

安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46

8.3 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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6 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	63
8.7 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	63
8.8 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	63
8.9 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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 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	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1 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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 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	37,212,585.10 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	4,684,529.56 份	32,528,055.54 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。
--	--------

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	乔江晖	朱广科
	联系电话	0755-82509999	0574-87050338
	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		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	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	陆华裕

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年 11 月 29 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	安信中证 500 指数增强 A	安信中证 500 指数增强 C	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	2,506,507.01	7,791,203.29	143,392.66	9,938,618.24	806.77	302,551.88
本期利润	1,318,726.38	9,289,907.31	589,093.08	11,261,861.70	808.46	303,310.19
加权平均基金份额本期利润	0.2463	0.3678	0.3510	0.3343	0.0018	0.0013
本期加权平均净值利润率	14.96%	23.40%	29.22%	28.99%	0.18%	0.13%
本期基金份额净值增长率	32.90%	32.37%	30.51%	29.99%	0.18%	0.14%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	2,287,676.00	15,439,624.34	217,880.90	2,178,914.34	850.67	302,510.78
期末可供分配基金份额利润	0.4883	0.4747	0.1012	0.0960	0.0017	0.0014
期末基金资产净值	8,139,544.03	56,045,662.39	2,815,303.54	29,539,443.78	487,486.31	216,264,727.77
期末基金	1.7375	1.7230	1.3074	1.3017	1.0018	1.0014

份额净值						
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	73.75%	72.30%	30.74%	30.17%	0.18%	0.14%

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	3.64%	1.19%	2.70%	1.10%	0.94%	0.09%
过去六个月	11.16%	1.44%	8.20%	1.38%	2.96%	0.06%
过去一年	32.90%	1.58%	19.94%	1.54%	12.96%	0.04%
自基金合同生效起至今	73.75%	1.41%	41.24%	1.45%	32.51%	-0.04%

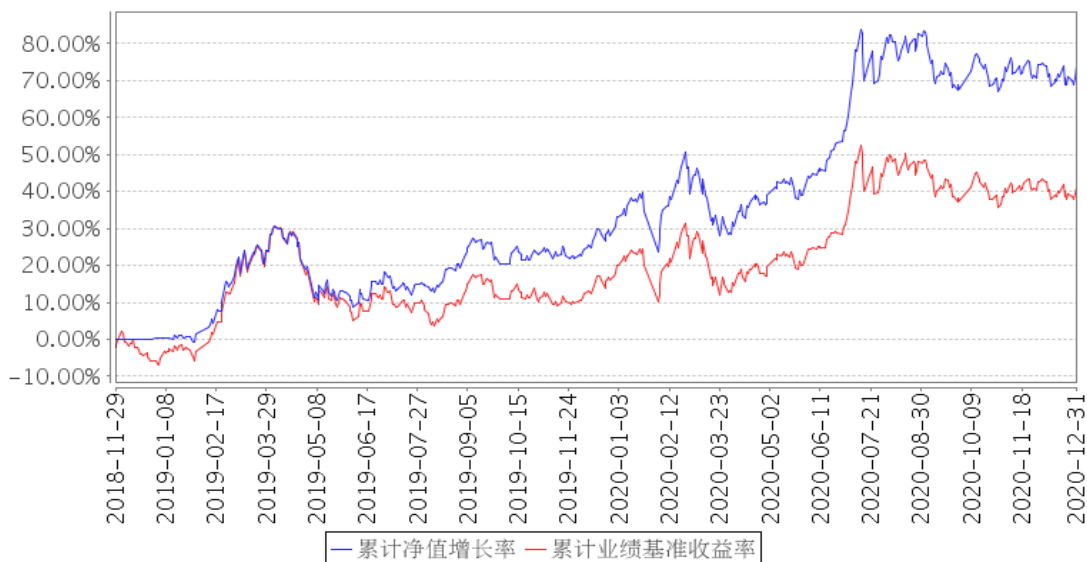
安信中证 500 指数增强 C

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	3.54%	1.19%	2.70%	1.10%	0.84%	0.09%
过去六个月	10.94%	1.44%	8.20%	1.38%	2.74%	0.06%
过去一年	32.37%	1.58%	19.94%	1.54%	12.43%	0.04%
自基金合同生效起至今	72.30%	1.41%	41.24%	1.45%	31.06%	-0.04%

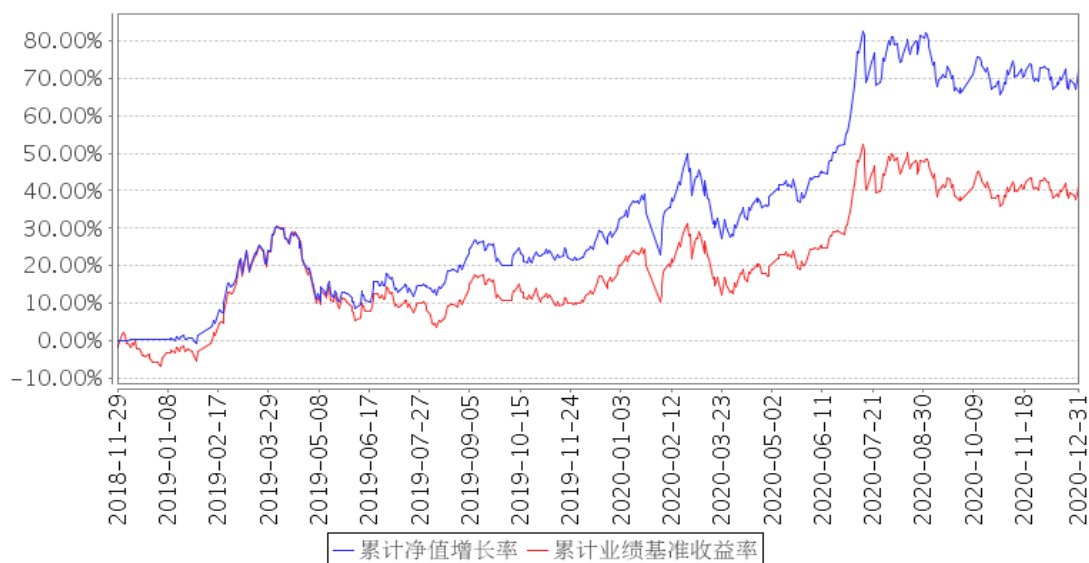
注：业绩比较基准收益率=95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。本基金为指数增强型基金，标的指数为中证 500 指数，因此业绩比较基准以中证 500 指数收益率为主要组成部分。

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

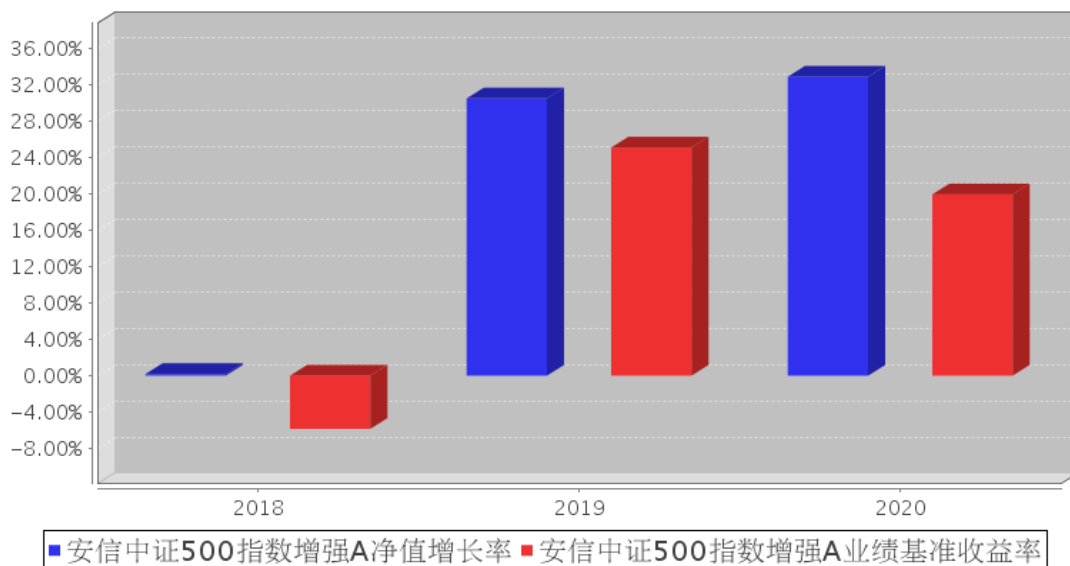


注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 11 月 29 日。

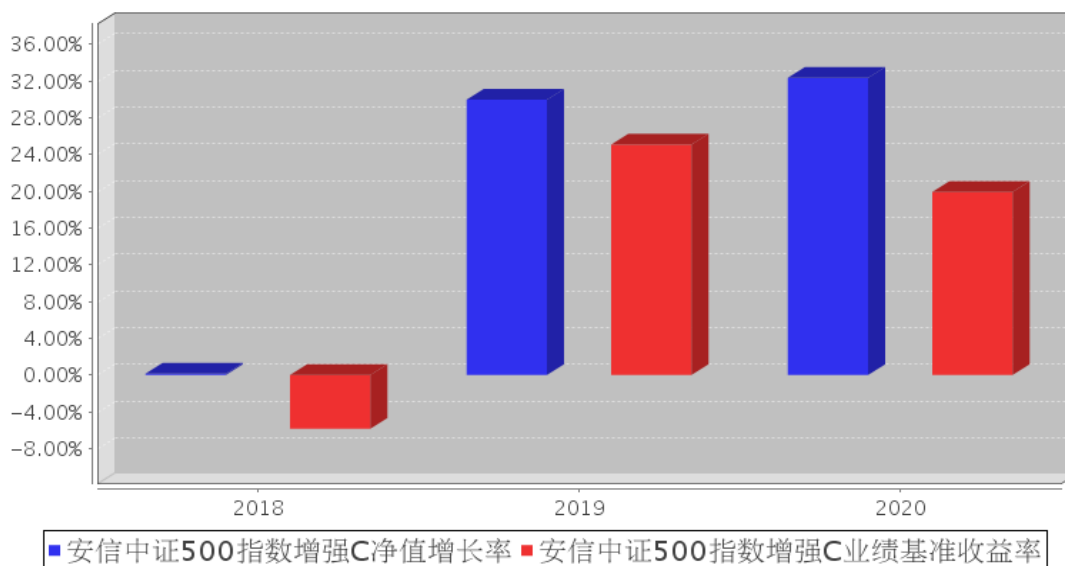
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2018年11月29日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§ 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经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 67 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券

投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金。

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		
徐 黄 玮	本基金的 基金经 理，量 化	2018 年 11 月 29 日	-	13.0 年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量

	<p>投资部总经理</p>				<p>化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、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 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
--	---------------	--	--	--	--

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”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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。

4.1.3 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

2020 年，由于疫情原因，宏观经济呈现出前低后高的趋势，行业景气度从二季度开始回升，以顺周期为代表的行业出现边际好转，大宗商品出现涨价；在流动性充裕情况下，市场风险偏好上升，经济数据上看，下半年持续好转。

本基金在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，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，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

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.7375 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.90%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.7230 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.37%；同期业绩比较基准收益率为 19.94%。

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 2021 年一季度，新冠疫情虽有反复，但整体经济处于恢复轨道中，且流动性相对充裕。我们一直重视的公司的盈利、企业质量、估值、分析师预期、个股事件驱动等指数增强方式将会有较好的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 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，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核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：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、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。

4.8 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。

4.9 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 5000 万的情形，时间范围为自 2020 年 01 月 02 日至 2020 年 07 月 09 日。

本报告期内，本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形，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《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合规守信、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《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 托管人对本年度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“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、2020 年度所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>安信中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

审计报告日期	2021 年 3 月 29 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,737,484.27	531,815.04
结算备付金		134,999.30	437,653.83
存出保证金		80,771.83	23,922.66
交易性金融资产	7.4.7.2	64,274,300.10	32,204,662.22
其中：股票投资		60,826,942.47	30,606,187.22
基金投资		-	-
债券投资		3,447,357.63	1,598,475.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,000,000.00	-
应收证券清算款		730,758.63	38,020.66
应收利息	7.4.7.5	72,700.21	27,307.35
应收股利		-	-
应收申购款		16,920.35	26,206.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		68,047,934.69	33,289,588.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,900,000.00	400,000.00
应付证券清算款		457,903.32	19,121.14
应付赎回款		1,145,757.78	321,894.45
应付管理人报酬		41,579.42	21,666.37
应付托管费		5,197.45	2,708.30
应付销售服务费		17,631.75	9,833.49
应付交易费用	7.4.7.7	91,196.63	89,362.05
应交税费		-	-

应付利息		885.99	190.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	202,575.93	70,064.72
负债合计		3,862,728.27	934,841.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	37,212,585.10	24,847,116.63
未分配利润	7.4.7.10	26,972,621.32	7,507,630.69
所有者权益合计		64,185,206.42	32,354,747.32
负债和所有者权益总计		68,047,934.69	33,289,588.52

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 37,212,585.10 份，其中安信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 4,684,529.56 份，基金份额净值 1.7375 元。安信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 32,528,055.54 份，基金份额净值 1.7230 元。

7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		12,427,488.40	13,460,742.66
1. 利息收入		77,673.87	225,598.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,262.73	80,108.53
债券利息收入		62,333.66	58,038.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		77.48	87,451.68
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,883,731.43	11,190,087.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,484,982.27	9,793,434.99
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,250.73	46,820.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	987,676.31
股利收益	7.4.7.17	389,498.43	362,155.68
3. 公允价值变动收益（损失	7.4.7.18	310,923.39	1,768,943.88

以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)			-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	155,159.71	276,111.94
减: 二、费用		1,818,854.71	1,609,787.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	385,164.70	327,965.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	48,145.64	40,995.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	157,801.13	155,954.12
4. 交易费用	7.4.7.20	905,958.82	857,315.95
5. 利息支出		21,784.30	190.68
其中: 卖出回购金融资产支出		21,784.30	190.68
6. 税金及附加		0.12	6,965.70
7. 其他费用	7.4.7.21	300,000.00	220,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		10,608,633.69	11,850,954.78
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,608,633.69	11,850,954.78

7.3 所有者权益(基金净值)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: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,847,116.63	7,507,630.69	32,354,747.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,608,633.69	10,608,633.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	12,365,468.47	8,856,356.94	21,221,825.41
其中: 1. 基金申购款	51,727,833.47	36,180,385.94	87,908,219.41
2. 基金赎回款	-39,362,365.00	-27,324,029.00	-66,686,394.00

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	37,212,585.10	26,972,621.32	64,185,206.42
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	216,448,168.47	304,045.61	216,752,214.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,850,954.78	11,850,954.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-191,601,051.84	-4,647,369.70	-196,248,421.54
其中：1. 基金申购款	78,425,079.66	14,322,893.31	92,747,972.97
2. 基金赎回款	-270,026,131.50	-18,970,263.01	-288,996,394.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	24,847,116.63	7,507,630.69	32,354,747.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领

范瑛

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

7.4 报表附注

7.4.1 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×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、资产支持证券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同

时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

衍生工具收益是指持有的股指期货合约平仓和到期交割实现的收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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。

7.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	1,737,484.27	531,815.04
定期存款	-	-
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	-	-
合计	1,737,484.27	531,815.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,744,038.20	60,826,942.47	2,082,904.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,449,634.63	3,447,357.63
	银行间市场	-	-
	合计	3,449,634.63	3,447,357.63
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	62,193,672.83	64,274,300.10	2,080,627.27
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	28,836,177.53	30,606,187.22	1,770,009.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,598,780.81	1,598,475.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,598,780.81	1,598,475.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	30,434,958.34	32,204,662.22	1,769,703.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	1,000,000.00	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	340.67	89.56
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	66.88	216.37
应收债券利息	72,252.62	26,989.65
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	40.04	11.77
合计	72,700.21	27,307.35

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	91,196.63	89,362.05
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	91,196.63	89,362.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,575.93	64.72

应付证券出借违约金		-	-
应付信息披露费		80,000.00	-
应付指数使用费		100,000.00	50,000.00
应付审计费		20,000.00	20,000.00
合计		202,575.93	70,064.72

7.4.7.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,153,375.85	2,153,375.85
本期申购	18,503,407.73	18,503,407.73
本期赎回（以“-”号填列）	-15,972,254.02	-15,972,254.02
本期末	4,684,529.56	4,684,529.56

安信中证 500 指数增强 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,693,740.78	22,693,740.78
本期申购	33,224,425.74	33,224,425.74
本期赎回（以“-”号填列）	-23,390,110.98	-23,390,110.98
本期末	32,528,055.54	32,528,055.54

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 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	217,880.90	444,046.79	661,927.69
本期利润	2,506,507.01	-1,187,780.63	1,318,726.38
本期基金份额 交易产生的变 动数	-436,711.91	1,911,072.31	1,474,360.40
其中：基金申 购款	6,187,739.82	6,221,758.19	12,409,498.01
基金赎 回款	-6,624,451.73	-4,310,685.88	-10,935,137.61
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	2,287,676.00	1,167,338.47	3,455,014.47

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	2,178,914.34	4,666,788.66	6,845,703.00
本期利润	7,791,203.29	1,498,704.02	9,289,907.31
本期基金份额交易产生的变动数	5,469,506.71	1,912,489.83	7,381,996.54
其中：基金申购款	14,841,671.68	8,929,216.25	23,770,887.93
基金赎回款	-9,372,164.97	-7,016,726.42	-16,388,891.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,439,624.34	8,077,982.51	23,517,606.85

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	10,151.57	58,615.56
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	10,833.22
结算备付金利息收入	4,435.48	9,826.30
其他	675.68	833.45
合计	15,262.73	80,108.53

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	343,139,935.86	322,200,621.46
减：卖出股票成本总额	331,654,953.59	312,407,186.47
买卖股票差价收入	11,484,982.27	9,793,434.99

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,746,454.41	15,017,849.50
减：卖出债券（、债转股	2,660,954.85	14,819,667.89

及债券到期兑付)成本总额		
减: 应收利息总额	76,248.83	151,360.68
买卖债券差价收入	9,250.73	46,820.93

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2019年1月1日至2019年12月31日
股指期货投资收益	-	987,676.31
合计	-	987,676.31

7.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	389,498.43	362,155.68
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	389,498.43	362,155.68

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	310,923.39	1,768,943.88
股票投资	312,894.58	1,770,009.69
债券投资	-1,971.19	-1,065.81
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	310,923.39	1,768,943.88

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	155,020.49	253,255.10
基金转换费收入	139.22	22,856.84
合计	155,159.71	276,111.94

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	905,958.82	857,315.95
银行间市场交易费用	-	-
合计	905,958.82	857,315.95

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	-	400.00
合计	300,000.00	220,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

金”)	
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
安信证券股份有限公司(“安信证券”)	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(“安信乾盛”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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(%)
安信证券	12,434,103.08	1.77	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31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(%)
安信证券	8,844.67	1.77	8,844.67	9.70
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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(%)
安信证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	385,164.70	327,965.68
其中：支付销售机构的客户维护费	79,842.52	9,043.98

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	48,145.64	40,995.75

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

7.4.10.2.3 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 2020年1月1日至2020年12月31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		94,905.13	94,905.13
安信证券		576.39	576.39
宁波银行		1,302.43	1,302.43
合计		96,783.95	96,783.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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
宁波银行		236.48	236.48
安信基金		148,283.59	148,283.59
安信证券		594.81	594.81
合计		149,114.88	149,114.88

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 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	8,717,635.78
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	-	8,717,635.78
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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	8,717,635.78
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	8,717,635.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	35.09%

注：本基金管理人运用自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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

安信中证 500 指数增强 C

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
安信乾盛	6,000,000.00	16.12	11,726,647.80	47.20

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	1,737,484.27	10,151.57	531,815.04	58,615.56

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	456	6,922.08	6,922.08	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新股锁定	24.87	33.51	120	2,984.40	4,021.20	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股锁定	39.74	60.44	54	2,145.96	3,263.76	-

		日	日							
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股锁 定	29.57	40.67	97	2,868.29	3,944.99	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
113044	大秦转 债	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 15 日	新债未 上市	100.00	100.00	280	27,999.63	27,999.63	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金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为 1,900,000.00 元，于 2021 年 1 月 20 日和 2021 年 1 月 27 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%（2019 年 12 月 31 日：无）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,419,358.00	500,300.00
合计	3,419,358.00	500,300.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	27,999.63	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	1,098,175.00
合计	27,999.63	1,098,175.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.3 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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 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，除在附注 7.4.12 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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。银行存款、结算备付金及债券投资等品种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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,737,484.27	-	-	-	1,737,484.27
结算备付金	134,999.30	-	-	-	134,999.30
存出保证金	80,771.83	-	-	-	80,771.83
交易性金融资产	3,419,358.00	-	27,999.63	60,826,942.47	64,274,300.10
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收利息	-	-	-	72,700.21	72,700.21
应收申购款	-	-	-	16,920.35	16,920.35
应收证券清算款	-	-	-	730,758.63	730,758.63
资产总计	6,372,613.40	-	27,999.63	61,647,321.66	68,047,934.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,145,757.78	1,145,757.78
应付管理人报酬	-	-	-	41,579.42	41,579.42
应付托管费	-	-	-	5,197.45	5,197.45
应付证券清算款	-	-	-	457,903.32	457,903.32
卖出回购金融资产款	1,900,000.00	-	-	-	1,900,000.00
应付销售服务费	-	-	-	17,631.75	17,631.75
应付交易费用	-	-	-	91,196.63	91,196.63
应付利息	-	-	-	885.99	885.99
其他负债	-	-	-	202,575.93	202,575.93
负债总计	1,900,000.00	-	-	1,962,728.27	3,862,728.27
利率敏感度缺口	4,472,613.40	-	27,999.63	59,684,593.39	64,185,206.42
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	531,815.04	-	-	-	531,815.04
结算备付金	437,653.83	-	-	-	437,653.83
存出保证金	23,922.66	-	-	-	23,922.66
交易性金融资产	1,598,475.00	-	-	30,606,187.22	32,204,662.22
应收利息	-	-	-	27,307.35	27,307.35
应收申购款	-	-	-	26,206.76	26,206.76
应收证券清算款	-	-	-	38,020.66	38,020.66
资产总计	2,591,866.53	-	-	30,697,721.99	33,289,588.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	321,894.45	321,894.45
应付管理人报酬	-	-	-	21,666.37	21,666.37
应付托管费	-	-	-	2,708.30	2,708.30
应付证券清算款	-	-	-	19,121.14	19,121.14
卖出回购金融资产款	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,833.49	9,833.49
应付交易费用	-	-	-	89,362.05	89,362.05
应付利息	-	-	-	190.68	190.68
其他负债	-	-	-	70,064.72	70,064.72
负债总计	400,000.00	-	-	534,841.20	934,841.20
利率敏感度缺口	2,191,866.53	-	-	30,162,880.79	32,354,747.32

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
1. 市场利率下降 25 个基点	992.64	1,670.97	
2. 市场利率上升 25 个基点	-984.98	-1,666.31	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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股票和债券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	60,826,942.47	94.77	30,606,187.22	94.60
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	60,826,942.47	94.77	30,606,187.22	94.60

7.4.13.4.3.2 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		
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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	1. 沪深 300 指数上	3,218,887.25	1,557,385.88

	升 5%		
	2. 沪深 300 指数下 降 5%	-3, 218, 887. 25	-1, 557, 385. 88

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 60,802,880.85 元，划分为第二层次的余额为人民币 3,471,419.15 元，无划分为第三层次余额（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 30,601,113.06 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,603,549.16 元，无划分为第三层次余额）。

公允价值所属层次间重大变动

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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	60,826,942.47	89.39
	其中：股票	60,826,942.47	89.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,447,357.63	5.07
	其中：债券	3,447,357.63	5.07
	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	1,000,000.00	1.47
	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	1,872,483.57	2.75
8	其他各项资产	901,151.02	1.32
9	合计	68,047,934.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	338,751.00	0.53
B	采矿业	1,228,510.00	1.91
C	制造业	34,118,610.57	53.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,793,770.00	2.79
E	建筑业	1,077,189.00	1.68
F	批发和零售业	427,574.00	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	684,560.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,616,836.80	4.08
J	金融业	4,052,854.00	6.31
K	房地产业	1,568,553.00	2.44
L	租赁和商务服务业	384,987.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	758,149.00	1.18
N	水利、环境和公共	907,290.00	1.41

	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	421,644.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	306,082.00	0.48
S	综合	156,624.00	0.24
	合计	50,841,984.37	79.21

8.2.2 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	286,235.00	0.45
C	制造业	5,374,485.60	8.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	147,264.00	0.23
E	建筑业	34,645.00	0.05
F	批发和零售业	451,249.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	237,724.00	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,132,456.50	1.76
J	金融业	634,299.00	0.99
K	房地产业	86,100.00	0.13
L	租赁和商务服务业	926,195.00	1.44
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	48,719.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	625,586.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	9,984,958.10	15.56

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	300274	阳光电源	27,100	1,958,788.00	3.05
2	000750	国海证券	222,100	1,301,506.00	2.03
3	002507	涪陵榨菜	29,200	1,235,160.00	1.92
4	002709	天赐材料	10,300	1,069,140.00	1.67
5	002648	卫星石化	39,700	1,036,964.00	1.62
6	002867	周大生	35,400	943,410.00	1.47
7	002926	华西证券	74,300	927,264.00	1.44
8	002064	华峰化学	89,000	898,010.00	1.40
9	002266	浙富控股	197,200	887,400.00	1.38
10	002124	天邦股份	56,300	821,980.00	1.28
11	300482	万孚生物	9,100	811,811.00	1.26
12	001914	招商积余	37,400	805,222.00	1.25
13	000717	韶钢松山	188,200	803,614.00	1.25
14	300115	长盈精密	32,600	803,590.00	1.25
15	000690	宝新能源	105,000	766,500.00	1.19
16	002595	豪迈科技	25,600	759,040.00	1.18
17	300012	华测检测	27,700	758,149.00	1.18
18	000012	南玻A	102,500	756,450.00	1.18
19	000807	云铝股份	98,300	740,199.00	1.15
20	002250	联化科技	30,100	722,099.00	1.13
21	300474	景嘉微	10,300	720,073.00	1.12
22	002557	洽洽食品	13,194	710,496.90	1.11
23	002128	露天煤业	63,800	697,972.00	1.09
24	001872	招商港口	43,000	684,560.00	1.07
25	000883	湖北能源	173,600	673,568.00	1.05
26	002185	华天科技	47,400	645,588.00	1.01
27	300316	晶盛机电	19,500	586,560.00	0.91
28	300618	寒锐钴业	6,100	578,951.00	0.90
29	002936	郑州银行	128,800	574,448.00	0.89
30	300595	欧普康视	7,000	573,440.00	0.89
31	300496	中科创达	4,900	573,300.00	0.89
32	300699	光威复材	6,318	562,617.90	0.88
33	300630	普利制药	13,293	556,843.77	0.87
34	300088	长信科技	59,900	532,511.00	0.83
35	002375	亚厦股份	71,500	531,960.00	0.83
36	002028	思源电气	26,300	527,578.00	0.82
37	002701	奥瑞金	106,600	526,604.00	0.82

38	000630	铜陵有色	197,300	507,061.00	0.79
39	000060	中金岭南	103,800	500,316.00	0.78
40	002925	盈趣科技	7,500	482,475.00	0.75
41	300009	安科生物	32,600	478,568.00	0.75
42	000581	威孚高科	20,400	473,076.00	0.74
43	002056	横店东磁	30,600	464,814.00	0.72
44	002434	万里扬	50,700	452,244.00	0.70
45	002465	海格通信	41,000	444,030.00	0.69
46	002429	兆驰股份	69,100	428,420.00	0.67
47	300244	迪安诊断	12,300	421,644.00	0.66
48	002511	中顺洁柔	20,000	417,400.00	0.65
49	002195	二三四五	168,800	381,488.00	0.59
50	000547	航天发展	13,800	379,500.00	0.59
51	300026	红日药业	82,800	379,224.00	0.59
52	002368	太极股份	13,200	344,652.00	0.54
53	000998	隆平高科	17,100	338,751.00	0.53
54	002110	三钢闽光	49,500	333,135.00	0.52
55	002081	金螳螂	33,900	318,321.00	0.50
56	300285	国瓷材料	7,000	315,770.00	0.49
57	002155	湖南黄金	37,100	315,721.00	0.49
58	002920	德赛西威	3,700	311,318.00	0.49
59	002572	索菲亚	12,000	310,800.00	0.48
60	000513	丽珠集团	7,460	302,130.00	0.47
61	002382	蓝帆医疗	14,300	301,587.00	0.47
62	300058	蓝色光标	48,700	292,200.00	0.46
63	002080	中材科技	11,900	287,742.00	0.45
64	002372	伟星新材	15,300	286,110.00	0.45
65	000021	深科技	14,700	279,447.00	0.44
66	002093	国脉科技	37,100	270,459.00	0.42
67	002390	信邦制药	31,500	267,120.00	0.42
68	002807	江阴银行	61,500	263,220.00	0.41
69	000636	风华高科	7,500	252,750.00	0.39
70	000778	新兴铸管	67,800	249,504.00	0.39
71	002444	巨星科技	8,000	248,880.00	0.39
72	000400	许继电气	16,000	231,360.00	0.36
73	000031	大悦城	51,700	227,480.00	0.35
74	000090	天健集团	38,200	226,908.00	0.35
75	000540	中天金融	71,300	224,595.00	0.35
76	300357	我武生物	2,800	214,760.00	0.33
77	000156	华数传媒	25,000	214,000.00	0.33
78	002948	青岛银行	35,800	212,294.00	0.33
79	002500	山西证券	23,600	211,220.00	0.33

80	002353	杰瑞股份	5,907	206,745.00	0.32
81	002901	大博医疗	2,800	206,444.00	0.32
82	300418	昆仑万维	10,000	199,500.00	0.31
83	000830	鲁西化工	15,400	196,812.00	0.31
84	002138	顺络电子	8,000	196,160.00	0.31
85	002078	太阳纸业	13,100	189,033.00	0.29
86	002670	国盛金控	13,400	184,250.00	0.29
87	002946	新乳业	10,400	183,144.00	0.29
88	002013	中航机电	15,800	180,910.00	0.28
89	002048	宁波华翔	11,300	175,941.00	0.27
90	300315	掌趣科技	33,500	171,185.00	0.27
91	000932	华菱钢铁	35,300	168,734.00	0.26
92	002408	齐翔腾达	19,700	164,692.00	0.26
93	002416	爱施德	22,000	164,120.00	0.26
94	002156	通富微电	6,500	164,060.00	0.26
95	000739	普洛药业	7,000	162,960.00	0.25
96	000402	金融街	25,200	162,540.00	0.25
97	000009	中国宝安	20,800	156,624.00	0.24
98	002019	亿帆医药	8,000	151,440.00	0.24
99	300257	开山股份	11,000	150,150.00	0.23
100	002244	滨江集团	32,400	148,716.00	0.23
101	000563	陕国投A	39,400	148,538.00	0.23
102	000738	航发控制	6,400	146,752.00	0.23
103	000685	中山公用	17,200	142,760.00	0.22
104	000990	诚志股份	12,000	142,320.00	0.22
105	002563	森马服饰	14,000	140,280.00	0.22
106	300017	网宿科技	20,200	139,178.00	0.22
107	000039	中集集团	9,200	137,908.00	0.21
108	002385	大北农	13,700	132,342.00	0.21
109	000975	银泰黄金	14,900	128,289.00	0.20
110	000686	东北证券	11,900	116,858.00	0.18
111	002281	光迅科技	4,000	116,160.00	0.18
112	300001	特锐德	3,900	114,504.00	0.18
113	002221	东华能源	11,200	113,568.00	0.18
114	002423	中粮资本	11,700	113,256.00	0.18
115	300271	华宇软件	4,600	109,802.00	0.17
116	002603	以岭药业	4,100	104,550.00	0.16
117	002373	千方科技	5,400	103,248.00	0.16
118	002273	水晶光电	8,400	97,356.00	0.15
119	000997	新大陆	6,100	93,208.00	0.15
120	002010	传化智联	19,700	92,787.00	0.14
121	300212	易华录	3,012	92,317.80	0.14

122	300133	华策影视	14,900	92,082.00	0.14
123	002815	崇达技术	6,200	89,528.00	0.14
124	300296	利亚德	13,900	88,404.00	0.14
125	000937	冀中能源	20,800	86,528.00	0.13
126	002249	大洋电机	18,800	84,600.00	0.13
127	002223	鱼跃医疗	2,900	81,809.00	0.13
128	000528	柳工	11,000	80,960.00	0.13
129	002831	裕同科技	2,600	79,612.00	0.12
130	000930	中粮科技	9,400	79,148.00	0.12
131	002399	海普瑞	4,400	75,768.00	0.12
132	000027	深圳能源	12,400	75,516.00	0.12
133	002085	万丰奥威	11,500	75,440.00	0.12
134	000543	皖能电力	17,700	73,986.00	0.12
135	000988	华工科技	3,100	71,889.00	0.11
136	000598	兴蓉环境	12,800	61,440.00	0.10
137	000062	深圳华强	4,900	60,956.00	0.09
138	300166	东方国信	5,500	60,225.00	0.09
139	300134	大富科技	5,000	51,650.00	0.08
140	000028	国药一致	1,100	50,380.00	0.08
141	002583	海能达	7,100	43,594.00	0.07
142	002242	九阳股份	1,300	41,652.00	0.06
143	000158	常山北明	6,400	39,680.00	0.06
144	002544	杰赛科技	2,300	38,594.00	0.06
145	002640	跨境通	7,500	38,550.00	0.06
146	002002	鸿达兴业	12,800	38,400.00	0.06
147	300070	碧水源	2,600	19,890.00	0.03
148	002653	海思科	1,000	17,520.00	0.03
149	002957	科瑞技术	400	8,180.00	0.01

8.3.2 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	002027	分众传媒	61,500	607,005.00	0.95
2	300413	芒果超媒	7,700	558,250.00	0.87
3	000733	振华科技	8,700	511,995.00	0.80
4	000001	平安银行	24,300	469,962.00	0.73
5	002821	凯莱英	1,400	418,796.00	0.65
6	000858	五粮液	1,400	408,590.00	0.64
7	300624	万兴科技	7,300	404,347.00	0.63
8	000800	一汽解放	32,800	383,104.00	0.60
9	300253	卫宁健康	20,490	358,575.00	0.56

10	002727	一心堂	10,600	353,086.00	0.55
11	300379	东方通	7,700	351,890.00	0.55
12	300662	科锐国际	5,900	319,190.00	0.50
13	002626	金达威	8,900	308,563.00	0.48
14	000923	河钢资源	11,500	286,235.00	0.45
15	002493	荣盛石化	9,800	270,578.00	0.42
16	300394	天孚通信	4,700	250,651.00	0.39
17	300750	宁德时代	700	245,777.00	0.38
18	000059	华锦股份	42,800	236,256.00	0.37
19	002832	比音勒芬	13,800	224,112.00	0.35
20	300558	贝达药业	1,900	204,003.00	0.32
21	001965	招商公路	28,100	193,609.00	0.30
22	002304	洋河股份	800	188,792.00	0.29
23	002755	奥赛康	13,800	180,228.00	0.28
24	002532	天山铝业	23,800	180,166.00	0.28
25	300450	先导智能	1,800	151,182.00	0.24
26	002608	江苏国信	19,200	147,264.00	0.23
27	300059	东方财富	4,500	139,500.00	0.22
28	000661	长春高新	300	134,673.00	0.21
29	002497	雅化集团	6,000	131,700.00	0.21
30	000725	京东方 A	21,100	126,600.00	0.20
31	002025	航天电器	1,800	117,324.00	0.18
32	002601	龙蟠佰利	3,800	116,926.00	0.18
33	300443	金雷股份	3,400	113,118.00	0.18
34	000785	居然之家	11,700	98,163.00	0.15
35	000002	万科 A	3,000	86,100.00	0.13
36	000703	恒逸石化	6,700	85,760.00	0.13
37	300415	伊之密	6,200	83,018.00	0.13
38	300144	宋城演艺	3,800	67,336.00	0.10
39	002158	汉钟精机	3,900	58,812.00	0.09
40	002332	仙琚制药	4,200	56,112.00	0.09
41	300497	富祥药业	3,700	52,799.00	0.08
42	002044	美年健康	4,300	48,719.00	0.08
43	002352	顺丰控股	500	44,115.00	0.07
44	002050	三花智控	1,500	36,975.00	0.06
45	000628	高新发展	4,100	34,645.00	0.05
46	002335	科华恒盛	1,300	29,042.00	0.05
47	000627	天茂集团	5,100	24,837.00	0.04
48	002959	小熊电器	200	22,670.00	0.04
49	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.03
50	003029	吉大正元	675	17,644.50	0.03
51	003030	祖名股份	456	6,922.08	0.01
52	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

53	002003	伟星股份	600	4,092.00	0.01
54	300884	狄耐克	120	4,021.20	0.01
55	300909	汇创达	97	3,944.99	0.01
56	300908	仲景食品	54	3,263.76	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000750	国海证券	2,747,574.00	8.49
2	002797	第一创业	2,496,036.00	7.71
3	002948	青岛银行	2,443,044.00	7.55
4	002926	华西证券	2,386,489.00	7.38
5	002124	天邦股份	2,316,272.00	7.16
6	002557	洽洽食品	2,178,598.02	6.73
7	000883	湖北能源	2,142,803.00	6.62
8	002507	涪陵榨菜	2,098,687.00	6.49
9	300274	阳光电源	1,938,711.00	5.99
10	002925	盈趣科技	1,931,464.00	5.97
11	000690	宝新能源	1,905,952.00	5.89
12	002416	爱施德	1,882,298.00	5.82
13	000012	南玻A	1,876,292.00	5.80
14	000807	云铝股份	1,861,719.00	5.75
15	002019	亿帆医药	1,858,014.00	5.74
16	002028	思源电气	1,842,806.00	5.70
17	300316	晶盛机电	1,803,472.00	5.57
18	002867	周大生	1,793,545.00	5.54
19	000581	威孚高科	1,752,537.00	5.42
20	002064	华峰化学	1,724,612.00	5.33
21	002185	华天科技	1,710,241.00	5.29
22	300115	长盈精密	1,701,341.00	5.26
23	300088	长信科技	1,692,074.00	5.23
24	002244	滨江集团	1,687,495.00	5.22
25	002127	南极电商	1,678,206.00	5.19
26	001914	招商积余	1,678,047.00	5.19
27	002138	顺络电子	1,652,163.00	5.11
28	002511	中顺洁柔	1,642,918.00	5.08
29	000513	丽珠集团	1,634,919.00	5.05
30	000090	天健集团	1,634,437.40	5.05
31	300012	华测检测	1,633,828.00	5.05
32	000623	吉林敖东	1,629,325.50	5.04
33	002368	太极股份	1,625,201.00	5.02

34	002242	九阳股份	1,614,634.00	4.99
35	300253	卫宁健康	1,605,879.15	4.96
36	300315	掌趣科技	1,589,113.00	4.91
37	300624	万兴科技	1,553,414.80	4.80
38	000001	平安银行	1,540,920.00	4.76
39	603228	景旺电子	1,539,793.88	4.76
40	002821	凯莱英	1,526,047.00	4.72
41	000800	一汽解放	1,525,153.00	4.71
42	001872	招商港口	1,523,743.00	4.71
43	002920	德赛西威	1,505,271.00	4.65
44	002030	达安基因	1,497,051.00	4.63
45	002128	露天煤业	1,471,377.00	4.55
46	002223	鱼跃医疗	1,470,554.00	4.55
47	300595	欧普康视	1,458,170.00	4.51
48	002439	启明星辰	1,456,583.00	4.50
49	002273	水晶光电	1,428,537.00	4.42
50	002056	横店东磁	1,423,771.00	4.40
51	300418	昆仑万维	1,422,248.00	4.40
52	000547	航天发展	1,416,289.00	4.38
53	002385	大北农	1,410,738.00	4.36
54	002500	山西证券	1,401,860.40	4.33
55	300009	安科生物	1,396,905.00	4.32
56	300166	东方国信	1,368,436.00	4.23
57	002221	东华能源	1,365,575.82	4.22
58	300558	贝达药业	1,360,876.20	4.21
59	002595	豪迈科技	1,359,284.00	4.20
60	300482	万孚生物	1,345,760.00	4.16
61	000778	新兴铸管	1,343,244.00	4.15
62	300496	中科创达	1,334,136.00	4.12
63	000717	韶钢松山	1,331,782.00	4.12
64	002936	郑州银行	1,322,792.50	4.09
65	002815	崇达技术	1,322,603.00	4.09
66	002080	中材科技	1,320,148.00	4.08
67	300459	金科文化	1,300,662.00	4.02
68	600909	华安证券	1,297,169.00	4.01
69	002714	牧原股份	1,290,904.60	3.99
70	000718	苏宁环球	1,290,619.00	3.99
71	300630	普利制药	1,285,121.00	3.97
72	002281	光迅科技	1,284,095.00	3.97
73	002233	塔牌集团	1,269,958.00	3.93
74	002353	杰瑞股份	1,265,339.37	3.91
75	300257	开山股份	1,263,120.00	3.90

76	300738	奥飞数据	1,247,268.00	3.85
77	600325	华发股份	1,241,059.00	3.84
78	600155	华创阳安	1,238,754.05	3.83
79	002429	兆驰股份	1,223,576.00	3.78
80	002572	索菲亚	1,220,779.00	3.77
81	002414	高德红外	1,211,814.90	3.75
82	002434	万里扬	1,210,285.00	3.74
83	002444	巨星科技	1,208,666.00	3.74
84	300058	蓝色光标	1,203,393.00	3.72
85	000739	普洛药业	1,203,165.00	3.72
86	300474	景嘉微	1,193,822.00	3.69
87	300244	迪安诊断	1,193,194.00	3.69
88	600167	联美控股	1,188,161.59	3.67
89	002078	太阳纸业	1,183,168.00	3.66
90	300618	寒锐钴业	1,181,353.00	3.65
91	002174	游族网络	1,180,618.00	3.65
92	000600	建投能源	1,178,182.00	3.64
93	002555	三七互娱	1,176,639.00	3.64
94	000988	华工科技	1,161,119.00	3.59
95	002004	华邦健康	1,147,924.00	3.55
96	002465	海格通信	1,147,799.00	3.55
97	000060	中金岭南	1,147,650.00	3.55
98	000021	深科技	1,146,942.55	3.54
99	002375	亚厦股份	1,144,653.00	3.54
100	002266	浙富控股	1,127,729.00	3.49
101	000050	深天马 A	1,118,533.00	3.46
102	002156	通富微电	1,116,378.18	3.45
103	002726	龙大肉食	1,103,442.00	3.41
104	600777	新潮能源	1,098,940.00	3.40
105	300285	国瓷材料	1,097,683.00	3.39
106	000543	皖能电力	1,093,608.00	3.38
107	000932	华菱钢铁	1,082,835.00	3.35
108	002583	海能达	1,080,556.00	3.34
109	600845	宝信软件	1,077,240.00	3.33
110	002648	卫星石化	1,065,996.00	3.29
111	000937	冀中能源	1,052,996.49	3.25
112	000598	兴蓉环境	1,046,841.00	3.24
113	000402	金融街	1,041,452.00	3.22
114	002399	海普瑞	1,037,918.00	3.21
115	603806	福斯特	1,034,083.00	3.20
116	000686	东北证券	1,034,051.00	3.20
117	000537	广宇发展	1,030,278.00	3.18

118	002382	蓝帆医疗	1,028,080.00	3.18
119	002701	奥瑞金	1,024,049.00	3.17
120	000429	粤高速 A	1,020,283.10	3.15
121	600739	辽宁成大	1,010,464.00	3.12
122	002709	天赐材料	994,585.00	3.07
123	300059	东方财富	981,167.00	3.03
124	000400	许继电气	971,769.00	3.00
125	603233	大参林	965,715.00	2.98
126	002214	大立科技	962,126.98	2.97
127	600811	东方集团	952,458.59	2.94
128	000630	铜陵有色	944,660.00	2.92
129	601966	玲珑轮胎	943,964.84	2.92
130	300026	红日药业	942,619.00	2.91
131	600298	安琪酵母	938,599.00	2.90
132	600633	浙数文化	935,913.00	2.89
133	002373	千方科技	935,514.00	2.89
134	002690	美亚光电	931,652.00	2.88
135	000685	中山公用	931,231.00	2.88
136	603444	吉比特	924,493.00	2.86
137	300207	欣旺达	919,284.00	2.84
138	002408	齐翔腾达	918,950.00	2.84
139	000061	农产品	911,230.00	2.82
140	600885	宏发股份	909,816.00	2.81
141	603866	桃李面包	904,338.00	2.80
142	002603	以岭药业	892,196.00	2.76
143	002727	一心堂	885,880.54	2.74
144	002010	传化智联	878,077.00	2.71
145	603707	健友股份	877,918.60	2.71
146	002807	江阴银行	870,740.00	2.69
147	600639	浦东金桥	866,452.00	2.68
148	002352	顺丰控股	861,049.00	2.66
149	002653	海思科	858,923.00	2.65
150	002838	道恩股份	857,974.00	2.65
151	002387	维信诺	856,972.00	2.65
152	600466	蓝光发展	848,882.00	2.62
153	000738	航发控制	848,773.00	2.62
154	002250	联化科技	845,270.00	2.61
155	000975	银泰黄金	844,157.00	2.61
156	002409	雅克科技	838,146.00	2.59
157	600908	无锡银行	837,105.00	2.59
158	000961	中南建设	836,093.96	2.58
159	002155	湖南黄金	835,077.00	2.58

160	601975	招商南油	829,853.00	2.56
161	600673	东阳光	822,941.00	2.54
162	002013	中航机电	820,126.00	2.53
163	601969	海南矿业	816,375.00	2.52
164	300662	科锐国际	816,103.02	2.52
165	002081	金螳螂	812,186.00	2.51
166	600521	华海药业	807,065.00	2.49
167	300523	辰安科技	798,760.00	2.47
168	002027	分众传媒	795,362.00	2.46
169	002110	三钢闽光	794,033.00	2.45
170	000156	华数传媒	789,862.00	2.44
171	601799	星宇股份	786,324.00	2.43
172	002532	天山铝业	781,785.00	2.42
173	600486	扬农化工	779,168.02	2.41
174	002831	裕同科技	771,275.71	2.38
175	002332	仙琚制药	764,727.00	2.36
176	601615	明阳智能	763,536.00	2.36
177	000636	风华高科	762,048.00	2.36
178	600307	酒钢宏兴	756,909.00	2.34
179	002635	安洁科技	753,292.00	2.33
180	000712	锦龙股份	742,892.00	2.30
181	000997	新大陆	734,939.58	2.27
182	000028	国药一致	729,898.00	2.26
183	002423	中粮资本	729,639.00	2.26
184	002048	宁波华翔	729,076.00	2.25
185	300133	华策影视	728,796.00	2.25
186	603712	七一二	722,728.00	2.23
187	002493	荣盛石化	721,759.00	2.23
188	002745	木林森	716,035.00	2.21
189	600787	中储股份	710,271.00	2.20
190	002340	格林美	709,540.00	2.19
191	002901	大博医疗	709,279.00	2.19
192	002152	广电运通	701,915.00	2.17
193	300212	易华录	700,553.68	2.17
194	300390	天华超净	692,134.00	2.14
195	002372	伟星新材	687,519.00	2.12
196	600022	山东钢铁	685,628.00	2.12
197	002768	国恩股份	675,367.00	2.09
198	000528	柳工	674,278.00	2.08
199	601689	拓普集团	671,890.00	2.08
200	000519	中兵红箭	668,451.00	2.07
201	600643	爱建集团	667,746.00	2.06

202	600410	华胜天成	664,768.00	2.05
203	600901	江苏租赁	657,679.12	2.03
204	000031	大悦城	657,625.00	2.03
205	000987	越秀金控	652,474.00	2.02
206	601099	太平洋	648,624.00	2.00
207	600779	水井坊	647,494.00	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。

8.4.2 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	002797	第一创业	2,620,433.00	8.10
2	002948	青岛银行	2,248,599.00	6.95
3	002414	高德红外	2,186,304.61	6.76
4	002127	南极电商	1,920,332.00	5.94
5	000750	国海证券	1,871,517.00	5.78
6	300253	卫宁健康	1,865,727.00	5.77
7	002416	爱施德	1,816,993.00	5.62
8	002925	盈趣科技	1,791,383.00	5.54
9	002019	亿帆医药	1,751,915.00	5.41
10	600845	宝信软件	1,727,464.90	5.34
11	002242	九阳股份	1,702,279.00	5.26
12	000513	丽珠集团	1,668,178.53	5.16
13	000883	湖北能源	1,665,975.00	5.15
14	002273	水晶光电	1,637,633.00	5.06
15	000623	吉林敖东	1,624,211.00	5.02
16	000547	航天发展	1,620,885.27	5.01
17	002439	启明星辰	1,611,356.00	4.98
18	002124	天邦股份	1,592,252.76	4.92
19	002244	滨江集团	1,575,588.19	4.87
20	603228	景旺电子	1,574,498.56	4.87
21	002028	思源电气	1,548,707.96	4.79
22	000718	苏宁环球	1,526,950.00	4.72
23	002353	杰瑞股份	1,512,178.00	4.67
24	603444	吉比特	1,485,596.00	4.59
25	002030	达安基因	1,485,455.60	4.59
26	600521	华海药业	1,470,143.60	4.54
27	002557	洽洽食品	1,468,909.94	4.54
28	002138	顺络电子	1,468,361.00	4.54
29	600155	华创阳安	1,434,434.00	4.43

30	603806	福斯特	1,431,055.00	4.42
31	002926	华西证券	1,426,085.00	4.41
32	000988	华工科技	1,423,421.00	4.40
33	600739	辽宁成大	1,420,535.00	4.39
34	002078	太阳纸业	1,388,017.00	4.29
35	002444	巨星科技	1,369,479.00	4.23
36	000932	华菱钢铁	1,361,847.00	4.21
37	600909	华安证券	1,359,283.00	4.20
38	002714	牧原股份	1,345,094.30	4.16
39	300316	晶盛机电	1,345,014.00	4.16
40	000090	天健集团	1,344,609.00	4.16
41	600325	华发股份	1,342,533.00	4.15
42	002821	凯莱英	1,339,772.00	4.14
43	601966	玲珑轮胎	1,335,319.00	4.13
44	300418	昆仑万维	1,334,919.00	4.13
45	002385	大北农	1,330,920.00	4.11
46	000807	云铝股份	1,321,000.00	4.08
47	000012	南玻A	1,316,392.50	4.07
48	300166	东方国信	1,303,922.00	4.03
49	000581	威孚高科	1,303,196.15	4.03
50	002500	山西证券	1,302,681.00	4.03
51	600633	浙数文化	1,301,834.00	4.02
52	300315	掌趣科技	1,298,881.00	4.01
53	002233	塔牌集团	1,297,454.00	4.01
54	002920	德赛西威	1,290,385.00	3.99
55	002221	东华能源	1,289,972.00	3.99
56	002368	太极股份	1,283,926.83	3.97
57	002223	鱼跃医疗	1,269,449.00	3.92
58	300459	金科文化	1,269,357.00	3.92
59	600885	宏发股份	1,266,322.99	3.91
60	002281	光迅科技	1,260,300.00	3.90
61	600167	联美控股	1,255,451.10	3.88
62	600486	扬农化工	1,244,749.00	3.85
63	000690	宝新能源	1,239,700.27	3.83
64	002080	中材科技	1,230,233.00	3.80
65	002064	华峰化学	1,208,278.84	3.73
66	600777	新潮能源	1,197,236.00	3.70
67	002815	崇达技术	1,192,706.00	3.69
68	000686	东北证券	1,189,141.00	3.68
69	300738	奥飞数据	1,185,771.70	3.66
70	000600	建投能源	1,179,178.00	3.64
71	300285	国瓷材料	1,176,577.00	3.64

72	000061	农产品	1,164,479.00	3.60
73	600298	安琪酵母	1,160,921.00	3.59
74	300558	贝达药业	1,160,581.00	3.59
75	600745	闻泰科技	1,133,659.00	3.50
76	300088	长信科技	1,127,259.00	3.48
77	002384	东山精密	1,126,251.00	3.48
78	002128	露天煤业	1,125,682.00	3.48
79	000778	新兴铸管	1,121,745.00	3.47
80	300624	万兴科技	1,116,748.00	3.45
81	002555	三七互娱	1,116,591.00	3.45
82	000001	平安银行	1,113,627.00	3.44
83	002174	游族网络	1,111,794.00	3.44
84	002511	中顺洁柔	1,108,160.00	3.43
85	002653	海思科	1,103,996.79	3.41
86	002690	美亚光电	1,098,472.00	3.40
87	002004	华邦健康	1,097,648.00	3.39
88	000598	兴蓉环境	1,092,898.00	3.38
89	000800	一汽解放	1,089,553.00	3.37
90	601799	星宇股份	1,087,297.72	3.36
91	600779	水井坊	1,082,455.00	3.35
92	002583	海能达	1,076,470.00	3.33
93	002056	横店东磁	1,069,126.00	3.30
94	000050	深天马 A	1,060,697.00	3.28
95	300014	亿纬锂能	1,052,497.48	3.25
96	002065	东华软件	1,051,969.00	3.25
97	300012	华测检测	1,045,482.00	3.23
98	002726	龙大肉食	1,042,931.00	3.22
99	600811	东方集团	1,041,964.00	3.22
100	300274	阳光电源	1,041,173.60	3.22
101	000537	广宇发展	1,022,986.00	3.16
102	002332	仙琚制药	1,019,703.00	3.15
103	002507	涪陵榨菜	1,012,299.00	3.13
104	603233	大参林	1,011,411.17	3.13
105	300529	健帆生物	1,009,294.33	3.12
106	000429	粤高速 A	1,007,284.57	3.11
107	000543	皖能电力	1,004,409.00	3.10
108	002185	华天科技	990,007.64	3.06
109	603866	桃李面包	989,013.00	3.06
110	600673	东阳光	986,622.00	3.05
111	300257	开山股份	986,054.00	3.05
112	300496	中科创达	979,737.00	3.03
113	002156	通富微电	975,321.64	3.01

114	000937	冀中能源	967,678.00	2.99
115	000961	中南建设	966,040.00	2.99
116	002936	郑州银行	964,848.00	2.98
117	601969	海南矿业	952,596.00	2.94
118	600022	山东钢铁	947,252.00	2.93
119	002373	千方科技	939,472.00	2.90
120	002352	顺丰控股	937,410.00	2.90
121	002214	大立科技	932,550.00	2.88
122	000402	金融街	927,445.00	2.87
123	600639	浦东金桥	925,834.00	2.86
124	300058	蓝色光标	923,608.00	2.85
125	600017	日照港	918,519.00	2.84
126	000739	普洛药业	912,100.00	2.82
127	002709	天赐材料	907,259.00	2.80
128	300595	欧普康视	905,031.00	2.80
129	300115	长盈精密	902,149.00	2.79
130	002465	海格通信	898,131.00	2.78
131	002399	海普瑞	897,693.00	2.77
132	300059	东方财富	886,353.00	2.74
133	600763	通策医疗	880,250.00	2.72
134	002572	索菲亚	873,923.56	2.70
135	001872	招商港口	871,999.00	2.70
136	600901	江苏租赁	870,725.00	2.69
137	002387	维信诺	868,019.00	2.68
138	601975	招商南油	861,595.08	2.66
139	601615	明阳智能	857,581.00	2.65
140	002429	兆驰股份	857,511.00	2.65
141	603707	健友股份	838,384.80	2.59
142	002838	道恩股份	836,586.00	2.59
143	300009	安科生物	833,712.00	2.58
144	002434	万里扬	831,758.00	2.57
145	002867	周大生	830,736.00	2.57
146	600307	酒钢宏兴	827,414.00	2.56
147	600908	无锡银行	824,243.00	2.55
148	000400	许继电气	812,823.00	2.51
149	002745	木林森	803,316.00	2.48
150	601689	拓普集团	802,060.00	2.48
151	002409	雅克科技	801,037.00	2.48
152	600466	蓝光发展	797,632.00	2.47
153	002635	安洁科技	791,448.00	2.45
154	300390	天华超净	786,245.00	2.43
155	600143	金发科技	783,103.00	2.42

156	002408	齐翔腾达	781,458.00	2.42
157	300207	欣旺达	780,375.00	2.41
158	000021	深科技	777,480.00	2.40
159	001914	招商积余	776,118.00	2.40
160	000685	中山公用	770,592.00	2.38
161	002049	紫光国微	757,316.24	2.34
162	603712	七一二	755,599.77	2.34
163	300618	寒锐钴业	752,363.00	2.33
164	601233	桐昆股份	750,138.00	2.32
165	601865	福莱特	735,981.00	2.27
166	002831	裕同科技	733,662.00	2.27
167	002624	完美世界	731,951.00	2.26
168	000878	云南铜业	715,103.00	2.21
169	000738	航发控制	704,941.00	2.18
170	002603	以岭药业	704,468.00	2.18
171	300244	迪安诊断	701,404.00	2.17
172	600787	中储股份	700,624.92	2.17
173	000712	锦龙股份	699,132.00	2.16
174	002595	豪迈科技	697,882.00	2.16
175	000028	国药一致	693,904.00	2.14
176	300523	辰安科技	692,984.10	2.14
177	002013	中航机电	692,705.00	2.14
178	002010	传化智联	691,926.00	2.14
179	002463	沪电股份	691,666.00	2.14
180	300630	普利制药	687,258.00	2.12
181	000006	深振业 A	687,067.56	2.12
182	002371	北方华创	677,340.00	2.09
183	002607	中公教育	677,172.00	2.09
184	002340	格林美	674,696.00	2.09
185	002131	利欧股份	673,034.00	2.08
186	002157	正邦科技	672,149.00	2.08
187	600132	重庆啤酒	671,824.60	2.08
188	000060	中金岭南	666,696.00	2.06
189	300607	拓斯达	665,075.80	2.06
190	002203	海亮股份	662,179.83	2.05
191	002152	广电运通	655,537.00	2.03
192	002532	天山铝业	655,050.00	2.02
193	600410	华胜天成	652,056.00	2.02
194	600643	爱建集团	650,063.00	2.01
195	002493	荣盛石化	649,591.00	2.01

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。

8.4.3 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	361,562,814.26
卖出股票收入（成交）总额	343,139,935.86

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,419,358.00	5.33
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）	27,999.63	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,447,357.63	5.37

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	31,700	3,169,683.00	4.94
2	019640	20 国债 10	2,500	249,675.00	0.39
3	113044	大秦转债	280	27,999.63	0.04

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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除涪陵榨菜（股票代码：002507.SZ）、卫星石化（股票代码：002648 SZ）外其他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。

2020 年 11 月 5 日，重庆市涪陵榨菜集团股份有限公司因环境污染被重庆市涪陵区环境保护局罚款 60 万元【涪环罚[2017]62 号、91 号】。

2020 年 11 月 5 日，重庆市涪陵榨菜集团股份有限公司因未依法履行职责被重庆市涪陵区税务局马武税务所罚款 600 元【涪陵税马武简罚[2019]100090】。

2020 年 11 月 26 日，浙江卫星石化股份有限公司因未及时披露公司重大事件、重大事项未履行审议程序被深圳证券交易所通报批评，被浙江证监局警示【浙江证监局[2020]106 号】。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，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。

8.12.3 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	80,771.83
2	应收证券清算款	730,758.63
3	应收股利	-
4	应收利息	72,700.21
5	应收申购款	16,920.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	901,151.02

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	713	6,570.17	-	-	4,684,529.56	100.00
安信中证 500 指数增强 C	612	53,150.42	29,625,401.37	91.08	2,902,654.17	8.92
合计	1,282	29,026.98	29,625,401.37	79.61	7,587,183.73	20.39

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）。

9.2 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	70,247.71	1.50
	安信中证 500 指数增强 C	-	-
	合计	70,247.71	0.19

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）。

9.3 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

§ 10 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	2,153,375.85	22,693,740.78
本报告期基金总申购 份额	18,503,407.73	33,224,425.74
减: 本报告期基金总 赎回份额	15,972,254.02	23,390,110.98
本报告期基金拆分变 动份额(份额减少以 “-”填列)	-	-
本报告期期末基金份 额总额	4,684,529.56	32,528,055.54

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2020 年 9 月 19 日, 聘任朱广科为总行资产托管部总经理, 免去朱广科的总行资产托管部副总经理(主持工作)职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付的审计费为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	
中泰证券	2	432,070,620.60	61.42%	307,336.04	61.42%	-
大同证券	2	195,515,323.16	27.79%	139,071.46	27.79%	新租
申万宏源	2	32,217,644.04	4.58%	22,913.39	4.58%	-
国盛证券	2	31,251,299.87	4.44%	22,229.68	4.44%	-
安信证券	2	12,434,103.08	1.77%	8,844.67	1.77%	新租
东方财富证券	2	-	-	-	-	新租

注：据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

11.7.2 基金租用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
中泰证券	5,662,089.51	85.81%	18,100,000.00	58.77%	-	-
大同证券	685,259.03	10.38%	8,300,000.00	26.95%	-	-
申万宏源	251,305.00	3.81%	900,000.00	2.92%	-	-
国盛证券	-	-	1,300,000.00	4.22%	-	-
安信证券	-	-	2,200,000.00	7.14%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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暂停泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报	2020-01-14
2	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-01-17
3	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-01-20
4	安信中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年 3 月更新）	中国证券报	2020-03-13
5	安信基金管理有限责任公司关于延期披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-03-25
6	安信基金管理有限责任公司关于暂停北京中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-03-30
7	关于安信基金管理有限责任公司旗下开放式基金在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资和转换等业务的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-01
8	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-20
9	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-28
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下所有开放式基金在直销渠道面向养老金客户开展赎回费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-06-01
11	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-07-17
12	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-08-19
13	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-08-29
14	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增和耕传承基金销	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时	2020-08-31

	售有限公司为基金销售服务机构的公告	报	
15	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中国人寿保险股份有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-09-07
16	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增江苏银行股份有限公司为销售服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-09-11
17	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报	2020-10-26
18	安信基金管理有限责任公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报	2020-11-16

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200101-20200804	8,717,635.78	-	8,717,635.78	-	-
	2	20200101-20200819	11,726,647.80	-	5,726,647.80	6,000,000.00	16.12
	3	20200819-20201231	-	19,054,279.49	-	19,054,279.49	51.20

产品特有风险

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

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

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

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

- (4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 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

2021 年 3 月 29 日