

安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 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规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 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 | 39,541,747.97 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。 | |
| 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 | 4,308,442.18 份 | 35,233,305.79 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（2021 年 7 月 1 日-2021 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 | 706,192.50 | 5,795,181.24 |
| 2. 本期利润 | 272,234.61 | 2,314,617.55 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0684 | 0.0691 |
| 4. 期末基金资产净值 | 8,813,004.94 | 71,254,005.84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.0455 | 2.0223 |

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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

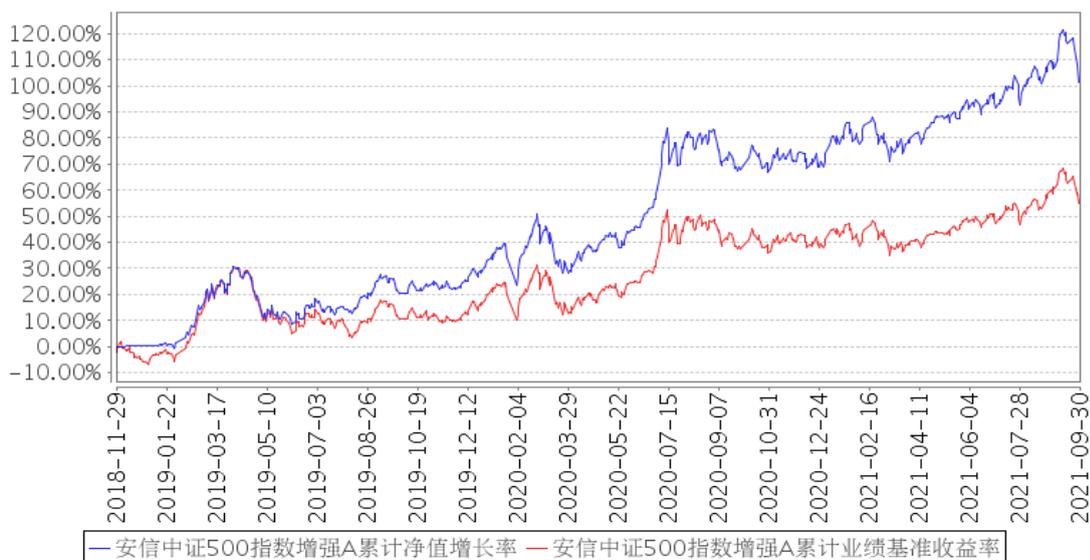
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.75% | 1.21% | 4.14% | 1.07% | -0.39% | 0.14% |
| 过去六个月 | 14.81% | 1.03% | 12.90% | 0.89% | 1.91% | 0.14% |
| 过去一年 | 22.02% | 1.13% | 14.02% | 1.01% | 8.00% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 104.55% | 1.33% | 56.82% | 1.35% | 47.73% | -0.02% |

安信中证 500 指数增强 C

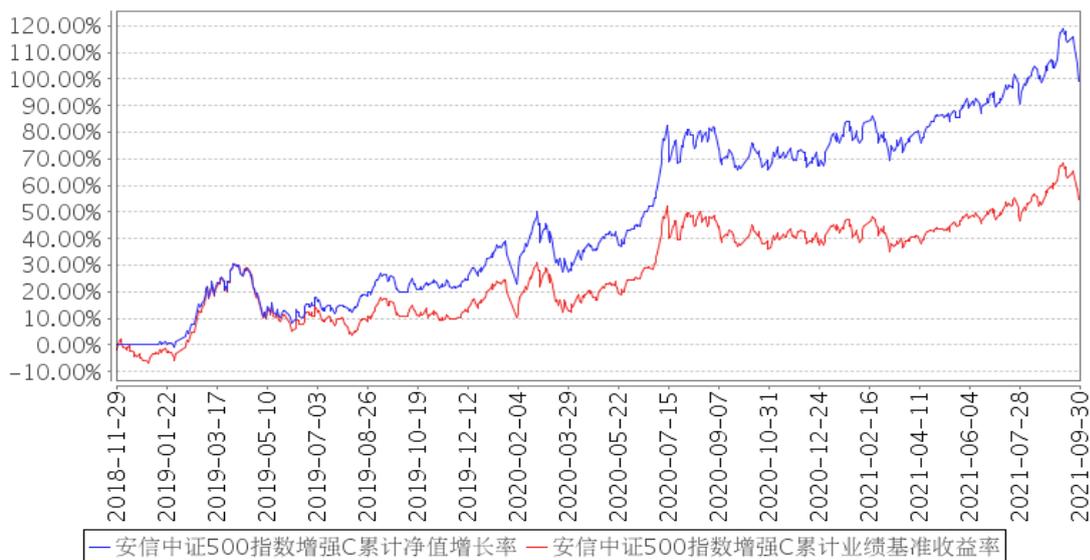
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.65% | 1.21% | 4.14% | 1.07% | -0.49% | 0.14% |
| 过去六个月 | 14.57% | 1.03% | 12.90% | 0.89% | 1.67% | 0.14% |
| 过去一年 | 21.53% | 1.13% | 14.02% | 1.01% | 7.51% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 102.23% | 1.33% | 56.82% | 1.35% | 45.41% | -0.02% |

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。

§ 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 | | |
| 徐黄玮 | 本基金的基金经理，量化投资部总经理 | 2018年11月29日 | - | 14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。 |

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合规守信情况的说明

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

2021 年三季度，受能耗双控等原因，上游周期品价格大幅上扬，工业生产增速继续放缓。消费复苏速度仍然缓慢，其他固定资产投资亦复苏一般，经济压力进一步加大。疫情持续反复，全球经济复苏节奏放缓，国内出口方面亦开始减弱。流动性方面，目前相对宽松，预期后续会松流动性。美国方面，通胀率一直是居高不下，就业情况有所好转，其四季度货币政策方面有一定不确定性。

市场方面，三季度主要是以煤炭等周期为首的上游行业表现较好，主要是碳中和背景下，产品价格上涨带来相关行业盈利水平回升。而限电情况下，部分高耗能行业开工率受到影响，表现较弱。

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，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

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 2.0455 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.75%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 2.0223 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.65%；同期业绩比较基准收益率为 4.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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 | 73,548,213.32 | 88.38 |
| | 其中：股票 | 73,548,213.32 | 88.38 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,290,743.30 | 5.16 |
| | 其中：债券 | 4,290,743.30 | 5.16 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,423,470.78 | 2.91 |
| 8 | 其他资产 | 2,952,729.11 | 3.55 |
| 9 | 合计 | 83,215,156.51 | 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 | 146,596.00 | 0.18 |
| B | 采矿业 | 1,486,325.00 | 1.86 |
| C | 制造业 | 46,344,772.98 | 57.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,608,290.00 | 2.01 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | 909,692.00 | 1.14 |
| F | 批发和零售业 | 872,083.00 | 1.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 573,229.00 | 0.72 |
| H | 住宿和餐饮业 | 119,900.00 | 0.15 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,752,101.00 | 2.19 |
| J | 金融业 | 2,499,963.00 | 3.12 |
| K | 房地产业 | 1,981,486.00 | 2.47 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,264,068.00 | 1.58 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,833,604.00 | 2.29 |
| 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 | 1,578,208.00 | 1.97 |
| S | 综合 | 1,122,030.00 | 1.40 |
| | 合计 | 64,092,347.98 | 80.05 |

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 | 14,447.73 | 0.02 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 7,571,328.14 | 9.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 38,591.48 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 260,277.00 | 0.33 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 625,947.58 | 0.78 |
| J | 金融业 | 391,592.00 | 0.49 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 493,458.00 | 0.62 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,500.24 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 10,587.16 | 0.01 |
| 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 | 8,952.62 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 9,455,865.34 | 11.81 |

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 | 002078 | 太阳纸业 | 115,300 | 1,378,988.00 | 1.72 |
| 2 | 002138 | 顺络电子 | 40,000 | 1,357,200.00 | 1.70 |
| 3 | 000960 | 锡业股份 | 69,100 | 1,299,771.00 | 1.62 |
| 4 | 002465 | 海格通信 | 123,500 | 1,264,640.00 | 1.58 |
| 5 | 300146 | 汤臣倍健 | 44,100 | 1,245,384.00 | 1.56 |
| 6 | 000039 | 中集集团 | 69,700 | 1,242,751.00 | 1.55 |
| 7 | 000636 | 风华高科 | 44,400 | 1,238,316.00 | 1.55 |
| 8 | 000723 | 美锦能源 | 114,000 | 1,227,780.00 | 1.53 |
| 9 | 002266 | 浙富控股 | 150,200 | 1,135,512.00 | 1.42 |
| 10 | 000009 | 中国宝安 | 58,500 | 1,122,030.00 | 1.40 |

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 | 300122 | 智飞生物 | 4,500 | 715,455.00 | 0.89 |
| 2 | 002850 | 科达利 | 5,000 | 651,500.00 | 0.81 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,400 | 633,792.00 | 0.79 |
| 4 | 002274 | 华昌化工 | 49,700 | 567,077.00 | 0.71 |
| 5 | 002254 | 泰和新材 | 27,700 | 534,610.00 | 0.67 |

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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 | 4,290,743.30 | 5.36 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,290,743.30 | 5.36 |

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 | 019645 | 20 国债 15 | 24,200 | 2,422,178.00 | 3.03 |
| 2 | 019649 | 21 国债 01 | 11,500 | 1,150,920.00 | 1.44 |
| 3 | 019654 | 21 国债 06 | 7,170 | 717,645.30 | 0.90 |

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

本基金本报告期末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

报告期内本基金投资的前十名证券除中集集团（股票代码：000039 SZ）、风华高科（股票代码：000636 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。

2021 年 7 月 30 日，中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司因价格垄断被市场监管总局罚款 30 万元【国市监处（2021）43 号】。

2020 年 11 月，广东风华高新科技股份有限公司因环境污染被肇庆市生态环境局通知整改、警告【肇环端违改字（2020）7 号、肇环端罚字（2020）7 号】。

2021 年 8 月 9 日，广东风华高新科技股份有限公司因违反海关监管规定被肇庆海关罚款 4.71 万元【肇关检罚[2020]0003 号】。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 18,359.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,371,768.15 |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息 | 88,083.53 |
| 5 | 应收申购款 | 474,517.75 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,952,729.11 |

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 | 3,806,525.43 | 32,602,400.64 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,739,853.04 | 4,718,426.07 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,237,936.29 | 2,087,520.92 |
| 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 | 4,308,442.18 | 35,233,305.79 |

§ 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

| 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 | 20210701-20210930 | 19,054,279.49 | - | - | 19,054,279.49 | 48.19 |

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。

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

2021 年 10 月 26 日