安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信上证科创综指增强发起
基金主代码	023908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 5 月 13 日
报告期末基金份额总额	56,556,142.82 份
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对标的指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。指数化被动投资策略以成份股在标的指数中的权重为基础，通过控制股票组合中各股票相对其在标的指数中权重的偏离，实现对跟踪误差的控制，进行指数化投资。量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评价股票超额收益预期、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。在债券和货币市场工具投资方面，将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。 此外，本基金还将采用衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等，更

	好地实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。本基金若通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
下属分级基金的交易代码	023908	023909
报告期末下属分级基金的份额总额	40,361,521.48 份	16,194,621.34 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）	
	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
1.本期已实现收益	-4,846,973.53	-1,941,500.74
2.本期利润	-19,393,020.84	-7,736,023.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4877	-0.4889
4.期末基金资产净值	60,349,442.97	24,079,289.62
5.期末基金份额净值	1.4952	1.4869

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信上证科创综指增强发起 A

阶段	净值增长率①	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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	-24.55%	3.23%	-26.67%	2.96%	2.12%	0.27%
过去六个月	7.91%	2.79%	11.78%	2.69%	-3.87%	0.10%
过去一年	7.48%	2.29%	5.79%	2.28%	1.69%	0.01%
自基金合同生效起至今	49.52%	2.04%	49.62%	2.07%	-0.10%	-0.03%

安信上证科创综指增强发起 C

阶段	净值增长率①	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	-24.62%	3.23%	-26.67%	2.96%	2.05%	0.27%
过去六个月	7.70%	2.79%	11.78%	2.69%	-4.08%	0.10%
过去一年	7.06%	2.29%	5.79%	2.28%	1.27%	0.01%
自基金合同生效起至今	48.69%	2.04%	49.62%	2.07%	-0.93%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 5 月 13 日。

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱舟扬	本基金的基金经理	2025 年 5 月 13 日	-	9 年	朱舟扬先生，哲学博士。曾任安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理，量化投资部副总经理（主持工作）	2025 年 5 月 13 日	-	13 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理、基金经理、总经理助理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部副总经理（主持工作）。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、安信红利量化选股股票型证券

					投资基金、安信创业板指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，从量化投资的风格因子层面看，盈利、估值等因子表现较好，小市值、动量等因子表现较弱。从行业层面看，煤炭、石油石化、农林牧渔等行业表现较好，电子、建筑材料、电力设备等行业表现不佳。

2026 年三季度，全球经济与政治格局继续面临较高不确定性，中东地缘冲突反复演化，对全球能源供应和国际油价形成扰动，通胀压力与经济增长放缓之间的矛盾持续凸显。受通胀韧性及能源价格波动影响，主要经济体货币政策面临新的挑战，美联储于 9 月宣布加息 25 个基点，进一步加大全球金融市场对利率路径的分歧与不确定性。在此背景下，中国经济总体保持平稳运行，

宏观政策持续围绕扩大内需、稳定投资和培育新质生产力协同发力，推动经济结构向高质量发展演进。资本市场层面，人工智能产业链在经历前期持续上涨后，于 7 月出现显著调整，全球半导体、存储及 AI 基础设施相关股票普遍承压，市场对 AI 产业资本开支、估值水平及未来盈利兑现能力的担忧有所上升，相关调整亦传导至中国科技股市场，部分高估值科技资产出现明显回撤。此后，AI 产业链内部的结构分化进一步加大，市场对算力需求、技术迭代、国产替代及企业盈利能力的关注持续提升。与此同时，价值与红利类资产的表现受到市场风险偏好变化和资金配置调整的影响，板块轮动与市场风格再平衡特征更加明显。整体来看，全球货币政策变化、地缘政治风险与科技产业估值调整共同影响三季度资本市场运行，中国经济在政策支持与产业升级推动下保持韧性，市场投资逻辑则逐步由单纯的产业主题驱动转向产业景气、估值水平与业绩兑现并重，结构性机会与风险并存。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信上证科创综指增强发起 A 基金份额净值为 1.4952 元，本报告期基金份额净值增长率为-24.55%；安信上证科创综指增强发起 C 基金份额净值为 1.4869 元，本报告期基金份额净值增长率为-24.62%；同期业绩比较基准收益率为-26.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	79,505,378.35	93.73
	其中：股票	79,505,378.35	93.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,500.11	0.03
	其中：债券	25,500.11	0.03
	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	5,030,310.88	5.93
8	其他资产	266,171.46	0.31
9	合计	84,827,360.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,231,834.01	65.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,224,178.79	13.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,276,300.92	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	843,068.78	1.00
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	68,575,382.50	81.22

5.2.2 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	89,975.04	0.11
C	制造业	9,322,377.37	11.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,068.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,503.00	0.01
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	585,899.44	0.69
J	金融业	-	-

K	房地产业	135,303.00	0.16
L	租赁和商务服务业	386,602.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	184,074.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	26,270.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	75,924.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,929,995.85	12.95

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	4,451	4,491,103.51	5.32
2	688041	海光信息	14,024	3,180,643.20	3.77
3	688981	中芯国际	17,762	1,989,166.38	2.36
4	688008	澜起科技	8,471	1,713,768.01	2.03
5	688012	中微公司	5,023	1,600,076.65	1.90
6	688808	联讯仪器	851	1,316,182.13	1.56
7	688498	源杰科技	735	1,185,555.00	1.40
8	688820	盛合晶微	9,246	1,070,070.28	1.27
9	688072	拓荆科技	1,475	944,000.00	1.12
10	688802	沐曦股份	1,883	936,001.64	1.11

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688825	长鑫科技	13,736	530,896.40	0.63
2	002282	博深股份	33,700	204,222.00	0.24
3	002386	天原股份	34,600	202,410.00	0.24
4	300128	锦富技术	41,700	200,160.00	0.24
5	300256	星星科技	77,000	199,430.00	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	25,500.11	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,500.11	0.03

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123288	隆新转债	185	18,500.08	0.02
2	118077	莱特转债	70	7,000.03	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，

对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，澜起科技股份有限公司在本报告期内被监管部门立案调查。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	266,171.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	266,171.46

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688820	盛合晶微	14,619.80	0.02	新股锁定

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	530,896.40	0.63	新股锁定

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
报告期期初基金份额总额	39,798,703.32	14,219,839.16
报告期期间基金总申购份额	9,515,627.39	10,055,966.49
减:报告期期间基金总赎回份额	8,952,809.23	8,081,184.31
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	40,361,521.48	16,194,621.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	安信上证科创综指增强发起 A	安信上证科创综指增强发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,416.71	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,416.71	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	17.68	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,416.71	17.68	10,000,416.71	17.68	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,416.71	17.68	10,000,416.71	17.68	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金募集的文件；

2、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；

5、中国证监会要求的其它文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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 10 月 26 日