

安信成长动力一年持有期混合型证券投资 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	安信成长动力一年持有混合
基金主代码	009880
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 13 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,394,884.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以细致深入的上市公司基本面研究作为基础，重点投资于质地优秀且未来预期成长性良好的上市公司，在充分控制风险和保证流动性的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置方面，本基金将基于各项重要的经济指标分析宏观经济趋势，结合货币财政政策形势、行业发展状况、证券市场走势等综合分析，主动判断所处经济周期和市场时机，进行积极的资产配置。本基金将根据各类资产风险收益特征的相对变化，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资方面，本基金将重点关注在行业内的竞争优势明显且具备较好成长性的上市公司，本基金将结合定性、定量分析，以成长动力为主线，精选出具备投资潜力的个股。债券投资方面，追求的是固定收益投资的配置效果与股票权益类投资的配置效果紧密衔接配合，实现基金资产整体最大化收益。本基金在严格遵守相关法律法规情况下，可适当投资股指期货、国债期货和股票期权等衍生工具、资产支持证券等。此外，在条件许可的情况下，可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中债总指数(全价)收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王卫峰	林盛
	联系电话	0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95568
传真		0755-82799292	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		518026	100031
法定代表人		刘入领	高迎欣

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)
本期已实现收益	919,699.61
本期利润	3,278,668.06
加权平均基金份额本期利润	0.0654
本期加权平均净值利润率	5.29%
本期基金份额净值增长率	5.94%
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	14,120,695.66
期末可供分配基金份额利润	0.3254
期末基金资产净值	57,515,580.53
期末基金份额净值	1.3254

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	32.54%

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

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	13.74%	1.66%	7.28%	0.88%	6.46%	0.78%
过去六个月	5.94%	1.25%	5.35%	0.83%	0.59%	0.42%
过去一年	7.49%	0.92%	17.65%	0.73%	-10.16%	0.19%
过去三年	18.70%	1.31%	24.76%	0.79%	-6.06%	0.52%
过去五年	-0.01%	1.40%	5.08%	0.79%	-5.09%	0.61%
自基金合同生效起至今	32.54%	1.40%	12.65%	0.78%	19.89%	0.62%

注：根据《安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债总指数（全价）收益率×30%。中证 800 指数是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，其综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金内地股票投资部分的业绩比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债总指数（全价）是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 60%、10%、30%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

安信成长动力一年持有混合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 2020 年 8 月 13 日。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙凌昊	本基金的基金经理	2025 年 6 月 13 日	-	12 年	孙凌昊先生，经济学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司研究部研究员，中电鑫安资产管理有限责任公司投资部投资经

					理，中欧基金管理有限公司研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司均衡投资部基金经理。现任安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年内需与 AI 相关行业景气度形成巨大剪刀差，PPI、CPI 总体进一步承压，除了伊朗局势带来的部分能源矿产化工类短暂的价格景气外，几乎所有的基本面亮点都来自 AI 相关产业及上

游。这些映射到 A 股市场上，基本面分化加估值水平分化，推动 AI 板块与非 AI 板块的走势分化达到了历史极值区间。

在这样的市场环境下，AI 与非 AI 板块的大方向选择，成为了短期业绩的最重要决定因素，本基金在一季度国内外形势不明朗的前提下，以平衡配置策略为主；二季度初地缘风险释放完毕，加之 AI Agent 带动算力需求出现增速加速拐点，我们转向积极，加仓了 AI 上游光连接、电力设备、存储等环节相关个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3254 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.94%，同期业绩比较基准收益率为 5.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年仍重点关注 AI 相关景气方向：目前 AI 方向的主要矛盾是 CSP 资本开支的紧迫程度是否会随着大模型市场格局与商业化落地的变化而削弱，接下来的布局需要紧盯这一主要矛盾的演化。本基金调仓方向主要包括：（1）“缺电”链：经历了过去的能源冲击后，各国的能源自主、能源冗余意识会空前增强，近十年欠缺投入的电网、传统发电、核电等领域会迎来建设高峰；另外一方面，AI 的大发展已明显超出现有陈旧电网的承载能力（除中国外），需要分布式以及灵活发电装置配合，燃气轮机、柴发等领域方兴未艾；（2）上游电子布、覆铜板、MLCC 等“AI 通胀链”：在刚过去的二季度有一定布局，但接下来的阶段是大浪淘沙的过程，我们会根据供给端、产品价格、下游开支紧迫程度的变化做出调整；（3）受益各国争取 AI 主权与产业链地位的环节：尽管基础大模型仍在迭代进步，但领先者与追赶者的绝对差距在缩小，国产模型的性价比优势开始突显，打开出海市场，国内落地渗透加快，加大对国产算力的需求。我们一方面配置国产领先模型公司和国产算力，同时关注因禁运与技术封锁享受超额景气的半导体设备材料等。

接下来其他行业板块我们也保持一定均衡配置，以改善组合的风险回报比，具体方向包括：

（1）二季度被过度压制但基本面无大问题的周期类方向，包括被美伊局势缓和过度压制的油气、煤炭，被美联储加息预期压制的贵金属、工业金属等；（2）红利类方向；（3）处于长周期底部，供需格局正在改善或有较大改善预期的传统行业。

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开

支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金

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	13,827,231.76	26,678,011.66
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,832,341.78	47,677,297.96
其中：股票投资		44,832,341.78	47,677,297.96
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		-	136,393.28
应收申购款		2,733.97	2,461.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		58,662,307.51	74,494,164.75
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		692,347.86	755,940.65
应付管理人报酬		58,298.22	77,369.06
应付托管费		9,716.37	12,894.85
应付销售服务费		-	-
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	386,364.53	112,935.01
负债合计		1,146,726.98	959,139.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	43,394,884.87	58,774,631.70
未分配利润	6.4.7.8	14,120,695.66	14,760,393.48
净资产合计		57,515,580.53	73,535,025.18
负债和净资产总计		58,662,307.51	74,494,164.75

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3254 元，基金份额总额 43,394,884.87 份。

6.2 利润表

会计主体：安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金

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		3,755,375.32	15,974,971.28
1. 利息收入		44,312.77	19,422.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	44,312.77	19,422.51
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）		1,352,094.10	6,534,608.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,182,238.05	5,156,914.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	20,188.11

资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	169,856.05	1,357,506.68
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	2,358,968.45	9,420,939.97
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	-	-
减：二、营业总支出		476,707.26	880,085.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	368,940.07	683,578.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,489.99	113,929.67
3. 销售服务费		-	-
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		-	0.01
8. 其他费用	6.4.7.19	46,277.20	82,578.26
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		3,278,668.06	15,094,885.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,278,668.06	15,094,885.29
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		3,278,668.06	15,094,885.29

6.3 净资产变动表

会计主体：安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金

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	58,774,631.70	-	14,760,393.48	73,535,025.18
二、本期期初净 资产	58,774,631.70	-	14,760,393.48	73,535,025.18

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,379,746.83	-	-639,697.82	-16,019,444.65
(一)、综合收益总额	-	-	3,278,668.06	3,278,668.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-15,379,746.83	-	-3,918,365.88	-19,298,112.71
其中：1. 基金申购款	304,965.27	-	73,380.86	378,346.13
2. 基金赎回款	-15,684,712.10	-	-3,991,746.74	-19,676,458.84
(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	43,394,884.87	-	14,120,695.66	57,515,580.53
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	109,409,479.32	-	9,127,155.22	118,536,634.54
二、本期期初净资产	109,409,479.32	-	9,127,155.22	118,536,634.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,093,332.00	-	12,391,351.14	-4,701,980.86
(一)、综合收益总额	-	-	15,094,885.29	15,094,885.29
(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)	-17,093,332.00	-	-2,703,534.15	-19,796,866.15
其中：1. 基金申购款	1,012,817.64	-	110,125.51	1,122,943.15
2. 基金赎回款	-18,106,149.64	-	-2,813,659.66	-20,919,809.30
(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	92,316,147.32	-	21,518,506.36	113,834,653.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金（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”）2020 年 7 月 9 日下发的证监许可[2020]1408 号文“关于准予安信成长动力一年持有期混合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《安信成长动力一年持有期混合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 2020 年 7 月 30 日至 2020 年 8 月 7 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（2020）验字第 60962175_H13 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 762,924,720.72 份，其中认购资金利息折合 165,944.93 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股

指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关规定可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债总指数（全价）收益率×30%。

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	1,175,292.90
等于：本金	1,175,096.09
加：应计利息	196.81
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	12,651,938.86
等于：本金	12,651,691.69
加：应计利息	247.17
减：坏账准备	-
合计	13,827,231.76

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		45,209,317.81	-	44,832,341.78	-376,976.03
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		45,209,317.81	-	44,832,341.78	-376,976.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	341,733.55
其中：交易所市场	341,733.55
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
合计	386,364.53

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,774,631.70	58,774,631.70
本期申购	304,965.27	304,965.27
本期赎回（以“-”号填列）	-15,684,712.10	-15,684,712.10
本期末	43,394,884.87	43,394,884.87

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,450,460.79	-3,690,067.31	14,760,393.48
本期期初	18,450,460.79	-3,690,067.31	14,760,393.48
本期利润	919,699.61	2,358,968.45	3,278,668.06
本期基金份额交易产生的变动数	-4,199,884.90	281,519.02	-3,918,365.88
其中：基金申购款	79,673.79	-6,292.93	73,380.86
基金赎回款	-4,279,558.69	287,811.95	-3,991,746.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,170,275.50	-1,049,579.84	14,120,695.66

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,112.04
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	41,200.73
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	44,312.77

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	582,111,454.95
减：卖出股票成本总额	579,975,513.47
减：交易费用	953,703.43
买卖股票差价收入	1,182,238.05

6.4.7.11 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	169,856.05
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	169,856.05

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	2,358,968.45
股票投资	2,358,968.45
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	2,358,968.45

6.4.7.17 其他收入

本基金于本期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
银行汇划费用	1,451.51
证券组合费	194.71
合计	46,277.20

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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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	1,156,883,043.79	100.00	161,300,827.32	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	524,190.09	100.00	341,733.55	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	70,316.02	100.00	36,893.81	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 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	368,940.07	683,578.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	170,886.64	313,065.03
应支付基金管理人的净管理费	198,053.43	370,513.02

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

$$H=E\times 1.20\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	61,489.99	113,929.67

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%的年费率计提。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

6.4.10.3 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

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		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	12,651,938.86	41,200.73	10,942,760.91	16,473.96
民生银行	1,175,292.90	3,112.04	1,197,637.14	2,948.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人民生银行保管，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同责任，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	13,827,231.76	-	-	-	13,827,231.76
交易性金融资产	-	-	-	44,832,341.78	44,832,341.78
应收申购款	-	-	-	2,733.97	2,733.97
资产总计	13,827,231.76	-	-	44,835,075.75	58,662,307.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	692,347.86	692,347.86
应付管理人报酬	-	-	-	58,298.22	58,298.22

应付托管费	-	-	-	9,716.37	9,716.37
其他负债	-	-	-	386,364.53	386,364.53
负债总计	-	-	-	1,146,726.98	1,146,726.98
利率敏感度缺口	13,827,231.76	-	-	43,688,348.77	57,515,580.53
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	26,678,011.66	-	-	-	26,678,011.66
交易性金融资产	-	-	-	47,677,297.96	47,677,297.96
应收股利	-	-	-	136,393.28	136,393.28
应收申购款	-	-	-	2,461.85	2,461.85
资产总计	26,678,011.66	-	-	47,816,153.09	74,494,164.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	755,940.65	755,940.65
应付管理人报酬	-	-	-	77,369.06	77,369.06
应付托管费	-	-	-	12,894.85	12,894.85
其他负债	-	-	-	112,935.01	112,935.01
负债总计	-	-	-	959,139.57	959,139.57
利率敏感度缺口	26,678,011.66	-	-	46,857,013.52	73,535,025.18

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资	-	3,321,865.01	-	3,321,865.01

产				
资产合计	-	3,321,865.01	-	3,321,865.01
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	3,321,865.01	-	3,321,865.01
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	14,225,425.96	-	14,225,425.96
应收股利	-	136,393.28	-	136,393.28
资产合计	-	14,361,819.24	-	14,361,819.24
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	14,361,819.24	-	14,361,819.24

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人 民币升值 5%	166,093.25	718,090.96
	2. 所有外币相对人 民币贬值 5%	-166,093.25	-718,090.96

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。本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）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	44,832,341.78	77.95	47,677,297.96	64.84
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	44,832,341.78	77.95	47,677,297.96	64.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,973,181.44	1,283,561.62

	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,973,181.44	-1,283,561.62
--	-------------------	---------------	---------------

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	44,832,341.78	47,677,297.96
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	44,832,341.78	47,677,297.96

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	44,832,341.78	76.42
	其中：股票	44,832,341.78	76.42
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	13,827,231.76	23.57
8	其他各项资产	2,733.97	0.00
9	合计	58,662,307.51	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 3,321,865.01 元，占净值比例 5.78%。

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	9,342,216.20	16.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,085,096.00	8.84
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,151,215.00	2.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,203,765.57	2.09

J	金融业	24,728,184.00	42.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	41,510,476.77	72.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	1,645,528.77	2.86
信息技术	-	-
通讯业务	1,676,336.24	2.91
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	3,321,865.01	5.78

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

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	2,600	3,302,000.00	5.74
2	601398	工商银行	408,200	2,885,974.00	5.02
3	601288	农业银行	465,500	2,825,585.00	4.91
4	600900	长江电力	106,600	2,821,702.00	4.91
5	600025	华能水电	254,600	2,263,394.00	3.94
6	300502	新易盛	3,400	2,063,800.00	3.59
7	688008	澜起科技	5,748	1,781,305.20	3.10
8	601988	中国银行	302,900	1,732,588.00	3.01
9	00728	中国电信	452,000	1,676,336.24	2.91
10	06030	中信证券	69,500	1,645,528.77	2.86
11	601628	中国人寿	41,800	1,477,630.00	2.57
12	605499	东鹏饮料	10,000	1,234,300.00	2.15

13	601211	国泰海通	67,300	1,224,860.00	2.13
14	601995	中金公司	33,400	1,207,410.00	2.10
15	688449	联芸科技	13,947	1,203,765.57	2.09
16	601319	中国人保	175,100	1,183,676.00	2.06
17	601881	中国银河	94,100	1,182,837.00	2.06
18	601658	邮储银行	239,400	1,180,242.00	2.05
19	601688	华泰证券	57,100	1,177,402.00	2.05
20	002736	国信证券	115,900	1,157,841.00	2.01
21	600377	宁沪高速	99,500	1,151,215.00	2.00
22	601939	建设银行	118,700	1,143,081.00	1.99
23	000166	申万宏源	259,500	1,141,800.00	1.99
24	601328	交通银行	177,100	1,138,753.00	1.98
25	601601	中国太保	39,100	1,115,132.00	1.94
26	601162	天风证券	180,800	609,296.00	1.06
27	601099	太平洋	179,300	604,241.00	1.05
28	600109	国金证券	67,700	594,406.00	1.03
29	601788	光大证券	40,600	585,858.00	1.02
30	601456	国联民生	63,300	559,572.00	0.97
31	603345	安井食品	6,900	553,311.00	0.96
32	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.71

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	601857	中国石油	12,071,018.00	16.42
2	601288	农业银行	9,784,201.00	13.31
3	09988	阿里巴巴-W	8,494,533.58	11.55
4	300502	新易盛	8,466,495.80	11.51
5	601398	工商银行	8,337,423.00	11.34
6	688981	中芯国际	8,192,558.61	11.14
7	300308	中际旭创	7,769,186.00	10.57
8	000988	华工科技	6,356,020.00	8.64
9	600938	中国海油	6,299,641.00	8.57
10	688205	德科立	6,166,316.79	8.39
11	301486	致尚科技	6,012,398.00	8.18
12	002475	立讯精密	5,923,055.00	8.05
13	002384	东山精密	5,545,994.00	7.54
14	000725	京东方 A	5,439,036.00	7.40
15	603306	华懋科技	5,059,602.00	6.88
16	600673	东阳光	5,034,002.00	6.85
17	600941	中国移动	4,795,134.00	6.52

18	601988	中国银行	4,784,648.50	6.51
19	000338	潍柴动力	4,731,350.00	6.43
20	601138	工业富联	4,546,326.00	6.18
21	300570	太辰光	4,480,692.00	6.09
22	688521	芯原股份	4,194,297.86	5.70
23	600025	华能水电	4,152,572.00	5.65
24	301479	弘景光电	4,134,023.00	5.62
25	001267	汇绿生态	4,102,353.00	5.58
26	00883	中国海洋石油	4,008,293.89	5.45
27	600028	中国石化	3,860,701.00	5.25
28	600188	兖矿能源	3,690,809.00	5.02
29	601658	邮储银行	3,690,338.00	5.02
30	688111	金山办公	3,608,538.83	4.91
31	688226	威腾电气	3,595,728.19	4.89
32	601601	中国太保	3,539,546.00	4.81
33	600759	洲际油气	3,529,620.00	4.80
34	601939	建设银行	3,524,442.00	4.79
35	601628	中国人寿	3,524,202.00	4.79
36	002353	杰瑞股份	3,446,757.00	4.69
37	002126	银轮股份	3,393,111.00	4.61
38	301468	博盈特焊	3,366,833.00	4.58
39	002469	三维化学	3,287,886.00	4.47
40	300750	宁德时代	3,253,221.00	4.42
41	600031	三一重工	3,190,197.00	4.34
42	688256	寒武纪	3,186,512.29	4.33
43	603501	豪威集团	3,168,063.00	4.31
44	688126	沪硅产业	3,166,302.35	4.31
45	600845	宝信软件	3,113,919.00	4.23
46	688019	安集科技	3,094,513.98	4.21
47	601728	中国电信	3,071,966.00	4.18
48	300394	天孚通信	3,062,359.00	4.16
49	688498	源杰科技	3,004,491.39	4.09
50	688123	聚辰股份	2,989,583.95	4.07
51	688449	联芸科技	2,980,417.70	4.05
52	600900	长江电力	2,945,136.00	4.01
53	688625	呈和科技	2,943,538.47	4.00
54	00700	腾讯控股	2,940,490.72	4.00
55	688041	海光信息	2,918,842.55	3.97
56	600875	东方电气	2,892,729.00	3.93
57	603986	兆易创新	2,883,809.00	3.92
58	600482	中国动力	2,829,963.00	3.85
59	688008	澜起科技	2,668,509.44	3.63
60	000422	湖北宜化	2,450,543.00	3.33

61	000983	山西焦煤	2,441,726.00	3.32
62	601898	中煤能源	2,427,932.00	3.30
63	600050	中国联通	2,411,982.00	3.28
64	600377	宁沪高速	2,411,377.00	3.28
65	300454	深信服	2,395,162.00	3.26
66	002938	鹏鼎控股	2,392,359.00	3.25
67	000880	潍柴重机	2,390,891.00	3.25
68	605060	联德股份	2,384,522.00	3.24
69	601328	交通银行	2,376,810.00	3.23
70	600406	国电南瑞	2,375,312.00	3.23
71	601211	国泰海通	2,363,803.00	3.21
72	688480	赛恩斯	2,359,587.70	3.21
73	601688	华泰证券	2,355,610.00	3.20
74	600036	招商银行	2,328,396.00	3.17
75	605090	九丰能源	2,318,644.00	3.15
76	688239	航宇科技	2,318,615.55	3.15
77	300866	安克创新	2,317,978.00	3.15
78	00728	中国电信	2,310,040.06	3.14
79	300548	长芯博创	2,301,001.00	3.13
80	002595	豪迈科技	2,261,250.00	3.08
81	600893	航发动力	2,251,160.00	3.06
82	002448	中原内配	2,029,549.00	2.76
83	000786	北新建材	2,013,536.00	2.74
84	601808	中海油服	1,974,780.00	2.69
85	600688	上海石化	1,964,888.00	2.67
86	600048	保利发展	1,952,468.00	2.66
87	600030	中信证券	1,918,938.00	2.61
88	603288	海天味业	1,917,390.93	2.61
89	601669	中国电建	1,909,116.00	2.60
90	601318	中国平安	1,906,585.00	2.59
91	002466	天齐锂业	1,877,856.00	2.55
92	600150	中国船舶	1,874,426.71	2.55
93	688508	芯朋微	1,859,088.34	2.53
94	600019	宝钢股份	1,855,440.00	2.52
95	300433	蓝思科技	1,854,457.00	2.52
96	601012	隆基绿能	1,840,916.00	2.50
97	688519	南亚新材	1,825,665.72	2.48
98	600105	永鼎股份	1,819,465.00	2.47
99	000830	鲁西化工	1,813,438.00	2.47
100	601001	晋控煤业	1,809,028.00	2.46
101	002545	东方铁塔	1,808,148.00	2.46
102	601101	昊华能源	1,806,505.00	2.46
103	600498	烽火通信	1,795,188.00	2.44

104	300803	指南针	1,790,017.00	2.43
105	002436	兴森科技	1,786,929.00	2.43
106	000166	申万宏源	1,785,978.00	2.43
107	002975	博杰股份	1,784,191.00	2.43
108	002714	牧原股份	1,783,979.00	2.43
109	601225	陕西煤业	1,783,045.00	2.42
110	600426	华鲁恒升	1,770,162.00	2.41
111	300277	汽轮科技	1,769,131.00	2.41
112	601666	平煤股份	1,759,186.00	2.39
113	300191	潜能恒信	1,755,503.00	2.39
114	688559	海目星	1,748,521.54	2.38
115	300476	胜宏科技	1,746,148.00	2.37
116	601088	中国神华	1,742,052.00	2.37
117	601689	拓普集团	1,735,108.00	2.36
118	002156	通富微电	1,731,509.00	2.35
119	06030	中信证券	1,731,163.59	2.35
120	002943	宇晶股份	1,726,388.70	2.35
121	603308	应流股份	1,711,003.00	2.33
122	02577	英诺赛科	1,709,558.02	2.32
123	300620	光库科技	1,700,506.00	2.31
124	002410	广联达	1,685,694.00	2.29
125	300124	汇川技术	1,683,175.00	2.29
126	01211	比亚迪股份	1,679,803.20	2.28
127	688343	云天励飞	1,673,279.59	2.28
128	01072	东方电气	1,643,781.44	2.24
129	000581	威孚高科	1,624,993.00	2.21
130	601699	潞安环能	1,529,385.00	2.08
131	000893	亚钾国际	1,516,035.00	2.06
132	000683	博源化工	1,506,726.00	2.05
133	002371	北方华创	1,505,218.00	2.05
134	300014	亿纬锂能	1,484,240.86	2.02
135	600841	动力新科	1,474,968.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	12,413,989.00	16.88
2	600938	中国海油	9,453,872.00	12.86
3	600519	贵州茅台	8,706,591.75	11.84
4	688981	中芯国际	8,429,483.13	11.46

5	09988	阿里巴巴-W	8,377,856.89	11.39
6	601398	工商银行	7,425,342.00	10.10
7	600941	中国移动	7,132,271.00	9.70
8	000988	华工科技	7,034,590.00	9.57
9	601288	农业银行	6,785,578.00	9.23
10	300502	新易盛	6,564,118.00	8.93
11	002475	立讯精密	6,280,033.00	8.54
12	000725	京东方 A	6,203,314.00	8.44
13	688205	德科立	6,136,703.09	8.35
14	301486	致尚科技	5,971,158.00	8.12
15	00700	腾讯控股	5,959,310.97	8.10
16	300308	中际旭创	5,918,039.00	8.05
17	002384	东山精密	5,779,541.00	7.86
18	601728	中国电信	5,591,938.00	7.60
19	601988	中国银行	5,485,131.00	7.46
20	600028	中国石化	5,246,307.00	7.13
21	000338	潍柴动力	5,214,106.00	7.09
22	603306	华懋科技	5,078,443.00	6.91
23	600673	东阳光	4,968,309.00	6.76
24	300570	太辰光	4,861,612.22	6.61
25	601138	工业富联	4,860,061.00	6.61
26	001267	汇绿生态	4,467,109.00	6.07
27	00939	建设银行	4,331,259.69	5.89
28	301479	弘景光电	4,009,985.00	5.45
29	002353	杰瑞股份	3,951,411.00	5.37
30	002126	银轮股份	3,854,277.00	5.24
31	600188	兖矿能源	3,853,654.00	5.24
32	00883	中国海洋石油	3,816,498.64	5.19
33	688521	芯原股份	3,803,591.78	5.17
34	688226	威腾电气	3,706,281.92	5.04
35	688111	金山办公	3,537,491.05	4.81
36	688498	源杰科技	3,515,623.14	4.78
37	000858	五 粮 液	3,483,307.00	4.74
38	301468	博盈特焊	3,426,436.00	4.66
39	603986	兆易创新	3,404,071.00	4.63
40	601658	邮储银行	3,340,943.00	4.54
41	300750	宁德时代	3,255,633.00	4.43
42	688126	沪硅产业	3,241,187.90	4.41
43	600031	三一重工	3,177,388.00	4.32
44	603501	豪威集团	3,125,904.00	4.25
45	688041	海光信息	3,125,302.42	4.25
46	300394	天孚通信	3,121,998.60	4.25
47	688123	聚辰股份	3,114,961.67	4.24

48	688625	呈和科技	3,110,129.07	4.23
49	600759	洲际油气	3,070,541.00	4.18
50	688019	安集科技	3,065,182.15	4.17
51	002469	三维化学	3,063,786.00	4.17
52	600845	宝信软件	3,062,182.00	4.16
53	688256	寒武纪	3,041,590.84	4.14
54	600482	中国动力	2,869,473.00	3.90
55	600809	山西汾酒	2,868,240.00	3.90
56	600875	东方电气	2,796,231.00	3.80
57	601328	交通银行	2,649,257.00	3.60
58	002938	鹏鼎控股	2,590,122.84	3.52
59	300548	长芯博创	2,451,925.00	3.33
60	000983	山西焦煤	2,427,982.00	3.30
61	600406	国电南瑞	2,406,921.00	3.27
62	002595	豪迈科技	2,397,717.00	3.26
63	000422	湖北宜化	2,384,942.00	3.24
64	300454	深信服	2,383,818.00	3.24
65	600050	中国联通	2,369,324.00	3.22
66	000880	潍柴重机	2,357,048.00	3.21
67	688480	赛恩斯	2,348,468.93	3.19
68	601939	建设银行	2,342,110.00	3.19
69	300866	安克创新	2,326,126.00	3.16
70	688239	航宇科技	2,324,333.41	3.16
71	600036	招商银行	2,324,136.00	3.16
72	605060	联德股份	2,315,250.00	3.15
73	601088	中国神华	2,287,693.00	3.11
74	601898	中煤能源	2,266,070.00	3.08
75	01398	工商银行	2,262,829.75	3.08
76	601601	中国太保	2,261,509.00	3.08
77	605090	九丰能源	2,256,010.28	3.07
78	688519	南亚新材	2,233,293.77	3.04
79	600893	航发动力	2,230,506.00	3.03
80	600900	长江电力	2,076,938.00	2.82
81	603288	海天味业	2,039,538.00	2.77
82	002448	中原内配	2,038,477.00	2.77
83	600688	上海石化	2,025,556.00	2.75
84	688449	联芸科技	2,011,337.02	2.74
85	601628	中国人寿	2,005,140.00	2.73
86	002156	通富微电	1,998,391.00	2.72
87	300620	光库科技	1,995,152.00	2.71
88	002436	兴森科技	1,987,633.00	2.70
89	600377	宁沪高速	1,987,508.00	2.70
90	601808	中海油服	1,985,135.00	2.70

91	000786	北新建材	1,976,510.00	2.69
92	600498	烽火通信	1,943,894.00	2.64
93	600030	中信证券	1,929,332.00	2.62
94	02577	英诺赛科	1,920,861.15	2.61
95	00728	中国电信	1,883,858.66	2.56
96	002943	宇晶股份	1,881,927.00	2.56
97	603308	应流股份	1,879,704.00	2.56
98	688559	海目星	1,868,641.84	2.54
99	002975	博杰股份	1,860,285.40	2.53
100	601318	中国平安	1,859,484.00	2.53
101	601225	陕西煤业	1,849,140.00	2.51
102	002466	天齐锂业	1,840,091.00	2.50
103	600150	中国船舶	1,837,856.87	2.50
104	300476	胜宏科技	1,833,948.00	2.49
105	600048	保利发展	1,830,608.00	2.49
106	688508	芯朋微	1,813,835.34	2.47
107	600105	永鼎股份	1,786,149.00	2.43
108	600019	宝钢股份	1,780,707.00	2.42
109	601689	拓普集团	1,764,498.00	2.40
110	300433	蓝思科技	1,748,448.00	2.38
111	600025	华能水电	1,746,525.00	2.38
112	300803	指南针	1,745,977.00	2.37
113	002714	牧原股份	1,743,153.00	2.37
114	601012	隆基绿能	1,738,289.00	2.36
115	601669	中国电建	1,727,561.00	2.35
116	300124	汇川技术	1,720,654.00	2.34
117	601001	晋控煤业	1,720,644.00	2.34
118	000830	鲁西化工	1,718,736.00	2.34
119	601666	平煤股份	1,697,901.00	2.31
120	01072	东方电气	1,696,550.25	2.31
121	600426	华鲁恒升	1,696,465.00	2.31
122	01211	比亚迪股份	1,648,377.22	2.24
123	300191	潜能恒信	1,642,881.00	2.23
124	601101	昊华能源	1,628,324.00	2.21
125	688677	海泰新光	1,606,161.49	2.18
126	002410	广联达	1,597,378.00	2.17
127	688343	云天励飞	1,562,718.93	2.13
128	002545	东方铁塔	1,562,178.00	2.12
129	03988	中国银行	1,542,412.45	2.10
130	300277	汽轮科技	1,540,624.84	2.10
131	000683	博源化工	1,501,098.00	2.04
132	000581	威孚高科	1,498,942.00	2.04
133	001965	招商公路	1,497,266.00	2.04

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	574,771,588.84
卖出股票收入（成交）总额	582,111,454.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国电信股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中信证券股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,733.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,733.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
3,663	11,846.82	47.69	0.00	43,394,837.18	100.00

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（%）	94.80

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	77,398.18	0.18

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 8 月 13 日）	762,924,720.72
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	58,774,631.70
本报告期基金总申购份额	304,965.27
减：本报告期基金总赎回份额	15,684,712.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	43,394,884.87

§ 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、基金托管业务的诉讼。

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，基金托管人未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的通知。

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，基金托管人证券投资基金托管业务相关从业人员未收到受调查或处罚的通知。

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	1,156,883,043.79	100.00	524,190.09	100.00	-
------	---	------------------	--------	------------	--------	---

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	-	-	-	-	-	-

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
5	安信基金管理有限责任公司关于2026年香港耶稣受难节、清明节、复活节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2026年4月1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

	公告		
8	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2026 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信成长动力一年持有期混合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