安信中证500指数增强型证券投资基金
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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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
报告期末基金份额总额	11,994,949.10 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。	
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	
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	6,030,514.17 份	5,964,434.93 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）	
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
1.本期已实现收益	-1,121,289.94	-1,079,730.39
2.本期利润	-2,759,358.33	-2,621,363.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4613	-0.4340
4.期末基金资产净值	14,231,941.00	13,637,929.65
5.期末基金份额净值	2.3600	2.2865

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

安信中证 500 指数增强 A

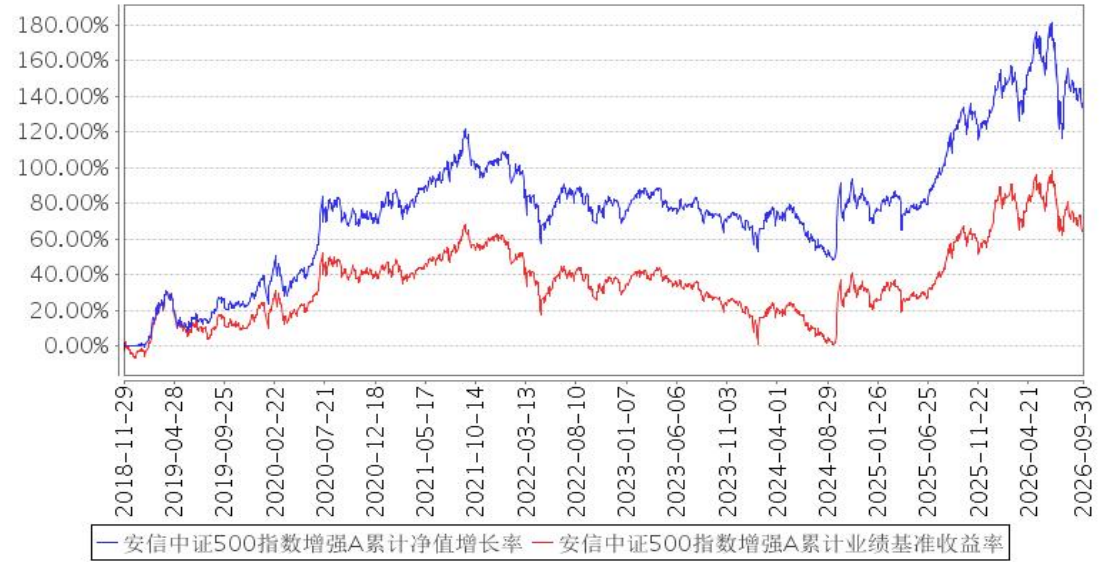
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-16.16%	2.28%	-16.81%	1.89%	0.65%	0.39%
过去六个月	1.24%	1.99%	-2.17%	1.75%	3.41%	0.24%
过去一年	2.43%	1.70%	0.47%	1.58%	1.96%	0.12%
过去三年	35.86%	1.42%	29.54%	1.50%	6.32%	-0.08%
过去五年	15.38%	1.27%	5.13%	1.34%	10.25%	-0.07%
过去七年	95.75%	1.29%	48.79%	1.33%	46.96%	-0.04%
自基金合同生效起至今	136.00%	1.29%	64.86%	1.35%	71.14%	-0.06%

安信中证 500 指数增强 C

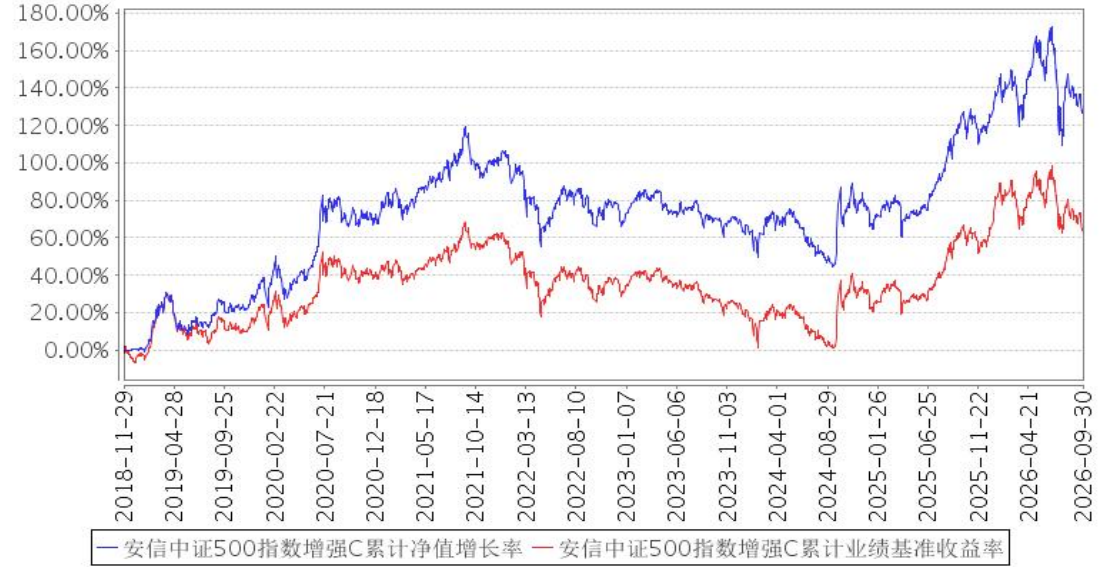
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-16.25%	2.28%	-16.81%	1.89%	0.56%	0.39%
过去六个月	1.03%	1.99%	-2.17%	1.75%	3.20%	0.24%
过去一年	2.02%	1.70%	0.47%	1.58%	1.55%	0.12%
过去三年	34.20%	1.42%	29.54%	1.50%	4.66%	-0.08%
过去五年	13.06%	1.27%	5.13%	1.34%	7.93%	-0.07%
过去七年	90.32%	1.29%	48.79%	1.33%	41.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	128.65%	1.29%	64.86%	1.35%	63.79%	-0.06%

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

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	2021 年 12 月 31 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。

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，中国经济总体运行平稳，结构调整继续推进，呈现总量阶段性放缓与高技术产业快速增长并存的格局。高技术产业在生产、投资、出口及企业利润等方面继续保持明显领先，人工智能算力相关产品出口持续高速增长，外贸整体保持较快增长。与此同时，有效内需仍相对不足，居民收入预期尚未明显改善，消费增速低位震荡；在深入整治“内卷式”竞争、推动产能去化的背景下，投资延续下行，房地产调整仍在持续。价格方面，中东地缘局势再度紧张推动国

际能源价格回升，国内通胀温和上行。外部环境方面，海外主要经济体货币政策转向收紧，美联储、欧洲央行与日本央行于 9 月相继加息，全球流动性收紧预期升温。总体看，高技术产业与外需对经济形成支撑，但内需修复偏缓以及海外流动性和地缘局势的变化，仍是经济运行面临的主要制约。

三季度 A 股市场整体明显回调，市场风格由二季度的成长主导转向价值与红利占优。一方面，前期涨幅较大的科技成长板块估值与交易集中度处于较高水平，在海外半导体产业链调整的带动下获利了结压力集中释放；另一方面，海外主要央行相继加息、全球长端利率上行，高估值成长资产承压更为明显，市场成交逐月缩量，风险偏好有所下降。风格上，三季度国证成长指数下跌 19.05%，国证价值指数上涨 3.90%，与二季度形成明显反转；二季度领涨的科技板块回调幅度居前，而红利、能源、银行等前期相对落后的板块逆势走强。以中证 500 为代表的中盘成长受成长风格整体回撤影响，三季度下跌 17.67%，弱于上证指数与沪深 300。

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。

4.5 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 2.3600 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.16%；安信中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 2.2865 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.25%；同期业绩比较基准收益率为-16.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 7 月 1 日至 2026 年 9 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 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	26,289,823.66	94.06
	其中：股票	26,289,823.66	94.06
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	1,648,626.74	5.90
8	其他资产	10,764.70	0.04
9	合计	27,949,215.10	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	978,533.00	3.51
C	制造业	14,558,510.10	52.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	470,579.00	1.69
E	建筑业	217,704.00	0.78
F	批发和零售业	1,025,616.00	3.68
G	交通运输、仓储和邮政业	439,697.00	1.58
H	住宿和餐饮业	104,690.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,010,534.58	3.63
J	金融业	1,139,099.00	4.09
K	房地产业	448,711.00	1.61
L	租赁和商务服务业	333,963.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	540,342.00	1.94
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	163,839.00	0.59
S	综合	-	-
	合计	21,431,817.68	76.90

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	40,334.00	0.14
B	采矿业	335,217.00	1.20
C	制造业	2,487,874.29	8.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,066.00	0.16
E	建筑业	230,078.00	0.83
F	批发和零售业	144,002.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	45,150.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	670,793.69	2.41
J	金融业	350,224.00	1.26
K	房地产业	49,920.00	0.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	241,923.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	173,090.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,334.00	0.16
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,858,005.98	17.43

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	300604	长川科技	1,900	455,601.00	1.63
2	688347	华虹宏力	1,924	400,038.08	1.44
3	688002	睿创微纳	1,892	328,110.64	1.18
4	688498	源杰科技	200	322,600.00	1.16
5	300757	罗博特科	600	320,100.00	1.15
6	300223	君正股份	2,300	297,045.00	1.07
7	601869	长飞光纤	700	287,812.00	1.03
8	002966	苏州银行	30,900	287,370.00	1.03
9	002273	水晶光电	11,000	268,400.00	0.96
10	600256	广汇能源	40,000	266,800.00	0.96

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	601658	邮储银行	35,100	191,646.00	0.69
2	601728	中国电信	30,400	190,912.00	0.69
3	601857	中国石油	16,900	189,449.00	0.68
4	301046	能辉科技	5,700	188,898.00	0.68
5	688135	利扬芯片	4,942	180,383.00	0.65

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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，广汇能源股份有限公司、苏州银行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。

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	10,764.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,764.70

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

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。

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

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。

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	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	5,715,857.05	6,819,594.49
报告期期间基金总申购份额	1,025,715.41	799,720.39
减:报告期期间基金总赎回份额	711,058.29	1,654,879.95
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	6,030,514.17	5,964,434.93

§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

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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