

# 安信中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期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 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12	投资组合报告附注	48
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>49</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3	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	50
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>50</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>51</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	51
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	52
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>53</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	53
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>53</b>
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	54

## § 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	31,098,949.99 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	6,995,083.05 份	24,103,866.94 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	孙晓奇	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	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	356,971.32	489,187.76
本期利润	539,174.84	893,357.45
加权平均基金份额本期利润	0.0806	0.0941
本期加权平均净值利润率	4.44%	5.27%
本期基金份额净值增长率	4.59%	4.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	3,793,394.31	12,311,345.89
期末可供分配基金份额利润	0.5423	0.5108
期末基金资产净值	12,518,153.62	42,352,630.77
期末基金份额净值	1.7896	1.7571
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	78.96%	75.71%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.15%	0.81%	-0.77%	0.89%	1.92%	-0.08%
过去三个月	-3.97%	0.74%	-5.10%	0.78%	1.13%	-0.04%
过去六个月	4.59%	0.72%	2.20%	0.75%	2.39%	-0.03%
过去一年	-4.63%	0.87%	-6.65%	0.91%	2.02%	-0.04%
过去三年	14.49%	1.14%	2.48%	1.13%	12.01%	0.01%
自基金合同生效起至今	78.96%	1.23%	33.77%	1.26%	45.19%	-0.03%

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
过去一个月	1.12%	0.81%	-0.77%	0.89%	1.89%	-0.08%
过去三个月	-4.06%	0.74%	-5.10%	0.78%	1.04%	-0.04%

过去六个月	4.39%	0.72%	2.20%	0.75%	2.19%	-0.03%
过去一年	-5.01%	0.87%	-6.65%	0.91%	1.64%	-0.04%
过去三年	13.14%	1.13%	2.48%	1.13%	10.66%	0.00%
自基金合同生效起至今	75.71%	1.23%	33.77%	1.26%	41.94%	-0.03%

注：根据《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的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。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信中证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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 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、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原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、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原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、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型

发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 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		
朱舟扬	本基金的基金经理	2021 年 12 月 31 日	-	5 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的基金经理。
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	2023 年 3 月 28 日	16 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。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、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持

有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2023 年上半年，我国经济整体呈现疫情后的复苏状态。然而，海外经济动能有所放缓，美国、欧洲和英国等发达国家的加息进程尚未结束。此外，美国债务上限谈判、银行业危机、部分欧洲国家的罢工和骚乱等事件持续对经济产生不利影响，出口相比去年同期有所放缓。物价整体保持温和上涨，PPI 有所下降。在货币政策方面，环境仍然相对宽松，期间存款利率有所下调，流动性保持充裕，小盘风格持续占优。

市场方面，指数整体呈现波动震荡状态，小盘股表现优异。ChatGPT 相关行业及股票的热度仍然高涨，表现亮眼。

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。

#### 4.4.2 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 1.7896 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.59%；安信中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.7571 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.39%；同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

#### 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 2023 年三季度，产成品去库存有望结束，重新进入加库存周期。国内利率中枢的下移还未结束，消费意愿有望小幅提升。海外方面，需要关注海外经济衰退风险，同时短期美联储偏鹰派，从美国国债市场情况可以判断目前一致预期是短期利率处在高位，长期下跌概率可能很高。

目前指数估值相对历史上的中枢被严重低估，主要原因是美国快速加息导致全球风险偏好降低，压制权益资产的估值。下半年美联储停止加息后，指数估值有望有所恢复。

下半年我们将持续关注估值较低的行业或公司，以及新兴技术带来的投资机会。后面我们将继续重视公司的盈利，困境反转，企业质量，同时关注事件驱动以及分析师预期，贡献超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 6 月 29 日。

自 2022 年 3 月 24 日至 2023 年 6 月 29 日，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 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《中华人民共和国证券投资基金法》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遵规守信、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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：安信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,940,116.51	1,872,169.82

结算备付金		537.16	532.34
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	42,137,865.75	25,599,037.60
其中：股票投资		42,137,865.75	24,343,108.77
基金投资		-	-
债券投资		-	1,255,928.83
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,907,573.03	32,203.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		54,986,092.45	27,503,942.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,934.07	11.86
应付管理人报酬		19,208.08	19,130.89
应付托管费		2,401.01	2,391.35
应付销售服务费		5,673.50	5,572.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	9.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	68,091.40	60,000.00
负债合计		115,308.06	87,116.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	31,098,949.99	16,177,474.15
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	23,771,834.40	11,239,352.34
净资产合计		54,870,784.39	27,416,826.49
负债和净资产总计		54,986,092.45	27,503,942.86

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 31,098,949.99 份，其中安信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 6,995,083.05 份，基金份额净值 1.7896 元；安信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 24,103,866.94 份，基金份额净值 1.7571 元。

## 6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,700,289.96	-7,875,531.00
1. 利息收入		8,670.93	11,390.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,670.93	11,390.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,099,066.26	-7,047,408.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	803,591.81	-7,517,925.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,677.29	24,934.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	266,797.16	445,582.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	586,373.21	-848,462.01
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-



号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	6, 179. 56	8, 948. 38
<b>减: 二、营业总支出</b>		267, 757. 67	460, 879. 66
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	115, 013. 83	216, 339. 89
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	14, 376. 75	27, 042. 48
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	33, 407. 11	67, 666. 25
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	242. 47
其中: 卖出回购金融资产支出		-	242. 47
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-	-
7. 税金及附加		0. 58	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	104, 959. 40	149, 588. 57
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		1, 432, 532. 29	-8, 336, 410. 66
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		1, 432, 532. 29	-8, 336, 410. 66
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1, 432, 532. 29	-8, 336, 410. 66

### 6.3 净资产 (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: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	16, 177, 474. 15	-	11, 239, 352. 34	27, 416, 826. 49
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	16, 177, 474. 15	-	11, 239, 352. 34	27, 416, 826. 49
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	14, 921, 475. 84	-	12, 532, 482. 06	27, 453, 957. 90
(一)、综合收益总额	-	-	1, 432, 532. 29	1, 432, 532. 29
(二)、本期基金份额	14, 921, 475. 84	-	11, 099, 949. 77	26, 021, 425. 61

交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	16,674,711.23	-	12,535,281.07	29,209,992.30
2. 基金赎回款	-1,753,235.39	-	-1,435,331.30	-3,188,566.69
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	31,098,949.99	-	23,771,834.40	54,870,784.39
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	37,993,706.44	-	40,133,286.01	78,126,992.45
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	37,993,706.44	-	40,133,286.01	78,126,992.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,182,698.93	-	-22,143,677.30	-39,326,376.23
(一)、综合收益总额	-	-	-8,336,410.66	-8,336,410.66
(二)、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)	-17,182,698.93	-	-13,807,266.64	-30,989,965.57
其中: 1. 基金申购款	5,091,328.67	-	4,568,391.93	9,659,720.60
2. 基金赎回款	-22,274,027.60	-	-18,375,658.57	-40,649,686.17
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产 (基金净值)	20,811,007.51	-	17,989,608.71	38,800,616.22
---------------------	---------------	---	---------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领	廖维坤	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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （2）增值税

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》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定确定。

## （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业

费附加的单位外) 及地方教育费附加。

#### (4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

#### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	267,408.09
等于：本金	267,358.62
加：应计利息	49.47
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	2,672,708.42
等于：本金	2,672,233.94
加：应计利息	474.48
减：坏账准备	-
合计	2,940,116.51

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	42,116,224.09	-	42,137,865.75	21,641.66
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	42,116,224.09	-	42,137,865.75	21,641.66

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	50,000.00
其他	13,132.00
应付审计费	4,959.40
合计	68,091.40

#### 6.4.7.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,731,321.63	6,731,321.63
本期申购	1,124,101.06	1,124,101.06
本期赎回（以“-”号填列）	-860,339.64	-860,339.64
本期末	6,995,083.05	6,995,083.05

##### 安信中证 500 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,446,152.52	9,446,152.52
本期申购	15,550,610.17	15,550,610.17
本期赎回（以“-”号填列）	-892,895.75	-892,895.75
本期末	24,103,866.94	24,103,866.94

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。



#### 6.4.7.8 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	3,287,499.39	1,498,335.64	4,785,835.03
本期利润	356,971.32	182,203.52	539,174.84
本期基金份额交易产生的变动数	148,923.60	49,137.10	198,060.70
其中：基金申购款	614,245.79	295,367.33	909,613.12
基金赎回款	-465,322.19	-246,230.23	-711,552.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,793,394.31	1,729,676.26	5,523,070.57

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	4,356,448.45	2,097,068.86	6,453,517.31
本期利润	489,187.76	404,169.69	893,357.45
本期基金份额交易产生的变动数	7,465,709.68	3,436,179.39	10,901,889.07
其中：基金申购款	7,946,298.03	3,679,369.92	11,625,667.95
基金赎回款	-480,588.35	-243,190.53	-723,778.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,311,345.89	5,937,417.94	18,248,763.83

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,025.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,640.59
结算备付金利息收入	4.82
其他	-
合计	8,670.93

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	108,046,428.53
减：卖出股票成本总额	106,994,256.84
减：交易费用	248,579.88

买卖股票差价收入	803,591.81
----------	------------

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	235.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,441.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	28,677.29

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,321,949.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,290,278.88
减：应计利息总额	2,171.89
减：交易费用	1,057.39
买卖债券差价收入	28,441.54

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	266,797.16
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	266,797.16
----	------------

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	586,373.21
股票投资	566,425.82
债券投资	19,947.39
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	586,373.21

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,467.26
基金转换费收入	4,712.30
合计	6,179.56

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	104,959.40

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
安信证券	-	-	236,508,039.10	33.58

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	168,226.70	36.43	-	-

注：（1）上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

（2）该类席位租用协议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 market 信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	115,013.83	216,339.89
其中：支付销售机构的客户维护费	22,696.93	41,570.40

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% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,376.75	27,042.48

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% 的年费率逐日计提。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

### 6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	21,667.23	21,667.23
安信证券	-	603.59	603.59
宁波银行	-	364.77	364.77
合计	-	22,635.59	22,635.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	-	22,709.39	22,709.39
安信证券	-	267.14	267.14
宁波银行	-	247.98	247.98
合计	-	23,224.51	23,224.51

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 类基金份额的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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

安信中证 500 指数增强 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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 财富管理 (深圳)有 限公司	8,861,394.07	28.49	6,000,000.00	37.09

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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	267,408.09	1,025.52	424,847.90	5,657.92

注：本基金自 2022 年 3 月 31 日转换为券商结算模式，本报告期内本基金选择东方财富证券作为证券经纪商，本基金的银行存款由托管人宁波银行、证券经纪商东方财富证券保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将



相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：4.58%）。

##### 6.4.13.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	277,406.96
AAA 以下	-	978,521.87
未评级	-	-
合计	-	1,255,928.83

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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,940,116.51	-	-	-	2,940,116.51
结算备付金	537.16	-	-	-	537.16
交易性金融资产	-	-	-	42,137,865.75	42,137,865.75
应收申购款	-	-	-	9,907,573.03	9,907,573.03
资产总计	2,940,653.67	-	-	52,045,438.78	54,986,092.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,934.07	19,934.07
应付管理人报酬	-	-	-	19,208.08	19,208.08
应付托管费	-	-	-	2,401.01	2,401.01
应付销售服务费	-	-	-	5,673.50	5,673.50
其他负债	-	-	-	68,091.40	68,091.40
负债总计	-	-	-	115,308.06	115,308.06
利率敏感度缺口	2,940,653.67	-	-	51,930,130.72	54,870,784.39
上年度末 2022 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	1,872,169.82	-	-	-	1,872,169.82
结算备付金	532.34	-	-	-	532.34
交易性金融资产	-	913,941.13	341,987.70	24,343,108.77	25,599,037.60
应收申购款	-	-	-	32,203.10	32,203.10
资产总计	1,872,702.16	913,941.13	341,987.70	24,375,311.87	27,503,942.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	11.86	11.86
应付管理人报酬	-	-	-	19,130.89	19,130.89
应付托管费	-	-	-	2,391.35	2,391.35
应付销售服务费	-	-	-	5,572.47	5,572.47
应交税费	-	-	-	9.80	9.80
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	87,116.37	87,116.37
利率敏感度缺口	1,872,702.16	913,941.13	341,987.70	24,288,195.50	27,416,826.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	

分 析	1. 市场利率下降 25 个基点	-	13,772.79
	2. 市场利率上升 25 个基点	-	-13,578.09

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	42,137,865.75	76.79	24,343,108.77	88.79
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	42,137,865.75	76.79	24,343,108.77	88.79

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,676,810.36	980,750.76
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,676,810.36	-980,750.76

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	42,137,865.75	25,575,832.60
第二层次	-	23,205.00
第三层次	-	-
合计	42,137,865.75	25,599,037.60

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,137,865.75	76.63
	其中：股票	42,137,865.75	76.63
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	2,940,653.67	5.35
8	其他各项资产	9,907,573.03	18.02
9	合计	54,986,092.45	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	404,714.00	0.74
B	采矿业	1,226,933.00	2.24
C	制造业	21,691,843.33	39.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,655,162.00	4.84
E	建筑业	277,213.00	0.51
F	批发和零售业	1,413,031.84	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	898,075.00	1.64
H	住宿和餐饮业	449,115.00	0.82

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,591,035.98	4.72
J	金融业	3,940,875.00	7.18
K	房地产业	887,913.00	1.62
L	租赁和商务服务业	66,345.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	54,600.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	213,493.00	0.39
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	344,165.00	0.63
S	综合	57,680.00	0.11
	合计	37,172,194.15	67.74

### 7.2.2 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	225,812.00	0.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,791,697.00	5.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,086.00	0.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	60,568.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	10,204.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,321,811.00	2.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	54,205.60	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	129,780.00	0.24
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	162,300.00	0.30
S	综合	68,208.00	0.12
	合计	4,965,671.60	9.05

### 7.2.3 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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	002673	西部证券	85,900	545,465.00	0.99
2	000623	吉林敖东	33,800	542,152.00	0.99
3	300146	汤臣倍健	22,500	539,550.00	0.98
4	002025	航天电器	8,400	535,920.00	0.98
5	600642	申能股份	74,900	523,551.00	0.95
6	600563	法拉电子	3,800	521,740.00	0.95
7	603688	石英股份	4,200	478,128.00	0.87
8	002223	鱼跃医疗	13,200	475,068.00	0.87
9	688777	中控技术	7,441	467,145.98	0.85
10	600528	中铁工业	47,200	466,336.00	0.85
11	603596	伯特利	5,800	459,708.00	0.84
12	600998	九州通	44,268	459,501.84	0.84
13	000155	川能动力	31,700	456,480.00	0.83
14	600258	首旅酒店	23,700	449,115.00	0.82
15	600038	中直股份	10,700	426,074.00	0.78
16	600909	华安证券	91,200	425,904.00	0.78
17	000728	国元证券	64,300	419,236.00	0.76
18	600637	东方明珠	53,500	418,370.00	0.76
19	002568	百润股份	11,500	418,025.00	0.76
20	000750	国海证券	123,600	414,060.00	0.75
21	002273	水晶光电	34,100	407,154.00	0.74
22	600352	浙江龙盛	43,400	405,790.00	0.74
23	002926	华西证券	48,800	405,528.00	0.74
24	600369	西南证券	110,200	402,230.00	0.73
25	600372	中航电子	26,200	397,716.00	0.72
26	000807	云铝股份	31,000	394,630.00	0.72
27	002429	兆驰股份	71,200	391,600.00	0.71
28	000630	铜陵有色	135,100	390,439.00	0.71
29	600316	洪都航空	16,600	389,270.00	0.71
30	600166	福田汽车	113,800	386,920.00	0.71



31	300776	帝尔激光	5,940	385,506.00	0.70
32	603712	七一二	12,600	380,646.00	0.69
33	000988	华工科技	9,800	372,498.00	0.68
34	600663	陆家嘴	37,600	371,112.00	0.68
35	601717	郑煤机	29,400	366,030.00	0.67
36	600566	济川药业	12,600	365,904.00	0.67
37	600282	南钢股份	108,000	363,960.00	0.66
38	000997	新大陆	19,200	362,880.00	0.66
39	601958	金钼股份	32,500	362,375.00	0.66
40	688009	中国通号	62,278	361,212.40	0.66
41	000998	隆平高科	23,500	360,725.00	0.66
42	601139	深圳燃气	49,400	360,126.00	0.66
43	002372	伟星新材	17,400	357,396.00	0.65
44	600549	厦门钨业	18,700	355,861.00	0.65
45	603225	新凤鸣	32,200	355,810.00	0.65
46	601665	齐鲁银行	90,400	354,368.00	0.65
47	603885	吉祥航空	22,900	353,347.00	0.64
48	601969	海南矿业	53,400	351,372.00	0.64
49	301029	怡合达	7,840	350,291.20	0.64
50	688006	杭可科技	11,449	348,851.03	0.64
51	600167	联美控股	49,800	347,106.00	0.63
52	002439	启明星辰	11,400	339,264.00	0.62
53	600546	山煤国际	23,300	337,151.00	0.61
54	601778	晶科科技	67,900	335,426.00	0.61
55	601991	大唐发电	101,200	334,972.00	0.61
56	300026	红日药业	61,700	334,414.00	0.61
57	688390	固德威	2,000	333,720.00	0.61
58	600968	海油发展	107,800	330,946.00	0.60
59	601000	唐山港	92,600	326,878.00	0.60
60	300474	景嘉微	3,600	323,964.00	0.59
61	000563	陕国投 A	106,100	323,605.00	0.59
62	000887	中鼎股份	24,400	319,396.00	0.58
63	600755	厦门国贸	39,900	308,826.00	0.56
64	603786	科博达	4,500	295,650.00	0.54
65	688301	奕瑞科技	995	281,017.85	0.51
66	688521	芯原股份	3,800	273,296.00	0.50
67	002056	横店东磁	14,800	269,508.00	0.49
68	300861	美畅股份	6,100	264,557.00	0.48
69	002244	滨江集团	29,900	263,718.00	0.48
70	601869	长飞光纤	5,700	210,957.00	0.38
71	300115	长盈精密	16,800	200,088.00	0.36
72	600315	上海家化	6,800	197,268.00	0.36
73	000778	新兴铸管	46,700	190,536.00	0.35

74	300850	新强联	5,000	186,900.00	0.34
75	601058	赛轮轮胎	15,700	178,823.00	0.33
76	002195	二三四五	59,700	172,533.00	0.31
77	600329	达仁堂	3,800	170,582.00	0.31
78	600597	光明乳业	15,300	159,120.00	0.29
79	603858	步长制药	7,700	158,543.00	0.29
80	300866	安克创新	1,800	157,500.00	0.29
81	688538	和辉光电	58,900	149,606.00	0.27
82	000967	盈峰环境	28,700	144,935.00	0.26
83	002138	顺络电子	5,600	133,896.00	0.24
84	600959	江苏有线	39,500	133,510.00	0.24
85	603517	绝味食品	3,400	126,310.00	0.23
86	000581	威孚高科	8,000	126,000.00	0.23
87	002850	科达利	900	119,025.00	0.22
88	600580	卧龙电驱	8,000	116,880.00	0.21
89	300438	鹏辉能源	2,400	115,296.00	0.21
90	600398	海澜之家	16,500	113,520.00	0.21
91	002384	东山精密	4,300	111,370.00	0.20
92	600765	中航重机	4,200	111,342.00	0.20
93	600737	中粮糖业	13,800	111,090.00	0.20
94	600535	天士力	7,600	110,276.00	0.20
95	002936	郑州银行	47,600	109,480.00	0.20
96	601577	长沙银行	14,100	109,416.00	0.20
97	603233	大参林	3,900	109,239.00	0.20
98	600582	天地科技	18,700	109,021.00	0.20
99	002939	长城证券	13,400	108,942.00	0.20
100	601966	玲珑轮胎	4,900	108,878.00	0.20
101	600820	隧道股份	18,100	108,781.00	0.20
102	002065	东华软件	15,400	108,724.00	0.20
103	000031	大悦城	29,700	108,702.00	0.20
104	603589	口子窖	2,200	108,570.00	0.20
105	000537	广宇发展	9,300	108,531.00	0.20
106	002353	杰瑞股份	4,300	108,059.00	0.20
107	002518	科士达	2,700	108,027.00	0.20
108	300357	我武生物	3,200	107,616.00	0.20
109	600377	宁沪高速	10,900	107,147.00	0.20
110	600970	中材国际	8,400	107,100.00	0.20
111	601077	渝农商行	29,700	106,623.00	0.19
112	002739	万达电影	8,500	106,590.00	0.19
113	601928	凤凰传媒	9,300	106,020.00	0.19
114	603939	益丰药房	2,800	103,600.00	0.19
115	601098	中南传媒	8,900	103,240.00	0.19
116	300724	捷佳伟创	900	101,115.00	0.18

117	000027	深圳能源	15,000	98,850.00	0.18
118	600901	江苏金租	23,400	96,642.00	0.18
119	600487	亨通光电	6,100	89,426.00	0.16
120	002131	利欧股份	38,500	88,550.00	0.16
121	002203	海亮股份	6,600	79,266.00	0.14
122	600157	永泰能源	51,400	72,988.00	0.13
123	300677	英科医疗	3,300	72,600.00	0.13
124	002506	协鑫集成	24,500	71,785.00	0.13
125	002745	木林森	7,700	70,840.00	0.13
126	000559	万向钱潮	12,900	70,305.00	0.13
127	002266	浙富控股	16,600	68,558.00	0.12
128	600707	彩虹股份	14,300	68,068.00	0.12
129	688385	复旦微电	1,300	65,130.00	0.12
130	002128	电投能源	4,900	64,778.00	0.12
131	600131	国网信通	3,200	64,608.00	0.12
132	002958	青农商行	23,700	64,464.00	0.12
133	600521	华海药业	3,500	64,435.00	0.12
134	600497	驰宏锌锗	12,600	63,252.00	0.12
135	601568	北元集团	12,000	63,240.00	0.12
136	002152	广电运通	5,300	62,116.00	0.11
137	002985	北摩高科	1,400	61,768.00	0.11
138	600170	上海建工	22,800	61,332.00	0.11
139	300748	金力永磁	2,000	59,840.00	0.11
140	600623	华谊集团	9,600	59,808.00	0.11
141	603355	莱克电气	2,300	58,443.00	0.11
142	600673	东阳光	8,000	57,680.00	0.11
143	300088	长信科技	9,500	57,285.00	0.10
144	002340	格林美	8,200	56,662.00	0.10
145	688188	柏楚电子	300	56,568.00	0.10
146	300482	万孚生物	2,100	55,923.00	0.10
147	000636	风华高科	3,600	55,224.00	0.10
148	002797	第一创业	9,600	54,912.00	0.10
149	300012	华测检测	2,800	54,600.00	0.10
150	002078	太阳纸业	5,100	54,519.00	0.10
151	688690	纳微科技	1,401	54,428.85	0.10
152	600879	航天电子	6,400	54,336.00	0.10
153	300003	乐普医疗	2,400	54,264.00	0.10
154	600259	广晟有色	1,500	54,210.00	0.10
155	000039	中集集团	7,800	53,742.00	0.10
156	002249	大洋电机	9,400	53,580.00	0.10
157	600143	金发科技	6,100	53,253.00	0.10
158	000050	深天马 A	5,700	52,326.00	0.10
159	600499	科达制造	4,600	52,256.00	0.10

160	300009	安科生物	5,200	52,000.00	0.09
161	600655	豫园股份	7,500	51,450.00	0.09
162	603338	浙江鼎力	900	50,409.00	0.09
163	300296	利亚德	7,700	50,281.00	0.09
164	600867	通化东宝	4,800	50,112.00	0.09
165	300257	开山股份	3,300	50,061.00	0.09
166	603444	吉比特	100	49,111.00	0.09
167	600161	天坛生物	1,800	48,870.00	0.09
168	600380	健康元	3,800	48,298.00	0.09
169	600298	安琪酵母	1,300	47,073.00	0.09
170	000513	丽珠集团	1,200	46,692.00	0.09
171	601158	重庆水务	8,300	46,148.00	0.08
172	601608	中信重工	10,900	45,889.00	0.08
173	002507	涪陵榨菜	2,500	45,775.00	0.08
174	600873	梅花生物	5,100	45,543.00	0.08
175	300308	中际旭创	300	44,235.00	0.08
176	688819	天能股份	1,200	44,208.00	0.08
177	601880	辽港股份	28,300	44,148.00	0.08
178	600598	北大荒	3,300	43,989.00	0.08
179	600297	广汇汽车	20,800	43,264.00	0.08
180	601016	节能风电	11,700	42,939.00	0.08
181	600409	三友化工	7,600	41,420.00	0.08
182	601828	美凯龙	8,400	40,236.00	0.07
183	600500	中化国际	7,000	38,920.00	0.07
184	000553	安道麦 A	4,600	38,824.00	0.07
185	002408	齐翔腾达	5,900	37,583.00	0.07
186	000709	河钢股份	16,500	37,290.00	0.07
187	600516	方大炭素	6,000	37,200.00	0.07
188	000012	南玻 A	6,200	36,952.00	0.07
189	600008	首创环保	12,700	36,576.00	0.07
190	600848	上海临港	3,000	35,850.00	0.07
191	002385	大北农	5,400	35,640.00	0.06
192	002032	苏泊尔	700	35,000.00	0.06
193	601992	金隅集团	15,700	34,226.00	0.06
194	000089	深圳机场	4,900	34,055.00	0.06
195	000739	普洛药业	1,900	33,706.00	0.06
196	601156	东航物流	2,500	32,500.00	0.06
197	000898	鞍钢股份	11,400	31,692.00	0.06
198	300251	光线传媒	3,500	28,315.00	0.05
199	002624	完美世界	1,600	27,024.00	0.05
200	300058	蓝色光标	2,700	26,109.00	0.05
201	603218	日月股份	1,300	24,687.00	0.04
202	300418	昆仑万维	500	20,140.00	0.04

203	600022	山东钢铁	11,100	15,762.00	0.03
204	300682	朗新科技	400	9,312.00	0.02

### 7.3.2 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	688195	腾景科技	7,200	384,696.00	0.70
2	688662	富信科技	5,500	327,305.00	0.60
3	600841	动力新科	43,400	264,740.00	0.48
4	603579	荣泰健康	12,500	261,500.00	0.48
5	688579	山大地纬	15,800	260,384.00	0.47
6	002777	久远银海	7,300	258,931.00	0.47
7	301117	佳缘科技	3,800	245,556.00	0.45
8	603808	歌力思	18,600	244,218.00	0.45
9	300628	亿联网络	6,600	231,462.00	0.42
10	688109	品茗科技	7,700	199,430.00	0.36
11	688569	铁科轨道	2,200	92,554.00	0.17
12	300624	万兴科技	700	82,005.00	0.15
13	300972	万辰生物	1,800	79,812.00	0.15
14	002772	众兴菌业	6,800	76,840.00	0.14
15	002865	钧达股份	500	76,265.00	0.14
16	002170	芭田股份	10,600	72,822.00	0.13
17	301256	华融化学	8,200	72,652.00	0.13
18	002489	浙江永强	17,900	72,495.00	0.13
19	000531	穗恒运 A	9,900	71,577.00	0.13
20	002546	新联电子	11,600	71,340.00	0.13
21	600509	天富能源	8,900	69,509.00	0.13
22	002233	塔牌集团	9,000	69,480.00	0.13
23	301158	德石股份	4,000	69,240.00	0.13
24	002458	益生股份	5,600	69,160.00	0.13
25	301168	通灵股份	1,100	68,530.00	0.12
26	600603	广汇物流	9,800	68,208.00	0.12
27	300908	仲景食品	1,500	68,025.00	0.12
28	002093	国脉科技	7,900	66,676.00	0.12
29	002033	丽江股份	6,000	65,280.00	0.12
30	603136	天目湖	2,500	64,500.00	0.12
31	600728	佳都科技	9,200	63,756.00	0.12
32	002852	道道全	4,900	63,357.00	0.12
33	000829	天音控股	6,700	60,568.00	0.11
34	603083	剑桥科技	900	56,601.00	0.10
35	002858	力盛体育	2,400	55,056.00	0.10
36	002338	奥普光电	1,100	46,365.00	0.08
37	000063	中兴通讯	800	36,432.00	0.07

38	300002	神州泰岳	2,200	30,800.00	0.06
39	002027	分众传媒	4,300	29,283.00	0.05
40	300634	彩讯股份	1,100	29,040.00	0.05
41	300133	华策影视	4,000	28,360.00	0.05
42	688308	欧科亿	700	28,000.00	0.05
43	300413	芒果超媒	800	27,368.00	0.05
44	002230	科大讯飞	400	27,184.00	0.05
45	300788	中信出版	800	26,568.00	0.05
46	300229	拓尔思	1,000	25,970.00	0.05
47	603019	中科曙光	500	25,450.00	0.05
48	300364	中文在线	1,400	24,948.00	0.05
49	605168	三人行	290	24,922.60	0.05
50	000977	浪潮信息	500	24,250.00	0.04
51	688041	海光信息	300	20,481.00	0.04
52	300785	值得买	650	17,017.00	0.03
53	600488	津药药业	2,400	13,488.00	0.02
54	688359	三孚新科	100	7,400.00	0.01
55	688190	云路股份	100	7,300.00	0.01
56	300638	广和通	300	6,804.00	0.01
57	300845	捷安高科	300	6,519.00	0.01
58	000999	华润三九	100	6,066.00	0.01
59	601333	广深铁路	1,300	5,148.00	0.01
60	600026	中远海能	400	5,056.00	0.01
61	002212	天融信	500	4,850.00	0.01
62	603613	国联股份	100	3,693.00	0.01
63	688063	派能科技	12	2,379.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600563	法拉电子	768,653.00	2.80
2	002926	华西证券	718,379.00	2.62
3	300146	汤臣倍健	673,560.00	2.46
4	600528	中铁工业	672,519.00	2.45
5	002223	鱼跃医疗	609,127.00	2.22
6	002025	航天电器	599,879.00	2.19
7	000988	华工科技	598,836.00	2.18
8	000728	国元证券	598,795.00	2.18
9	600637	东方明珠	591,688.00	2.16
10	688777	中控技术	588,562.47	2.15
11	002673	西部证券	582,237.00	2.12

12	600298	安琪酵母	581,608.00	2.12
13	000623	吉林敖东	578,332.00	2.11
14	600998	九州通	578,297.00	2.11
15	600258	首旅酒店	569,638.99	2.08
16	000630	铜陵有色	568,728.00	2.07
17	300026	红日药业	563,707.00	2.06
18	600968	海油发展	562,274.00	2.05
19	603596	伯特利	561,523.00	2.05
20	600642	申能股份	543,462.00	1.98

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000999	华润三九	854,450.00	3.12
2	688289	圣湘生物	559,727.24	2.04
3	600298	安琪酵母	525,179.00	1.92
4	600535	天士力	497,663.00	1.82
5	601555	东吴证券	485,802.00	1.77
6	300073	当升科技	480,607.00	1.75
7	600380	健康元	476,251.00	1.74
8	300182	捷成股份	458,860.00	1.67
9	600820	隧道股份	453,179.00	1.65
10	002048	宁波华翔	452,726.00	1.65
11	603228	景旺电子	449,918.00	1.64
12	601607	上海医药	445,966.00	1.63
13	002281	光迅科技	434,680.00	1.59
14	600160	巨化股份	427,912.00	1.56
15	603613	国联股份	422,901.30	1.54
16	300604	长川科技	410,423.00	1.50
17	300296	利亚德	408,947.00	1.49
18	300088	长信科技	407,795.00	1.49
19	601098	中南传媒	407,615.00	1.49
20	002396	星网锐捷	396,931.00	1.45

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	124,222,588.00
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	108,046,428.53
--------------	----------------

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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。



### 7.11.2 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。

### 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除西部证券（代码：002673 SZ）、鱼跃医疗（代码：002223 SZ）、中控技术（代码：688777 SH）、中铁工业（代码：600528 SH）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。

##### 1. 西部证券股份有限公司

2023 年 6 月 25 日，西部证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件、内部制度不完善被中国证券监督管理委员会陕西监管局出具警示函。

##### 2. 江苏鱼跃医疗设备股份有限公司

2023 年 1 月 31 日，江苏鱼跃医疗设备股份有限公司因违规经营、提供虚假资料证明文件被镇江市市场监督管理局罚款。

2023 年 2 月 1 日，江苏鱼跃医疗设备股份有限公司因违规经营被镇江市市场监督管理局罚款、责令改正。

2023 年 2 月 2 日，江苏鱼跃医疗设备股份有限公司因违规经营被山西省朔州市市场监督管理局罚款、责令改正。

##### 3. 浙江中控技术股份有限公司

2022 年 10 月 26 日，浙江中控技术股份有限公司因违反《中华人民共和国消防法》第十六条第一款第二项等规定被地方应急厅处以 5000 元罚款。

##### 4. 中铁高新工业股份有限公司

2022 年 8 月-2023 年 5 月，中铁高新工业股份有限公司因未依法履行职责、违反税收管理规定被国家税务总局平江县税务局税源管理股责令改正。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,907,573.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,907,573.03

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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。

##### 7.12.5.2 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。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	937	7,465.40	50,418.54	0.72	6,944,664.51	99.28
安信中证 500 指数增强 C	1,043	23,110.13	8,970,160.58	37.21	15,133,706.36	62.79

合计	1,915	16,239.66	9,020,579.12	29.01	22,078,370.87	70.99
----	-------	-----------	--------------	-------	---------------	-------

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）。

### 8.2 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	744,003.11	10.64
	安信中证 500 指数增强 C	4,130.11	0.02
	合计	748,133.22	2.41

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）。

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信中证 500 指数增强 A	50~100
	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	50~100
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	10~50
	安信中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50

## § 9 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	6,731,321.63	9,446,152.52
本报告期基金总申购份额	1,124,101.06	15,550,610.17
减：本报告期基金总赎回份额	860,339.64	892,895.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,995,083.05	24,103,866.94

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 5 月 20 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第十六次会议审议通过，张翼飞先生自 2023 年 5 月 18 日起担任公司副总经理。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 (%)	
东方财富证券	2	232,170,273.03	100.00	123,253.84	100.00	-

注：1、本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择东方财富证券作为证券经纪商。使用本交易单元产生的股票交易佣金已逐笔扣收。

2、股票交易佣金费率为 0.06%，交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、征管费、深圳过户费、风险金），但不包括印花税、上海过户费、港股通交易相关费用等税费。

### 10.7.2 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 (%)
东方财富证券	1,321,949.70	100.00	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-01-19
2	2023 年度 安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报	2023-03-29
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-03-30
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-04-21
5	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-20
6	安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230101-20230630	6,000,000.00	2,861,394.07	-	8,861,394.07	28.49

#### 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中证 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。

### 12.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 29 日