银锡	969,266.00	6.24
9	688002	睿创微纳	956,065.08	6.16
10	300757	罗博特科	906,846.00	5.84
11	300285	国瓷材料	900,769.00	5.80
12	688347	华虹宏力	887,754.44	5.72
13	601108	财通证券	867,497.00	5.59
14	601555	东吴证券	863,826.00	5.56
15	002558	巨人网络	857,397.00	5.52
16	300136	信维通信	852,247.00	5.49
17	600549	厦门钨业	839,252.00	5.41
18	688525	佰维存储	801,136.68	5.16
19	002517	恺英网络	795,698.00	5.13
20	300857	协创数据	776,650.60	5.00
21	300487	蓝晓科技	775,442.00	5.00
22	300450	先导智能	764,960.00	4.93
23	603979	金诚信	760,515.00	4.90
24	300454	深信服	741,123.00	4.77
25	000933	神火股份	736,960.00	4.75
26	688281	华秦科技	731,952.38	4.72
27	300207	欣旺达	723,706.00	4.66
28	300001	特锐德	720,877.00	4.64
29	600497	驰宏锌锗	715,657.00	4.61
30	300751	迈为股份	714,495.00	4.60
31	000960	锡业股份	703,705.00	4.53
32	300373	扬杰科技	696,442.11	4.49
33	002436	兴森科技	686,079.00	4.42

34	000987	越秀资本	684,290.00	4.41
35	002126	银轮股份	684,281.00	4.41
36	002353	杰瑞股份	683,532.00	4.40
37	688120	华海清科	682,315.56	4.40
38	002155	湖南黄金	681,673.00	4.39
39	688385	复旦微电	673,001.51	4.34
40	688099	晶晨股份	656,089.25	4.23
41	300037	新宙邦	648,638.00	4.18
42	301358	湖南裕能	648,498.00	4.18
43	300054	鼎龙股份	648,382.00	4.18
44	688220	翱捷科技	634,487.50	4.09
45	600673	东阳光	631,044.00	4.07
46	300567	精测电子	626,904.00	4.04
47	002271	东方雨虹	622,544.00	4.01
48	002138	顺络电子	620,609.00	4.00
49	688017	绿的谐波	620,444.33	4.00
50	688375	国博电子	619,400.83	3.99
51	688322	奥比中光	619,295.04	3.99
52	301308	江波龙	618,732.00	3.99
53	002444	巨星科技	618,173.00	3.98
54	001286	陕西能源	616,727.00	3.97
55	300003	乐普医疗	615,437.00	3.96
56	600282	南钢股份	610,266.00	3.93
57	002738	中矿资源	608,428.00	3.92
58	001389	广合科技	608,318.00	3.92
59	002080	中材科技	599,671.00	3.86
60	002273	水晶光电	597,360.00	3.85
61	002128	电投能源	595,367.00	3.84
62	600141	兴发集团	592,450.00	3.82
63	603179	新泉股份	590,969.60	3.81
64	002156	通富微电	590,468.00	3.80
65	688266	泽璟制药	588,368.54	3.79
66	002756	永兴材料	585,548.00	3.77
67	688183	生益电子	580,735.55	3.74
68	600352	浙江龙盛	574,527.00	3.70
69	300223	北京君正	569,422.00	3.67
70	688361	中科飞测	567,960.76	3.66
71	002281	光迅科技	566,505.00	3.65
72	600808	马钢股份	559,214.00	3.60
73	002078	太阳纸业	557,097.00	3.59
74	603225	新凤鸣	554,106.00	3.57
75	601665	齐鲁银行	543,713.00	3.50
76	002409	雅克科技	539,334.00	3.47

77	688615	合合信息	531,108.60	3.42
78	688772	珠海冠宇	530,749.74	3.42
79	603129	春风动力	529,872.00	3.41
80	300012	华测检测	527,233.00	3.40
81	688156	路德科技	523,471.59	3.37
82	603766	隆鑫通用	523,366.00	3.37
83	600483	福能股份	522,164.00	3.36
84	688096	京源环保	519,907.10	3.35
85	688213	思特威	511,207.98	3.29
86	300017	网宿科技	509,262.00	3.28
87	300677	英科医疗	502,484.00	3.24
88	688019	安集科技	500,549.20	3.22
89	002595	豪迈科技	499,369.00	3.22
90	000039	中集集团	499,107.00	3.22
91	688578	艾力斯	496,888.20	3.20
92	600801	华新建材	489,961.00	3.16
93	600998	九州通	482,978.00	3.11
94	000598	兴蓉环境	479,941.00	3.09
95	300919	中伟新材	479,600.00	3.09
96	688568	中科星图	479,016.00	3.09
97	002624	完美世界	478,967.00	3.09
98	002850	科达利	466,062.00	3.00
99	300496	中科创达	465,286.00	3.00
100	300750	宁德时代	463,863.00	2.99
101	002202	金风科技	463,773.00	2.99
102	601666	平煤股份	455,643.00	2.94
103	300724	捷佳伟创	452,985.00	2.92
104	605589	圣泉集团	451,264.00	2.91
105	688318	财富趋势	449,803.45	2.90
106	000783	长江证券	448,522.00	2.89
107	300390	天华新能	446,905.00	2.88
108	300748	金力永磁	444,346.00	2.86
109	688192	迪哲医药	444,335.95	2.86
110	688778	厦钨新能	442,375.00	2.85
111	300073	当升科技	432,089.00	2.78
112	002152	广电运通	425,684.00	2.74
113	001309	德明利	423,600.00	2.73
114	300395	菲利华	422,818.00	2.72
115	601939	建设银行	422,226.00	2.72
116	600909	华安证券	415,966.00	2.68
117	002837	英维克	413,863.40	2.67
118	300548	长芯博创	412,590.00	2.66
119	600685	中船防务	412,357.00	2.66

120	300474	景嘉微	410,839.00	2.65
121	300458	全志科技	409,872.00	2.64
122	688235	百济神州	408,339.00	2.63
123	688122	西部超导	403,327.00	2.60
124	688027	国盾量子	400,588.79	2.58
125	603688	石英股份	397,839.00	2.56
126	300146	汤臣倍健	396,693.00	2.56
127	603606	东方电缆	396,314.00	2.55
128	688702	盛科通信	396,296.00	2.55
129	603920	世运电路	394,454.00	2.54
130	603659	璞泰来	392,061.00	2.53
131	600985	淮北矿业	391,785.00	2.52
132	000728	国元证券	388,591.00	2.50
133	600096	云天化	384,090.00	2.47
134	600879	航天电子	378,048.00	2.44
135	000415	渤海租赁	377,136.00	2.43
136	688599	天合光能	375,805.24	2.42
137	600499	科达制造	374,896.00	2.42
138	605358	立昂微	374,440.00	2.41
139	603379	三美股份	371,936.00	2.40
140	601918	新集能源	371,244.00	2.39
141	688180	君实生物	370,847.78	2.39
142	600392	盛和资源	368,301.00	2.37
143	688065	凯赛生物	367,622.73	2.37
144	688234	天岳先进	367,387.00	2.37
145	688313	仕佳光子	364,880.00	2.35
146	300308	中际旭创	364,374.00	2.35
147	688248	南网科技	361,821.37	2.33
148	600498	烽火通信	361,422.00	2.33
149	688692	达梦数据	360,944.00	2.33
150	603228	景旺电子	360,004.00	2.32
151	600298	安琪酵母	357,448.00	2.30
152	688166	博瑞医药	356,433.04	2.30
153	601615	明阳智能	352,991.00	2.27
154	688188	柏楚电子	352,425.88	2.27
155	002064	华峰化学	349,568.00	2.25
156	600166	福田汽车	348,946.00	2.25
157	000528	柳 工	345,762.00	2.23
158	601717	中创智领	345,350.67	2.22
159	688387	信科移动	343,649.46	2.21
160	000034	神州数码	342,187.80	2.20
161	002831	裕同科技	341,951.00	2.20
162	601061	中信金属	339,809.00	2.19

163	600704	物产中大	339,130.00	2.18
164	600583	海油工程	337,760.00	2.18
165	603806	福斯特	336,638.00	2.17
166	600968	海油发展	335,013.00	2.16
167	600637	东方明珠	332,869.00	2.14
168	600060	海信视像	332,005.00	2.14
169	300274	阳光电源	331,249.00	2.13
170	300699	光威复材	326,909.00	2.11
171	000988	华工科技	325,444.00	2.10
172	688475	萤石网络	324,046.21	2.09
173	600739	辽宁成大	322,917.00	2.08
174	002414	高德红外	322,209.00	2.08
175	000932	华菱钢铁	320,959.00	2.07
176	600642	申能股份	318,350.00	2.05
177	600563	法拉电子	314,491.00	2.03
178	000703	恒逸石化	314,008.00	2.02
179	603345	安井食品	313,902.00	2.02
180	601233	桐昆股份	312,853.00	2.02
181	000967	盈峰环境	311,622.00	2.01
182	600312	平高电气	310,811.00	2.00
183	600143	金发科技	310,548.00	2.00

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	177,816,927.08
卖出股票收入（成交）总额	164,312,614.57

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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	23,960.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,960.12

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 (%)
安信中证 500 指 数 增强 A	974	5,868.44	0.00	0.00	5,715,857.05	100. 00
安信中证	562	12,134.51	105.56	0.00	6,819,488.93	100.

500 指 数 增强 C						00
合计	1, 503	8, 340. 29	105. 56	0. 00	12, 535, 345. 98	100. 00

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	安信中证 500 指数增强 A	7, 056. 39	0. 12
	安信中证 500 指数增强 C	-	-
	合计	7, 056. 39	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	安信中证 500 指数增强 A	0
	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	安信中证 500 指数增强 A	0
	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 29 日）基金份额总额	451, 841. 35	247, 296, 198. 16
本报告期期初基金份额总额	4, 264, 017. 28	2, 532, 101. 04
本报告期基金总申购份额	4, 777, 138. 44	11, 590, 087. 88
减：本报告期基金总赎回份额	3, 325, 298. 67	7, 302, 594. 43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5, 715, 857. 05	6, 819, 594. 49

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金托管人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稽查或处罚。

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，基金托管人未有受调查或处罚等情况。

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未有受调查或处罚等情况。

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 (%)	
国投证券	2	342,129,541.65	100.00	67,057.52	100.00	-
东方财富证券	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 (%)
国投证券	8,711.00	100.00	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

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 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

	告	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

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（%）
个人	1	20260206-20260227	-	2,123,322.58	2,123,322.58	-	-
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）基金在短期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中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件；

- 2、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

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