

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 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 2024 年 1 月 1 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	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	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	47
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	64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 市场中性策略执行情况	67
8.13 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	安信阿尔法定开混合	
基金主代码	005280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,732,113.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
下属分级基金的交易代码	005280	009624
报告期末下属分级基金的份额总额	26,187,915.82 份	18,544,197.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用 Alpha 多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建 Alpha 股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	<p>本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p>

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	张姗
	联系电话	0755-82509999	400-61-95555
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008-088-088	400-61-95555
传真		0755-82799292	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		刘入领	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

§ 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	2024 年		2023 年		2022 年	
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
本期已实现收益	-2,408,466.28	-1,716,937.35	338,775.32	97,886.77	-604,191.97	-495,412.89
本期利润	-741,443.92	-683,174.25	195,463.32	-154,163.82	-3,681,324.41	-1,097,086.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0271	-0.0384	0.0066	-0.0102	-0.0492	-0.0543

本期加权平均净值利润率	-2.30%	-3.34%	0.55%	-0.88%	-4.10%	-4.58%
本期基金份额净值增长率	-2.59%	-3.18%	0.41%	-0.22%	-3.52%	-4.10%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	2,262,927.85	1,052,777.90	5,219,316.26	2,640,364.31	5,763,902.28	1,266,321.78
期末可供分配基金份额利润	0.0864	0.0568	0.1784	0.1532	0.1648	0.1471
期末基金资产净值	30,122,887.52	20,762,592.75	34,553,312.66	19,924,023.98	41,142,113.43	9,979,110.58
期末基金份额净值	1.1503	1.1196	1.1809	1.1564	1.1761	1.1589
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	15.03%	2.03%	18.09%	5.39%	17.61%	5.61%

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

安信阿尔法定开混合 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	0.38%	0.41%	0.38%	0.00%	0.00%	0.41%
过去六个月	-3.69%	0.36%	0.76%	0.00%	-4.45%	0.36%
过去一年	-2.59%	0.31%	1.50%	0.00%	-4.09%	0.31%

过去三年	-5.64%	0.23%	4.50%	0.00%	-10.14%	0.23%
过去五年	11.18%	0.24%	7.51%	0.00%	3.67%	0.24%
自基金合同生效起至今	15.03%	0.22%	10.62%	0.00%	4.41%	0.22%

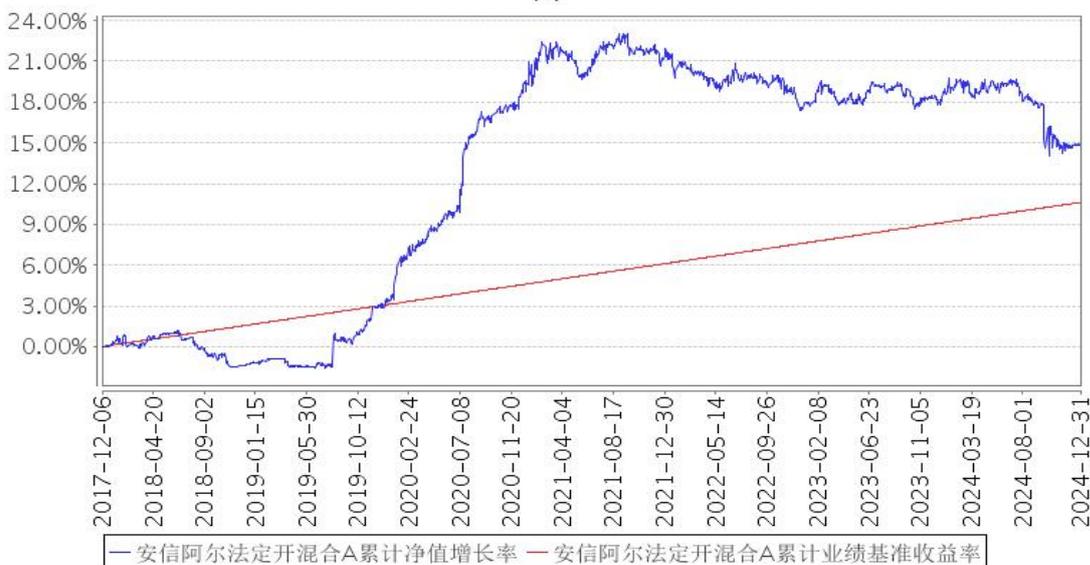
安信阿尔法定开混合 C

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	0.22%	0.41%	0.38%	0.00%	-0.16%	0.41%
过去六个月	-3.99%	0.36%	0.76%	0.00%	-4.75%	0.36%
过去一年	-3.18%	0.31%	1.50%	0.00%	-4.68%	0.31%
过去三年	-7.36%	0.23%	4.50%	0.00%	-11.86%	0.23%
自基金合同生效起至今	2.03%	0.24%	6.83%	0.00%	-4.80%	0.24%

注：根据《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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

安信阿尔法定开混合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



安信阿尔法定开混合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



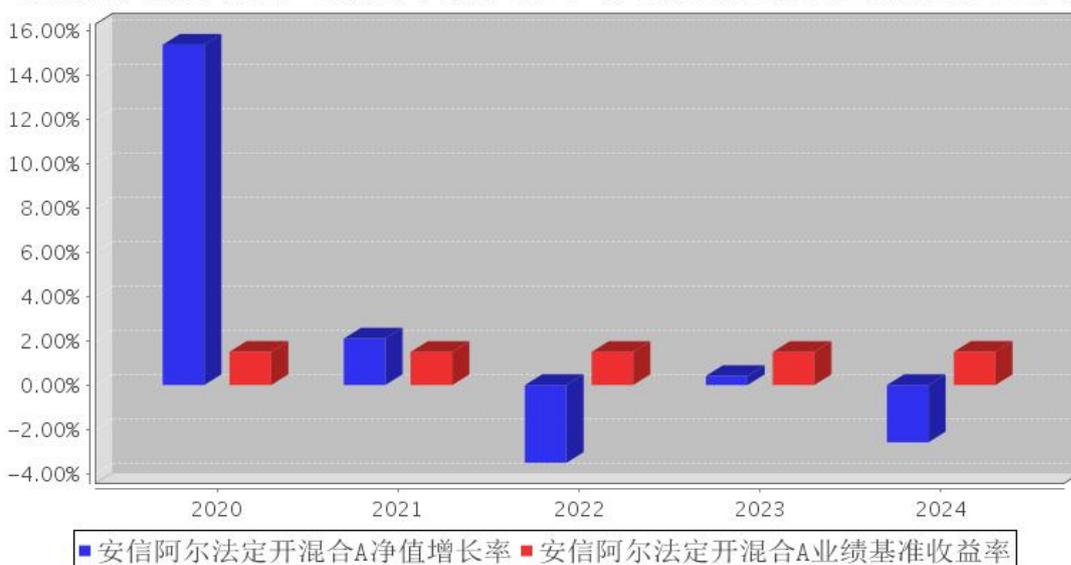
注：1、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 日。

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。

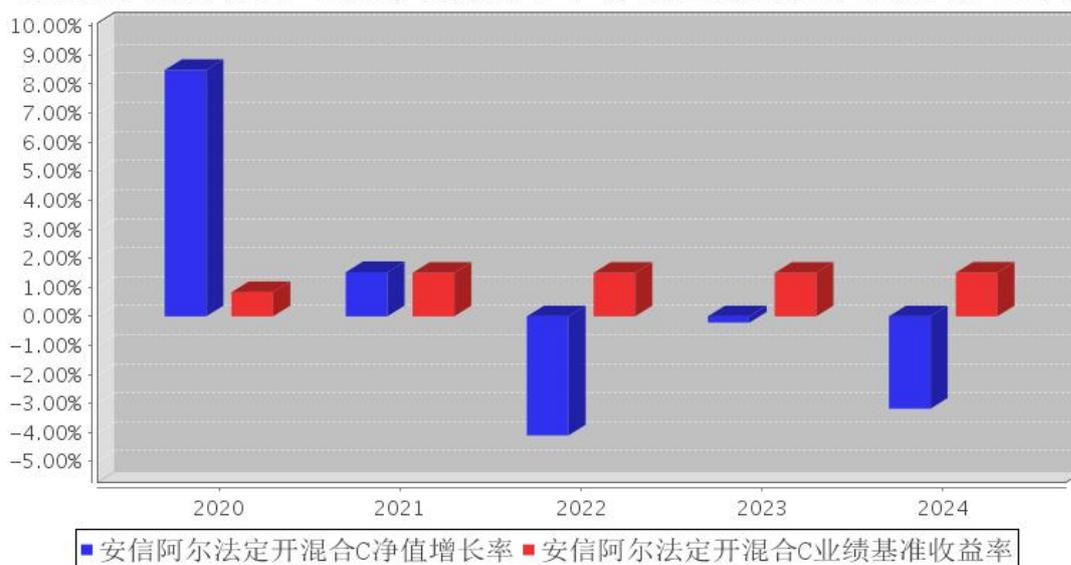
3、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

3.2.3 过去五年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

安信阿尔法定开混合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



安信阿尔法定开混合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

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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，国投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 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 95 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、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金、安信远见稳进一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金、安信医药创新股票型发起式证券投资基金、安信周期优选股票型发起式证券投资基金。

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		
邱家庆	本基金的基金经理	2023 年 9 月 12 日	-	12 年	邱家庆先生，经济学硕士，历任安信基金管理有限责任公司特定资产管理部研究员，华润元大基金管理有限公司基金投资管理部基金经理助理，五矿证券有限公司总部资管量化投资部投资主办人、量化团队负责人，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理、量化投资部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信稳健阿尔法定期开放混合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

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

本基金主要采用对冲策略，构建完组合底仓后，运用股指期货对冲系统性风险，以赚取正收益为目标。

2024 年是极为特殊的一年，市场动态频繁且超出预期。年初，小微盘股出现系统性崩溃，但 2 月市场强劲反弹；5 月红利股回调，6 至 8 月市场持续低迷；9 月市场政策急剧转变，引发剧烈反弹；10 月市场剧烈波动，11 月和 12 月指数回归震荡，主题和概念板块活跃。这一年，中性策略面临前所未有的挑战：年初年化基差为 -20%，而到 9 月底飙升至 30%。

1 月小盘股市场剧烈波动时，我们的投资组合表现出较强抗风险能力，未受显著影响。这主要得益于我们聚焦于沪深 300 和中证 500 指数期货的对冲策略，未配置小微盘股，从而有效避免了小盘股波动对组合的负面影响。

9 月和 10 月，市场出现报复性反弹，大量场外资金通过 ETF 涌入股市。原本高波动、高换手

的股票在短期内表现出色，但长期来看是负 Alpha。受基差和超额收益回撤的双重影响，中性产品遭受显著回撤。按照统计规律，市场理性恢复后，超额收益通常会迅速恢复。但此次情况特殊：市场横盘震荡，成交额居高不下，投资者热情持续高涨，导致超额收益恢复缓慢。

全年来看，组合虽有一定超额收益，但未能覆盖负基差的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信阿尔法定开混合 A 基金份额净值为 1.1503 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.59%；安信阿尔法定开混合 C 基金份额净值为 1.1196 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.18%；同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

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 2025 年，本基金采取的中性策略仍将面临负基差的挑战。为此，我们将采取以下策略应对：

- 1、积极的基差管理策略。基差管理已被实践证明能够有效控制回撤并平滑产品业绩曲线。
- 2、灵活的风险敞口管理。适当放松风险敞口限制，同时控制个股偏离，以平衡跟踪误差与超额收益。我们将在收益与回撤之间寻找新的平衡点，力争使超额收益能够覆盖负基差的影响。
- 3、积极的敞口管理策略。我们认为 2024 年已在构筑“政策底”，故对后市保持乐观。我们将积极寻求做多机会，通过适度暴露风险敞口来对冲基差的负面影响。

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。

4.8 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五千万元的情形，时间范围为 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 12 月 19 日。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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，公允反映了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</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，我们独立于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金，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>安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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。</p> <p>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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>

货币资金	7.4.7.1	1,759,897.78	3,441,409.60
结算备付金		7,689,452.10	3,627,429.02
存出保证金		3,233,594.77	4,699,208.62
交易性金融资产	7.4.7.2	27,286,962.23	42,985,450.56
其中：股票投资		27,286,962.23	40,977,737.37
基金投资		-	-
债券投资		-	2,007,713.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	10,999,214.93	2,600,000.00
应收清算款		1,570.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		50,970,691.95	57,353,497.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	2,600,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		42,380.60	44,706.38
应付托管费		8,476.14	8,941.29
应付销售服务费		10,266.29	9,705.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	29,031.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	24,088.65	183,777.16
负债合计		85,211.68	2,876,161.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	44,732,113.16	46,490,870.52
未分配利润	7.4.7.8	6,153,367.11	7,986,466.12
净资产合计		50,885,480.27	54,477,336.64
负债和净资产总计		50,970,691.95	57,353,497.80

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 44,732,113.16 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额为 26,187,915.82 份，基金份额净值 1.1503 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额

总额为 18,544,197.34 份，基金份额净值 1.1196 元。

7.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-577,512.23	930,120.25
1. 利息收入		263,737.32	189,158.17
其中：存款利息收入	7.4.7.9	119,441.03	68,020.86
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		144,296.29	121,137.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-3,548,316.36	1,135,236.80
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-986,945.16	-3,476,476.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	42,401.11	224,676.57
资产支持证券投 资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-3,374,229.85	3,711,487.60
股利收益	7.4.7.15	770,457.54	675,549.31
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）	7.4.7.16	2,700,785.46	-395,362.59
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	6,281.35	1,087.87
减：二、营业总支出		847,105.94	888,820.75
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	527,746.92	528,507.62
2. 托管费	7.4.10.2.2	105,549.42	122,324.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	122,609.83	105,157.34
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	374.47
其中：卖出回购金融资产支出		-	374.47
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		12,163.59	13,466.95
8. 其他费用	7.4.7.19	79,036.18	118,989.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,424,618.17	41,299.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,424,618.17	41,299.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,424,618.17	41,299.50

7.3 净资产变动表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	46,490,870.52	-	7,986,466.12	54,477,336.64
二、本期期初净资产	46,490,870.52	-	7,986,466.12	54,477,336.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,758,757.36	-	-1,833,099.01	-3,591,856.37
（一）、综合收益总额	-	-	-1,424,618.17	-1,424,618.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,758,757.36	-	-408,480.84	-2,167,238.20
其中：1. 基金申购款	11,054,916.23	-	1,799,517.83	12,854,434.06
2. 基金赎回款	-12,813,673.59	-	-2,207,998.67	-15,021,672.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	44,732,113.16	-	6,153,367.11	50,885,480.27
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01
二、本期期初净资产	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,899,313.46	-	456,799.17	3,356,112.63
(一)、综合收益总额	-	-	41,299.50	41,299.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,899,313.46	-	415,499.67	3,314,813.13
其中：1. 基金申购款	31,201,735.38	-	5,327,185.16	36,528,920.54
2. 基金赎回款	-28,302,421.92	-	-4,911,685.49	-33,214,107.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,490,870.52	-	7,986,466.12	54,477,336.64

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金（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 2015 年 11 月 20 日下发的中国证监会证监许可[2015]2684 号文“关于准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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，以定期开放方式运行，存续期限不定。本基金募集期间为 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 30 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(2017)验字 60962175_H11 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,298,649.48 份，其中认购资金利息折合 143.77 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2020 年 5 月 28 日发布的《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》以及更新的《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本基金自 2020 年 6 月 12 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，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《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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的相关规定）。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：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之

间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

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、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 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〉》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。

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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

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 日起至 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于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，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以

单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值；

(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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金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）占净资产比例计算的金额。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）占净资产比例计算的金额。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

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金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自动转为该类别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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。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净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

(1) 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征增值税试点的通知》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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税（如适用）

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‰，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,759,897.78	3,441,409.60
等于：本金	1,759,607.38	3,440,798.26
加：应计利息	290.40	611.34
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,759,897.78	3,441,409.60

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		25,479,998.00	-	27,286,962.23	1,806,964.23
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		25,479,998.00	-	27,286,962.23	1,806,964.23
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		40,855,909.21	-	40,977,737.37	121,828.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,001,999.99	882.59	2,007,713.19	4,830.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,001,999.99	882.59	2,007,713.19	4,830.61
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,857,909.20	882.59	42,985,450.56	126,658.77

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-26,493,760.00	-	-	-
	-26,493,760.00	-	-	-

其中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-26,493,760.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-38,450,580.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-38,450,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-38,450,580.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	-4.00	-4,575,680.00	137,560.00
IC2502	IC2502	-1.00	-1,139,680.00	33,400.00
IC2503	IC2503	-2.00	-2,270,160.00	34,400.00
IF2501	IF2501	-6.00	-7,089,840.00	-34,200.00
IF2502	IF2502	-1.00	-1,181,700.00	19,080.00
IF2503	IF2503	-9.00	-10,632,600.00	231,300.00
IH2503	IH2503	1.00	808,740.00	-8,700.00
合计				412,840.00
减：可抵销期货暂收款				412,840.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

(2) 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,999,214.93	-
银行间市场	-	-
合计	10,999,214.93	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,600,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	9,588.65	79,277.16
其中：交易所市场	9,588.65	79,277.16
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	-	80,000.00
应付审计费	10,000.00	20,000.00
应付银行间账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	24,088.65	183,777.16

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,261,125.03	29,261,125.03
本期申购	5,854,345.88	5,854,345.88
本期赎回（以“-”号填列）	-8,927,555.09	-8,927,555.09
本期末	26,187,915.82	26,187,915.82

安信阿尔法定开混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,229,745.49	17,229,745.49
本期申购	5,200,570.35	5,200,570.35
本期赎回（以“-”号填列）	-3,886,118.50	-3,886,118.50
本期末	18,544,197.34	18,544,197.34

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,219,316.26	72,871.37	5,292,187.63
本期期初	5,219,316.26	72,871.37	5,292,187.63
本期利润	-2,408,466.28	1,667,022.36	-741,443.92
本期基金份额交易产生的变动数	-547,922.13	-67,849.88	-615,772.01
其中：基金申购款	948,780.83	51,212.35	999,993.18
基金赎回款	-1,496,702.96	-119,062.23	-1,615,765.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,262,927.85	1,672,043.85	3,934,971.70

安信阿尔法定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,640,364.31	53,914.18	2,694,278.49
本期期初	2,640,364.31	53,914.18	2,694,278.49
本期利润	-1,716,937.35	1,033,763.10	-683,174.25
本期基金份额交易产生的变动数	129,350.94	77,940.23	207,291.17
其中：基金申购款	717,297.80	82,226.85	799,524.65
基金赎回款	-587,946.86	-4,286.62	-592,233.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,052,777.90	1,165,617.51	2,218,395.41

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	15,267.52	14,168.29
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	103,848.30	53,535.68
其他	325.21	316.89
合计	119,441.03	68,020.86

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	131,887,747.36	359,885,255.68
减：卖出股票成本总额	132,625,019.11	362,465,965.49
减：交易费用	249,673.41	895,766.87
买卖股票差价收入	-986,945.16	-3,476,476.68

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	34,265.53	67,884.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,135.58	156,791.98
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	42,401.11	224,676.57

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,048,277.95	16,795,846.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	2,004,999.98	16,550,497.03

成本总额		
减：应计利息总额	35,142.17	87,560.30
减：交易费用	0.22	996.84
买卖债券差价收入	8,135.58	156,791.98

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股指期货投资收益	-3,374,229.85	3,711,487.60

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	770,457.54	675,549.31
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	770,457.54	675,549.31

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,680,305.46	334,866.93
股票投资	1,685,136.07	286,706.68
债券投资	-4,830.61	48,160.25
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	1,020,480.00	-730,229.52
权证投资	-	-

股指期货	-	-730,229.52
期货投资	1,020,480.00	-
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	2,700,785.46	-395,362.59

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	6,281.35	1,087.87
合计	6,281.35	1,087.87

7.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	10,000.00	20,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,036.18	989.84
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	79,036.18	118,989.84

7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	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。

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

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	527,746.92	528,507.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	99,858.86	156,784.18
应支付基金管理人的净管理费	427,888.06	371,723.44

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

2) 基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	105,549.42	122,324.53

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	94,707.23	94,707.23
国投证券	-	763.05	763.05
合计	-	95,470.28	95,470.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	15,578.09	15,578.09
国投证券	-	772.29	772.29
合计	-	16,350.38	16,350.38

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 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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。

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。

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固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固有资金投资本基金。

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

安信阿尔法定开混合 C

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023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	15,519,821.15	34.70	12,037,989.74	25.89

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 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	1,759,897.78	15,267.52	3,441,409.60	14,168.29

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金于本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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	8,300	60,370.61	59,926.00	-

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 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

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 2024 年 12 月 31 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（2023 年 12 月 31 日：0.004%）。

7.4.13.2.1 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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	2,034.83
未评级	-	2,005,678.36
合计	-	2,007,713.19

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。

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。

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。

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。

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。利率敏感性金融工具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 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,759,897.78	-	-	-	1,759,897.78
结算备付金	7,689,452.10	-	-	-	7,689,452.10
存出保证金	3,233,594.77	-	-	-	3,233,594.77
交易性金融资产	-	-	-	27,286,962.23	27,286,962.23
买入返售金融资产	10,999,214.93	-	-	-	10,999,214.93
应收清算款	-	-	-	1,570.14	1,570.14
资产总计	23,682,159.58	-	-	27,288,532.37	50,970,691.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	42,380.60	42,380.60
应付托管费	-	-	-	8,476.14	8,476.14
应付销售服务费	-	-	-	10,266.29	10,266.29
其他负债	-	-	-	24,088.65	24,088.65
负债总计	-	-	-	85,211.68	85,211.68
利率敏感度缺口	23,682,159.58	-	-	27,203,320.69	50,885,480.27
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,441,409.60	-	-	-	3,441,409.60
结算备付金	3,627,429.02	-	-	-	3,627,429.02
存出保证金	4,699,208.62	-	-	-	4,699,208.62
交易性金融资产	2,005,678.36	-	2,034.83	40,977,737.37	42,985,450.56
买入返售金融资产	2,600,000.00	-	-	-	2,600,000.00
资产总计	16,373,725.60	-	2,034.83	40,977,737.37	57,353,497.80
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,706.38	44,706.38
应付托管费	-	-	-	8,941.29	8,941.29

应付清算款	-	-	-	2,600,000.00	2,600,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,705.25	9,705.25
应交税费	-	-	-	29,031.08	29,031.08
其他负债	-	-	-	183,777.16	183,777.16
负债总计	-	-	-	2,876,161.16	2,876,161.16
利率敏感度缺口	16,373,725.60	-	2,034.83	38,101,576.21	54,477,336.64

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		
分析	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（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	4,869.58
	2. 市场利率上升 25 个基点	-	-4,845.93

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证券，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。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和持有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和持有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备

付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	27,286,962.23	53.62	40,977,737.37	75.22
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	27,286,962.23	53.62	40,977,737.37	75.22

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		
分析	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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,334,395.58	1,740,046.77
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,334,395.58	-1,740,046.77

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	27,227,036.23	40,979,772.20
第二层次	59,926.00	2,005,678.36
第三层次	-	-
合计	27,286,962.23	42,985,450.56

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 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	27,286,962.23	53.53
	其中：股票	27,286,962.23	53.53
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	10,999,214.93	21.58
	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	9,449,349.88	18.54
8	其他各项资产	3,235,164.91	6.35
9	合计	50,970,691.95	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	272,227.00	0.53
B	采矿业	1,344,764.50	2.64
C	制造业	16,624,631.68	32.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	965,622.00	1.90
E	建筑业	618,015.00	1.21
F	批发和零售业	310,294.92	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	559,450.00	1.10
H	住宿和餐饮业	33,472.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,481,824.43	2.91
J	金融业	3,900,072.70	7.66
K	房地产业	244,324.00	0.48
L	租赁和商务服务业	422,225.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	133,368.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	52,806.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,380.00	0.00
Q	卫生和社会工作	39,109.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	254,143.00	0.50
S	综合	28,233.00	0.06
	合计	27,286,962.23	53.62

8.2.2 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

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	300750	宁德时代	2,600	691,600.00	1.36
2	600519	贵州茅台	400	609,600.00	1.20
3	601318	中国平安	10,900	573,885.00	1.13
4	000333	美的集团	5,100	383,622.00	0.75
5	002409	雅克科技	5,100	295,545.00	0.58
6	000858	五粮液	2,000	280,080.00	0.55
7	600887	伊利股份	7,300	220,314.00	0.43
8	600900	长江电力	7,400	218,670.00	0.43
9	600660	福耀玻璃	3,400	212,160.00	0.42
10	601166	兴业银行	10,900	208,844.00	0.41
11	601601	中国太保	5,900	201,072.00	0.40
12	002027	分众传媒	28,500	200,355.00	0.39
13	601899	紫金矿业	13,100	198,072.00	0.39
14	002371	北方华创	500	195,500.00	0.38
15	000651	格力电器	4,200	190,890.00	0.38
16	000725	京东方 A	42,000	184,380.00	0.36
17	601668	中国建筑	30,600	183,600.00	0.36
18	300760	迈瑞医疗	700	178,500.00	0.35
19	600690	海尔智家	6,000	170,820.00	0.34
20	002594	比亚迪	600	169,596.00	0.33
21	002001	新和成	7,700	169,169.00	0.33
22	600919	江苏银行	17,100	167,922.00	0.33
23	300059	东方财富	6,500	167,830.00	0.33
24	600309	万华化学	2,300	164,105.00	0.32
25	600030	中信证券	5,500	160,435.00	0.32
26	300308	中际旭创	1,280	158,092.80	0.31
27	000338	潍柴动力	11,400	156,180.00	0.31
28	002475	立讯精密	3,800	154,888.00	0.30
29	600050	中国联通	29,000	153,990.00	0.30
30	002415	海康威视	4,700	144,290.00	0.28
31	601336	新华保险	2,900	144,130.00	0.28
32	002311	海大集团	2,900	142,245.00	0.28
33	300408	三环集团	3,600	138,636.00	0.27
34	600276	恒瑞医药	3,000	137,700.00	0.27
35	000786	北新建材	4,500	136,395.00	0.27
36	000100	TCL 科技	26,200	131,786.00	0.26
37	300502	新易盛	1,100	127,138.00	0.25
38	603501	韦尔股份	1,200	125,292.00	0.25
39	600183	生益科技	5,200	125,060.00	0.25
40	002916	深南电路	1,000	125,000.00	0.25

41	601688	华泰证券	7,100	124,889.00	0.25
42	601288	农业银行	22,900	122,286.00	0.24
43	601633	长城汽车	4,600	121,118.00	0.24
44	300628	亿联网络	3,000	115,800.00	0.23
45	601398	工商银行	16,700	115,564.00	0.23
46	600219	南山铝业	29,200	114,172.00	0.22
47	000063	中兴通讯	2,800	113,120.00	0.22
48	601088	中国神华	2,600	113,048.00	0.22
49	000157	中联重科	15,500	112,065.00	0.22
50	600809	山西汾酒	600	110,526.00	0.22
51	300979	华利集团	1,400	110,110.00	0.22
52	600938	中国海油	3,600	106,236.00	0.21
53	600000	浦发银行	10,300	105,987.00	0.21
54	600989	宝丰能源	6,200	104,408.00	0.21
55	002028	思源电气	1,400	101,780.00	0.20
56	601766	中国中车	12,100	101,398.00	0.20
57	300498	温氏股份	6,100	100,711.00	0.20
58	000568	泸州老窖	800	100,160.00	0.20
59	600795	国电电力	21,700	99,386.00	0.20
60	600415	小商品城	7,400	99,234.00	0.20
60	601857	中国石油	11,100	99,234.00	0.20
61	605499	东鹏饮料	390	96,922.80	0.19
62	688036	传音控股	1,012	96,140.00	0.19
63	688981	中芯国际	1,006	95,187.72	0.19
64	603369	今世缘	2,100	94,983.00	0.19
65	601728	中国电信	12,900	93,138.00	0.18
66	002714	牧原股份	2,400	92,256.00	0.18
67	002601	龙佰集团	5,200	91,884.00	0.18
68	600760	中航沈飞	1,800	91,296.00	0.18
69	603993	洛阳钼业	13,600	90,440.00	0.18
70	601138	工业富联	4,200	90,300.00	0.18
71	002648	卫星化学	4,800	90,192.00	0.18
72	601169	北京银行	14,600	89,790.00	0.18
73	601328	交通银行	11,400	88,578.00	0.17
74	601225	陕西煤业	3,800	88,388.00	0.17
75	600406	国电南瑞	3,500	88,270.00	0.17
76	601689	拓普集团	1,800	88,200.00	0.17
77	000423	东阿阿胶	1,400	87,808.00	0.17
78	000999	华润三九	1,980	87,793.20	0.17
79	601989	中国重工	18,100	87,061.00	0.17
80	002202	金风科技	8,400	86,772.00	0.17
81	601058	赛轮轮胎	6,000	85,980.00	0.17
82	002444	巨星科技	2,600	84,110.00	0.17
83	000538	云南白药	1,400	83,930.00	0.16

84	601390	中国中铁	13,100	83,709.00	0.16
85	600150	中国船舶	2,300	82,708.00	0.16
86	600875	东方电气	5,200	82,628.00	0.16
87	002595	豪迈科技	1,600	80,304.00	0.16
88	600426	华鲁恒升	3,700	79,957.00	0.16
89	601816	京沪高铁	12,900	79,464.00	0.16
90	601919	中远海控	5,100	79,050.00	0.16
91	600845	宝信软件	2,700	79,002.00	0.16
92	603195	公牛集团	1,101	77,334.24	0.15
93	000001	平安银行	6,600	77,220.00	0.15
94	600885	宏发股份	2,400	76,368.00	0.15
95	688111	金山办公	266	76,179.74	0.15
96	002340	格林美	11,600	75,748.00	0.15
97	601628	中国人寿	1,800	75,456.00	0.15
98	688169	石头科技	341	74,777.89	0.15
99	600926	杭州银行	5,100	74,511.00	0.15
100	002078	太阳纸业	5,000	74,350.00	0.15
101	300274	阳光电源	1,000	73,830.00	0.15
102	600019	宝钢股份	10,400	72,800.00	0.14
103	300001	特锐德	3,300	72,435.00	0.14
104	002241	歌尔股份	2,800	72,268.00	0.14
105	600741	华域汽车	4,100	72,201.00	0.14
106	002463	沪电股份	1,800	71,370.00	0.14
107	002273	水晶光电	3,200	71,104.00	0.14
108	600941	中国移动	600	70,896.00	0.14
109	300124	汇川技术	1,200	70,296.00	0.14
110	600536	中国软件	1,500	70,035.00	0.14
111	002867	周大生	4,700	68,291.00	0.13
112	300442	润泽科技	1,300	67,548.00	0.13
113	600016	民生银行	16,300	67,319.00	0.13
114	600015	华夏银行	8,300	66,483.00	0.13
115	000728	国元证券	7,900	66,044.00	0.13
116	603893	瑞芯微	600	66,036.00	0.13
117	300383	光环新网	4,500	65,655.00	0.13
118	001979	招商蛇口	6,400	65,536.00	0.13
119	600028	中国石化	9,800	65,464.00	0.13
120	688018	乐鑫科技	300	65,400.00	0.13
121	002152	广电运通	5,600	65,296.00	0.13
122	002128	电投能源	3,300	64,614.00	0.13
123	000636	风华高科	4,500	64,575.00	0.13
124	300866	安克创新	660	64,442.40	0.13
125	600436	片仔癀	300	64,350.00	0.13
126	600585	海螺水泥	2,700	64,206.00	0.13
127	000425	徐工机械	8,000	63,440.00	0.12

128	000776	广发证券	3,900	63,219.00	0.12
129	300724	捷佳伟创	1,000	63,210.00	0.12
130	601877	正泰电器	2,700	63,207.00	0.12
131	601717	郑煤机	4,800	62,304.00	0.12
132	000039	中集集团	7,900	61,383.00	0.12
133	601168	西部矿业	3,800	61,066.00	0.12
134	300394	天孚通信	660	60,297.60	0.12
135	601916	浙商银行	20,600	59,946.00	0.12
136	002252	上海莱士	8,300	59,926.00	0.12
137	002138	顺络电子	1,900	59,812.00	0.12
138	600612	老凤祥	1,100	59,697.00	0.12
139	000807	云铝股份	4,400	59,532.00	0.12
140	002185	华天科技	5,100	59,211.00	0.12
141	300529	健帆生物	2,000	58,680.00	0.12
142	600096	云天化	2,600	57,980.00	0.11
143	600547	山东黄金	2,500	56,575.00	0.11
144	002180	纳思达	2,000	56,340.00	0.11
145	600066	宇通客车	2,100	55,398.00	0.11
146	300251	光线传媒	5,800	54,752.00	0.11
147	601600	中国铝业	7,400	54,390.00	0.11
148	600023	浙能电力	9,600	54,336.00	0.11
149	000997	新大陆	2,700	53,865.00	0.11
150	300679	电连技术	900	53,730.00	0.11
151	601888	中国中免	800	53,608.00	0.11
152	603986	兆易创新	500	53,400.00	0.10
153	601319	中国人保	7,000	53,340.00	0.10
154	688188	柏楚电子	274	53,224.50	0.10
155	000596	古井贡酒	300	51,990.00	0.10
156	601988	中国银行	9,400	51,794.00	0.10
157	601186	中国铁建	5,600	51,352.00	0.10
158	600642	申能股份	5,400	51,246.00	0.10
159	600332	白云山	1,800	51,156.00	0.10
160	603218	日月股份	4,200	50,610.00	0.10
161	600352	浙江龙盛	4,900	50,421.00	0.10
162	000166	申万宏源	9,400	50,290.00	0.10
163	600999	招商证券	2,600	49,816.00	0.10
164	601838	成都银行	2,900	49,619.00	0.10
165	002532	天山铝业	6,300	49,581.00	0.10
166	600062	华润双鹤	2,500	49,500.00	0.10
167	603786	科博达	800	49,440.00	0.10
168	600737	中粮糖业	4,800	49,008.00	0.10
169	603160	汇顶科技	600	48,324.00	0.09
170	300433	蓝思科技	2,200	48,180.00	0.09
171	601669	中国电建	8,800	48,048.00	0.09

172	002032	苏泊尔	900	47,889.00	0.09
173	600299	安迪苏	3,800	47,690.00	0.09
174	002683	广东宏大	1,800	47,664.00	0.09
175	600970	中材国际	5,000	47,400.00	0.09
176	601128	常熟银行	6,230	47,161.10	0.09
177	601985	中国核电	4,500	46,935.00	0.09
178	000977	浪潮信息	900	46,692.00	0.09
179	600901	江苏金租	8,780	45,831.60	0.09
180	601012	隆基绿能	2,900	45,559.00	0.09
181	600282	南钢股份	9,700	45,493.00	0.09
182	600863	内蒙华电	10,400	45,032.00	0.09
183	002422	科伦药业	1,500	44,895.00	0.09
184	600157	永泰能源	26,200	44,802.00	0.09
185	603806	福斯特	3,000	44,400.00	0.09
186	600377	宁沪高速	2,900	44,399.00	0.09
187	601615	明阳智能	3,500	44,135.00	0.09
188	601607	上海医药	2,100	44,100.00	0.09
189	002920	德赛西威	400	44,044.00	0.09
190	600529	山东药玻	1,700	43,809.00	0.09
191	600141	兴发集团	2,000	43,400.00	0.09
192	002179	中航光电	1,100	43,230.00	0.08
193	002608	江苏国信	5,600	42,952.00	0.08
194	600862	中航高科	1,700	42,942.00	0.08
195	600170	上海建工	16,200	42,930.00	0.08
196	600583	海油工程	7,800	42,666.00	0.08
197	688777	中控技术	857	42,567.19	0.08
198	600143	金发科技	4,800	41,472.00	0.08
199	600346	恒力石化	2,700	41,445.00	0.08
200	600820	隧道股份	5,700	40,983.00	0.08
201	000066	中国长城	2,800	40,796.00	0.08
202	002353	杰瑞股份	1,100	40,689.00	0.08
203	601156	东航物流	2,400	40,488.00	0.08
204	601958	金钼股份	4,000	40,240.00	0.08
205	601799	星宇股份	300	40,044.00	0.08
206	601966	玲珑轮胎	2,200	39,688.00	0.08
207	600031	三一重工	2,400	39,552.00	0.08
208	601928	凤凰传媒	3,400	39,236.00	0.08
209	600958	东方证券	3,700	39,072.00	0.08
210	603338	浙江鼎力	600	38,712.00	0.08
211	601006	大秦铁路	5,700	38,646.00	0.08
212	601236	红塔证券	4,500	38,205.00	0.08
213	300699	光威复材	1,100	38,115.00	0.07
214	688516	奥特维	868	37,593.08	0.07
215	601108	财通证券	4,600	37,582.00	0.07

216	600663	陆家嘴	3,800	37,392.00	0.07
217	600048	保利发展	4,200	37,212.00	0.07
218	601567	三星医疗	1,200	36,912.00	0.07
219	000683	远兴能源	6,600	36,894.00	0.07
220	000883	湖北能源	7,400	36,852.00	0.07
221	002142	宁波银行	1,500	36,465.00	0.07
222	600801	华新水泥	3,000	36,300.00	0.07
223	300144	宋城演艺	3,900	36,231.00	0.07
224	002555	三七互娱	2,300	35,972.00	0.07
225	300782	卓胜微	400	35,880.00	0.07
226	600563	法拉电子	300	35,676.00	0.07
227	600089	特变电工	2,800	35,672.00	0.07
228	002156	通富微电	1,200	35,460.00	0.07
229	000975	山金国际	2,300	35,351.00	0.07
230	000563	陕国投 A	9,900	35,244.00	0.07
231	600872	中炬高新	1,600	35,232.00	0.07
232	601019	山东出版	3,100	35,185.00	0.07
233	600637	东方明珠	4,500	34,920.00	0.07
234	001965	招商公路	2,500	34,875.00	0.07
235	600549	厦门钨业	1,800	34,686.00	0.07
236	002500	山西证券	5,500	34,540.00	0.07
237	000887	中鼎股份	2,600	34,112.00	0.07
238	002025	航天电器	700	33,992.00	0.07
239	002074	国轩高科	1,600	33,952.00	0.07
240	000830	鲁西化工	2,900	33,901.00	0.07
241	600418	江淮汽车	900	33,750.00	0.07
242	002736	国信证券	3,000	33,600.00	0.07
243	600497	驰宏锌锗	6,000	33,420.00	0.07
244	002563	森马服饰	4,700	32,994.00	0.06
245	000623	吉林敖东	1,900	32,813.00	0.06
246	300017	网宿科技	3,100	32,767.00	0.06
247	600380	健康元	2,900	32,683.00	0.06
248	600008	首创环保	9,900	32,472.00	0.06
249	601229	上海银行	3,500	32,025.00	0.06
250	002557	洽洽食品	1,100	31,955.00	0.06
251	002558	巨人网络	2,500	31,725.00	0.06
252	002429	兆驰股份	5,400	31,212.00	0.06
253	600177	雅戈尔	3,500	31,150.00	0.06
254	601618	中国中冶	9,400	31,020.00	0.06
255	002797	第一创业	3,700	30,895.00	0.06
256	600517	国网英大	5,600	30,856.00	0.06
257	001872	招商港口	1,500	30,705.00	0.06
258	601233	桐昆股份	2,600	30,680.00	0.06
259	002065	东华软件	4,200	30,492.00	0.06

260	600188	兖矿能源	2,150	30,465.50	0.06
261	601898	中煤能源	2,500	30,450.00	0.06
262	000988	华工科技	700	30,310.00	0.06
263	600489	中金黄金	2,500	30,075.00	0.06
264	002008	大族激光	1,200	30,000.00	0.06
265	688208	道通科技	763	29,879.08	0.06
266	002984	森麒麟	1,200	29,592.00	0.06
267	002850	科达利	300	29,304.00	0.06
268	600011	华能国际	4,300	29,111.00	0.06
269	601009	南京银行	2,700	28,755.00	0.06
270	300832	新产业	400	28,340.00	0.06
271	000617	中油资本	4,100	28,249.00	0.06
272	000598	兴蓉环境	3,700	28,083.00	0.06
273	601611	中国核建	3,100	28,024.00	0.06
274	000998	隆平高科	2,500	27,925.00	0.05
275	603883	老百姓	1,700	27,829.00	0.05
276	000729	燕京啤酒	2,300	27,692.00	0.05
277	600848	上海临港	2,700	27,270.00	0.05
278	601077	渝农商行	4,500	27,225.00	0.05
279	600372	中航机载	2,200	27,126.00	0.05
280	600673	东阳光	2,400	27,096.00	0.05
281	600482	中国动力	1,100	26,917.00	0.05
282	300070	碧水源	5,300	26,818.00	0.05
283	002739	万达电影	2,200	26,708.00	0.05
284	601965	中国汽研	1,500	26,430.00	0.05
285	600704	物产中大	5,200	26,312.00	0.05
286	000895	双汇发展	1,000	25,960.00	0.05
287	002517	恺英网络	1,900	25,859.00	0.05
288	601997	贵阳银行	4,300	25,800.00	0.05
289	002153	石基信息	3,600	25,704.00	0.05
290	300002	神州泰岳	2,200	25,498.00	0.05
291	000800	一汽解放	3,100	25,420.00	0.05
292	600298	安琪酵母	700	25,235.00	0.05
293	601568	北元集团	6,000	25,200.00	0.05
294	601598	中国外运	4,700	25,145.00	0.05
295	688122	西部超导	587	25,135.34	0.05
296	300024	机器人	1,400	25,130.00	0.05
297	002304	洋河股份	300	25,059.00	0.05
298	000400	许继电气	900	24,777.00	0.05
299	600968	海油发展	5,800	24,766.00	0.05
300	601231	环旭电子	1,500	24,750.00	0.05
301	002294	信立泰	800	24,744.00	0.05
302	600588	用友网络	2,300	24,679.00	0.05
303	002958	青农商行	8,100	24,624.00	0.05

304	603529	爱玛科技	600	24,612.00	0.05
305	600600	青岛啤酒	300	24,276.00	0.05
306	600160	巨化股份	1,000	24,120.00	0.05
307	600582	天地科技	3,900	24,102.00	0.05
308	603317	天味食品	1,800	24,012.00	0.05
309	601577	长沙银行	2,700	24,003.00	0.05
310	600511	国药股份	700	23,954.00	0.05
311	601872	招商轮船	3,700	23,717.00	0.05
312	600126	杭钢股份	4,900	23,422.00	0.05
313	601399	国机重装	7,600	23,408.00	0.05
314	603298	杭叉集团	1,300	23,257.00	0.05
315	601021	春秋航空	400	23,068.00	0.05
316	603379	三美股份	600	23,028.00	0.05
317	600707	彩虹股份	2,800	23,016.00	0.05
318	000513	丽珠集团	600	22,800.00	0.04
319	601179	中国西电	3,000	22,770.00	0.04
320	603939	益丰药房	940	22,682.20	0.04
321	601000	唐山港	4,800	22,608.00	0.04
322	600161	天坛生物	1,100	22,550.00	0.04
323	600765	中航重机	1,100	22,517.00	0.04
324	000738	航发控制	1,000	22,240.00	0.04
325	002436	兴森科技	2,000	22,220.00	0.04
326	600959	江苏有线	6,600	22,110.00	0.04
327	601216	君正集团	4,200	22,092.00	0.04
328	002262	恩华药业	900	21,915.00	0.04
329	002223	鱼跃医疗	600	21,894.00	0.04
330	300492	华图山鼎	300	21,840.00	0.04
331	002407	多氟多	1,800	21,600.00	0.04
332	300253	卫宁健康	3,000	21,480.00	0.04
333	603712	七一二	1,100	21,417.00	0.04
334	600498	烽火通信	1,100	21,406.00	0.04
335	688002	睿创微纳	455	21,389.55	0.04
336	601636	旗滨集团	3,800	21,318.00	0.04
337	002373	千方科技	2,100	21,294.00	0.04
338	600398	海澜之家	2,800	21,000.00	0.04
339	601298	青岛港	2,300	20,953.00	0.04
340	600827	百联股份	1,900	20,767.00	0.04
341	300003	乐普医疗	1,800	20,412.00	0.04
342	002432	九安医疗	500	20,390.00	0.04
343	002299	圣农发展	1,400	20,272.00	0.04
344	600373	中文传媒	1,600	20,080.00	0.04
345	601666	平煤股份	2,000	20,040.00	0.04
346	000958	电投产融	3,200	19,936.00	0.04
347	600879	航天电子	2,200	19,712.00	0.04

348	603589	口子窖	500	19,620.00	0.04
349	688772	珠海冠宇	1,220	19,617.60	0.04
350	688065	凯赛生物	505	19,594.00	0.04
351	603228	景旺电子	700	19,488.00	0.04
352	000032	深桑达 A	1,100	19,404.00	0.04
353	600909	华安证券	3,200	19,392.00	0.04
354	603816	顾家家居	700	19,306.00	0.04
355	600316	洪都航空	600	19,272.00	0.04
356	002236	大华股份	1,200	19,200.00	0.04
357	000539	粤电力 A	4,200	19,026.00	0.04
358	600025	华能水电	2,000	19,020.00	0.04
359	002372	伟星新材	1,500	18,945.00	0.04
360	002368	太极股份	800	18,944.00	0.04
361	600131	国网信通	1,000	18,910.00	0.04
362	600699	均胜电子	1,200	18,804.00	0.04
363	600754	锦江酒店	700	18,802.00	0.04
364	300474	景嘉微	200	18,698.00	0.04
365	300384	三联虹普	1,000	18,620.00	0.04
366	300058	蓝色光标	2,000	18,560.00	0.04
367	603995	甬金股份	1,000	18,290.00	0.04
368	603156	养元饮品	800	18,272.00	0.04
369	601098	中南传媒	1,200	18,012.00	0.04
370	000967	盈峰环境	3,600	17,892.00	0.04
371	300748	金力永磁	1,000	17,880.00	0.04
372	603650	彤程新材	500	17,485.00	0.03
373	600004	白云机场	1,800	17,280.00	0.03
374	600578	京能电力	4,900	17,248.00	0.03
375	000785	居然智家	4,800	17,136.00	0.03
375	600018	上港集团	2,800	17,136.00	0.03
376	600007	中国国贸	700	17,122.00	0.03
377	300285	国瓷材料	1,000	17,040.00	0.03
378	600764	中国海防	600	16,992.00	0.03
379	300888	稳健医疗	400	16,832.00	0.03
380	600325	华发股份	2,900	16,704.00	0.03
381	601117	中国化学	2,000	16,580.00	0.03
382	001206	依依股份	1,000	16,530.00	0.03
383	603259	药明康德	300	16,512.00	0.03
384	688819	天能股份	598	16,277.56	0.03
385	002195	岩山科技	4,100	16,277.00	0.03
386	600598	北大荒	1,100	16,225.00	0.03
387	603728	鸣志电器	300	16,200.00	0.03
388	600521	华海药业	900	16,083.00	0.03
389	600098	广州发展	2,500	16,050.00	0.03
390	603606	东方电缆	300	15,765.00	0.03

391	300054	鼎龙股份	600	15,612.00	0.03
392	001203	大中矿业	1,800	15,588.00	0.03
392	002385	大北农	3,600	15,588.00	0.03
393	002939	长城证券	1,900	15,580.00	0.03
394	601818	光大银行	4,000	15,480.00	0.03
395	600985	淮北矿业	1,100	15,477.00	0.03
396	600580	卧龙电驱	900	15,471.00	0.03
397	600998	九州通	3,021	15,467.52	0.03
398	600839	四川长虹	1,600	15,440.00	0.03
399	601866	中远海发	5,900	15,399.00	0.03
400	603568	伟明环保	700	15,141.00	0.03
401	000783	长江证券	2,200	15,004.00	0.03
402	600258	首旅酒店	1,000	14,670.00	0.03
403	601665	齐鲁银行	2,600	14,534.00	0.03
404	603979	金诚信	400	14,520.00	0.03
405	301165	锐捷网络	200	14,440.00	0.03
406	002080	中材科技	1,100	14,388.00	0.03
407	300114	中航电测	200	14,356.00	0.03
408	603077	和邦生物	7,000	14,280.00	0.03
409	002044	美年健康	3,100	14,229.00	0.03
410	601901	方正证券	1,700	14,161.00	0.03
411	002507	涪陵榨菜	1,000	14,130.00	0.03
412	600859	王府井	900	13,869.00	0.03
413	601608	中信重工	3,300	13,860.00	0.03
414	000778	新兴铸管	3,600	13,824.00	0.03
415	000709	河钢股份	6,200	13,702.00	0.03
416	002791	坚朗五金	600	13,644.00	0.03
417	301358	湖南裕能	300	13,596.00	0.03
418	600166	福田汽车	5,400	13,554.00	0.03
419	600884	杉杉股份	1,800	13,410.00	0.03
420	300207	欣旺达	600	13,386.00	0.03
421	603225	新凤鸣	1,200	13,356.00	0.03
422	002690	美亚光电	900	13,338.00	0.03
423	000591	太阳能	2,800	13,328.00	0.03
424	300142	沃森生物	1,100	13,288.00	0.03
425	000937	冀中能源	2,100	13,272.00	0.03
426	300146	汤臣倍健	1,100	13,255.00	0.03
427	300604	长川科技	300	13,239.00	0.03
428	688005	容百科技	418	13,187.90	0.03
429	688172	燕东微	656	13,152.80	0.03
430	603658	安图生物	300	13,092.00	0.03
431	002064	华峰化学	1,600	13,088.00	0.03
432	300373	扬杰科技	300	13,056.00	0.03
433	000739	普洛药业	800	13,008.00	0.03

434	000156	华数传媒	1,800	12,960.00	0.03
435	600983	惠而浦	1,400	12,936.00	0.03
436	600339	中油工程	3,600	12,888.00	0.03
437	002019	亿帆医药	1,200	12,864.00	0.03
438	300567	精测电子	200	12,860.00	0.03
439	300759	康龙化成	500	12,850.00	0.03
440	000155	川能动力	1,200	12,816.00	0.03
441	603179	新泉股份	300	12,810.00	0.03
442	600155	华创云信	1,700	12,580.00	0.02
443	600516	方大炭素	2,600	12,558.00	0.02
444	601212	白银有色	4,500	12,510.00	0.02
445	601658	邮储银行	2,200	12,496.00	0.02
446	600064	南京高科	1,600	12,432.00	0.02
447	600129	太极集团	500	12,360.00	0.02
448	600056	中国医药	1,100	12,210.00	0.02
449	300357	我武生物	600	12,192.00	0.02
450	300009	安科生物	1,400	12,096.00	0.02
451	002352	顺丰控股	300	12,090.00	0.02
452	300601	康泰生物	700	12,005.00	0.02
453	600755	厦门国贸	1,800	11,952.00	0.02
454	002615	哈尔斯	1,500	11,925.00	0.02
455	688425	铁建重工	2,710	11,924.00	0.02
456	300496	中科创达	200	11,912.00	0.02
457	000537	中绿电	1,300	11,856.00	0.02
458	603305	旭升集团	900	11,835.00	0.02
459	002533	金杯电工	1,200	11,808.00	0.02
460	002550	千红制药	1,900	11,780.00	0.02
461	600320	振华重工	3,000	11,760.00	0.02
461	601158	重庆水务	2,400	11,760.00	0.02
462	603799	华友钴业	400	11,704.00	0.02
463	300568	星源材质	1,200	11,664.00	0.02
464	600566	济川药业	400	11,632.00	0.02
465	000519	中兵红箭	800	11,560.00	0.02
466	301267	华夏眼科	600	11,424.00	0.02
467	002322	理工能科	900	11,331.00	0.02
468	688295	中复神鹰	568	11,320.24	0.02
469	003035	南网能源	2,700	11,286.00	0.02
470	000060	中金岭南	2,400	11,256.00	0.02
471	002249	大洋电机	1,900	11,153.00	0.02
472	600995	南网储能	1,100	11,132.00	0.02
473	000404	长虹华意	1,500	11,100.00	0.02
473	600032	浙江新能	1,500	11,100.00	0.02
474	002439	启明星辰	700	11,074.00	0.02
475	600967	内蒙一机	1,300	11,050.00	0.02

476	600873	梅花生物	1,100	11,033.00	0.02
477	002155	湖南黄金	700	11,011.00	0.02
478	603233	大参林	720	10,843.20	0.02
479	600803	新奥股份	500	10,840.00	0.02
480	300558	贝达药业	200	10,786.00	0.02
481	002508	老板电器	500	10,715.00	0.02
482	603600	永艺股份	900	10,701.00	0.02
483	600925	苏能股份	2,000	10,600.00	0.02
484	600153	建发股份	1,000	10,520.00	0.02
485	600399	抚顺特钢	1,800	10,440.00	0.02
486	000963	华东医药	300	10,380.00	0.02
487	601858	中国科传	500	10,190.00	0.02
488	603127	昭衍新药	600	9,978.00	0.02
489	600475	华光环能	1,100	9,911.00	0.02
490	000792	盐湖股份	600	9,876.00	0.02
491	002230	科大讯飞	200	9,664.00	0.02
492	300118	东方日升	800	9,584.00	0.02
493	002625	光启技术	200	9,560.00	0.02
494	600577	精达股份	1,300	9,477.00	0.02
495	000703	恒逸石化	1,500	9,420.00	0.02
496	002410	广联达	800	9,408.00	0.02
497	600710	苏美达	1,000	9,300.00	0.02
498	603288	海天味业	200	9,180.00	0.02
499	600021	上海电力	1,000	9,170.00	0.02
500	603025	大豪科技	600	9,150.00	0.02
501	000048	京基智农	500	9,000.00	0.02
502	600528	中铁工业	1,100	8,866.00	0.02
503	603000	人民网	400	8,816.00	0.02
504	002384	东山精密	300	8,760.00	0.02
505	688331	荣昌生物	289	8,701.79	0.02
506	603927	中科软	400	8,680.00	0.02
507	603737	三棵树	200	8,520.00	0.02
508	688009	中国通号	1,360	8,513.60	0.02
509	600348	华阳股份	1,200	8,508.00	0.02
510	600361	创新新材	2,200	8,492.00	0.02
511	600111	北方稀土	400	8,488.00	0.02
512	000768	中航西飞	300	8,472.00	0.02
513	688153	唯捷创芯	253	8,465.38	0.02
514	600315	上海家化	500	8,455.00	0.02
515	000630	铜陵有色	2,600	8,398.00	0.02
516	300676	华大基因	200	8,394.00	0.02
517	000938	紫光股份	300	8,349.00	0.02
518	600515	海南机场	2,200	8,316.00	0.02
519	003022	联泓新科	600	8,262.00	0.02

520	688475	萤石网络	272	8,211.68	0.02
521	600271	航天信息	900	8,199.00	0.02
522	002487	大金重工	400	8,196.00	0.02
523	600118	中国卫星	300	8,190.00	0.02
524	600236	桂冠电力	1,200	8,160.00	0.02
525	002831	裕同科技	300	8,130.00	0.02
526	603185	弘元绿能	500	8,125.00	0.02
527	688538	和辉光电	3,487	8,089.84	0.02
528	600867	通化东宝	1,000	8,060.00	0.02
529	688126	沪硅产业	428	8,054.96	0.02
530	600895	张江高科	300	8,040.00	0.02
531	300015	爱尔眼科	600	7,950.00	0.02
532	600416	湘电股份	700	7,903.00	0.02
533	600010	包钢股份	4,200	7,812.00	0.02
534	601990	南京证券	900	7,794.00	0.02
535	000027	深圳能源	1,200	7,776.00	0.02
535	000629	钒钛股份	2,700	7,776.00	0.02
536	603826	坤彩科技	400	7,700.00	0.02
537	000928	中钢国际	1,200	7,644.00	0.02
538	300136	信维通信	300	7,632.00	0.01
539	601016	节能风电	2,400	7,608.00	0.01
540	688276	百克生物	302	7,583.22	0.01
541	002756	永兴材料	200	7,544.00	0.01
542	300470	中密控股	200	7,540.00	0.01
543	300012	华测检测	600	7,458.00	0.01
544	601878	浙商证券	600	7,344.00	0.01
545	000031	大悦城	2,400	7,296.00	0.01
546	601788	光大证券	400	7,244.00	0.01
547	603019	中科曙光	100	7,232.00	0.01
548	600392	盛和资源	700	7,196.00	0.01
549	601106	中国一重	2,400	6,984.00	0.01
550	605338	巴比食品	400	6,908.00	0.01
551	301187	欧圣电气	200	6,820.00	0.01
552	600956	新天绿能	900	6,786.00	0.01
553	000933	神火股份	400	6,760.00	0.01
554	601528	瑞丰银行	1,200	6,756.00	0.01
555	000625	长安汽车	500	6,680.00	0.01
556	002653	海思科	200	6,650.00	0.01
557	002465	海格通信	600	6,588.00	0.01
558	603517	绝味食品	400	6,576.00	0.01
559	600918	中泰证券	1,000	6,570.00	0.01
560	601991	大唐发电	2,300	6,555.00	0.01
561	300088	长信科技	1,000	6,540.00	0.01
562	002966	苏州银行	800	6,488.00	0.01

563	603209	兴通股份	400	6,392.00	0.01
563	603577	汇金通	800	6,392.00	0.01
564	300729	乐歌股份	400	6,352.00	0.01
565	600216	浙江医药	400	6,344.00	0.01
566	605099	共创草坪	300	6,294.00	0.01
567	601162	天风证券	1,400	6,272.00	0.01
568	600073	光明肉业	900	6,246.00	0.01
569	605378	野马电池	300	6,180.00	0.01
570	600350	山东高速	600	6,168.00	0.01
571	600329	达仁堂	200	6,160.00	0.01
572	601939	建设银行	700	6,153.00	0.01
573	002472	双环传动	200	6,124.00	0.01
574	603337	杰克股份	200	6,092.00	0.01
575	000893	亚钾国际	300	6,048.00	0.01
576	603111	康尼机电	1,000	6,030.00	0.01
577	600826	兰生股份	700	6,020.00	0.01
578	601677	明泰铝业	500	6,015.00	0.01
579	688609	九联科技	566	5,999.60	0.01
580	605166	聚合顺	500	5,985.00	0.01
581	600420	国药现代	500	5,970.00	0.01
582	300453	三鑫医疗	800	5,968.00	0.01
583	300562	乐心医疗	400	5,952.00	0.01
584	002709	天赐材料	300	5,916.00	0.01
585	603890	春秋电子	500	5,875.00	0.01
586	600894	广日股份	400	5,840.00	0.01
587	300761	立华股份	300	5,838.00	0.01
588	000002	万 科 A	800	5,808.00	0.01
589	601311	骆驼股份	700	5,803.00	0.01
590	000921	海信家电	200	5,780.00	0.01
591	603688	石英股份	200	5,746.00	0.01
592	600757	长江传媒	600	5,742.00	0.01
593	300790	宇瞳光学	300	5,727.00	0.01
594	000021	深科技	300	5,718.00	0.01
595	002673	西部证券	700	5,705.00	0.01
596	603096	新经典	300	5,685.00	0.01
597	000987	越秀资本	800	5,616.00	0.01
598	002568	百润股份	200	5,602.00	0.01
599	001286	陕西能源	600	5,568.00	0.01
600	002380	科远智慧	300	5,544.00	0.01
601	603788	宁波高发	400	5,532.00	0.01
602	002111	威海广泰	500	5,510.00	0.01
603	603882	金城医学	200	5,506.00	0.01
604	002459	晶澳科技	400	5,500.00	0.01
605	601456	国联证券	400	5,408.00	0.01

606	002668	TCL 智家	400	5,248.00	0.01
607	601369	陕鼓动力	600	5,220.00	0.01
608	000902	新洋丰	400	5,216.00	0.01
609	300083	创世纪	800	5,208.00	0.01
610	603115	海星股份	400	5,164.00	0.01
611	000750	国海证券	1,200	5,136.00	0.01
612	002020	京新药业	400	5,120.00	0.01
613	301000	肇民科技	200	5,082.00	0.01
614	300677	英科医疗	200	5,056.00	0.01
615	605183	确成股份	300	5,055.00	0.01
616	603408	建霖家居	400	5,012.00	0.01
617	601222	林洋能源	700	4,949.00	0.01
618	301029	怡合达	200	4,944.00	0.01
619	002895	川恒股份	200	4,920.00	0.01
620	000524	岭南控股	500	4,840.00	0.01
621	002603	以岭药业	300	4,803.00	0.01
622	002531	天顺风能	600	4,746.00	0.01
623	603897	长城科技	200	4,700.00	0.01
624	300014	亿纬锂能	100	4,674.00	0.01
625	300390	天华新能	200	4,610.00	0.01
626	603040	新坐标	200	4,584.00	0.01
627	300296	利亚德	700	4,508.00	0.01
628	002518	科士达	200	4,506.00	0.01
629	601038	一拖股份	300	4,434.00	0.01
629	603699	纽威股份	200	4,434.00	0.01
630	600438	通威股份	200	4,422.00	0.01
631	000429	粤高速 A	300	4,410.00	0.01
632	601113	华鼎股份	1,100	4,290.00	0.01
633	301328	维峰电子	100	4,227.00	0.01
634	600987	航民股份	600	4,164.00	0.01
635	600893	航发动力	100	4,145.00	0.01
636	603733	仙鹤股份	200	4,126.00	0.01
637	600584	长电科技	100	4,086.00	0.01
638	002139	拓邦股份	300	4,083.00	0.01
639	600060	海信视像	200	3,988.00	0.01
640	601111	中国国航	500	3,955.00	0.01
641	002056	横店东磁	300	3,888.00	0.01
642	600745	闻泰科技	100	3,878.00	0.01
643	600038	中直股份	100	3,856.00	0.01
644	300418	昆仑万维	100	3,848.00	0.01
645	002911	佛燃能源	300	3,792.00	0.01
646	300595	欧普康视	200	3,790.00	0.01
647	601377	兴业证券	600	3,756.00	0.01
648	601211	国泰君安	200	3,730.00	0.01

649	603992	松霖科技	200	3,694.00	0.01
650	300682	朗新集团	300	3,660.00	0.01
651	000878	云南铜业	300	3,657.00	0.01
652	002228	合兴包装	1,200	3,600.00	0.01
652	600115	中国东航	900	3,600.00	0.01
653	002738	中矿资源	100	3,550.00	0.01
654	002129	TCL 中环	400	3,548.00	0.01
655	688163	赛伦生物	200	3,512.00	0.01
656	002460	赣锋锂业	100	3,501.00	0.01
657	600905	三峡能源	800	3,496.00	0.01
658	002572	索菲亚	200	3,436.00	0.01
659	600176	中国巨石	300	3,417.00	0.01
660	600009	上海机场	100	3,415.00	0.01
661	601995	中金公司	100	3,369.00	0.01
662	688223	晶科能源	471	3,348.81	0.01
663	002466	天齐锂业	100	3,300.00	0.01
664	601101	昊华能源	400	3,292.00	0.01
665	603983	丸美生物	100	3,226.00	0.01
666	600988	赤峰黄金	200	3,122.00	0.01
667	300525	博思软件	200	3,116.00	0.01
668	601360	三六零	300	3,105.00	0.01
669	601868	中国能建	1,300	2,977.00	0.01
670	601699	潞安环能	200	2,872.00	0.01
671	601238	广汽集团	300	2,802.00	0.01
672	000408	藏格矿业	100	2,773.00	0.01
673	603456	九洲药业	200	2,736.00	0.01
674	002423	中粮资本	200	2,678.00	0.01
675	300122	智飞生物	100	2,630.00	0.01
676	600109	国金证券	300	2,619.00	0.01
677	600460	士兰微	100	2,602.00	0.01
678	600029	南方航空	400	2,596.00	0.01
679	601066	中信建投	100	2,575.00	0.01
680	600196	复星医药	100	2,485.00	0.00
681	002607	中公教育	700	2,380.00	0.00
682	002050	三花智控	100	2,351.00	0.00
683	600079	人福医药	100	2,338.00	0.00
684	600977	中国电影	200	2,322.00	0.00
685	002203	海亮股份	200	2,150.00	0.00
686	000959	首钢股份	700	2,135.00	0.00
687	002624	完美世界	200	2,066.00	0.00
688	600362	江西铜业	100	2,064.00	0.00
689	601698	中国卫通	100	2,040.00	0.00
690	002461	珠江啤酒	200	1,978.00	0.00
691	002026	山东威达	200	1,968.00	0.00

692	600369	西南证券	400	1,868.00	0.00
693	000009	中国宝安	200	1,830.00	0.00
694	002493	荣盛石化	200	1,810.00	0.00
695	000050	深天马 A	200	1,806.00	0.00
696	000723	美锦能源	400	1,804.00	0.00
697	600882	妙可蓝多	100	1,790.00	0.00
698	600674	川投能源	100	1,725.00	0.00
699	002007	华兰生物	100	1,685.00	0.00
700	000983	山西焦煤	200	1,648.00	0.00
701	000301	东方盛虹	200	1,642.00	0.00
702	603659	璞泰来	100	1,591.00	0.00
703	601881	中国银河	100	1,523.00	0.00
704	002120	韵达股份	200	1,504.00	0.00
705	601059	信达证券	100	1,498.00	0.00
706	002414	高德红外	200	1,486.00	0.00
707	600039	四川路桥	200	1,456.00	0.00
708	600535	天士力	100	1,446.00	0.00
709	601998	中信银行	200	1,396.00	0.00
710	002240	盛新锂能	100	1,378.00	0.00
711	603885	吉祥航空	100	1,370.00	0.00
712	600022	山东钢铁	900	1,305.00	0.00
713	601155	新城控股	100	1,196.00	0.00
714	002497	雅化集团	100	1,170.00	0.00
715	000708	中信特钢	100	1,141.00	0.00
716	000833	粤桂股份	100	1,137.00	0.00
717	601696	中银证券	100	1,116.00	0.00
718	600732	爱旭股份	100	1,102.00	0.00
719	000825	太钢不锈	300	1,044.00	0.00
720	601228	广州港	300	1,017.00	0.00
721	600483	福能股份	100	997.00	0.00
722	600435	北方导航	100	976.00	0.00
723	002266	浙富控股	300	936.00	0.00
724	600808	马钢股份	300	927.00	0.00
725	000898	鞍钢股份	300	720.00	0.00
726	000932	华菱钢铁	100	418.00	0.00

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	600519	贵州茅台	1,248,706.00	2.29
2	300750	宁德时代	895,275.00	1.64

3	002409	雅克科技	832,327.00	1.53
4	601318	中国平安	769,647.00	1.41
5	600900	长江电力	640,428.00	1.18
6	000333	美的集团	573,884.00	1.05
7	300285	国瓷材料	543,168.00	1.00
8	000858	五粮液	459,573.00	0.84
9	600030	中信证券	397,817.00	0.73
10	601899	紫金矿业	390,370.00	0.72
11	002475	立讯精密	387,603.00	0.71
12	300502	新易盛	371,401.00	0.68
13	000651	格力电器	371,058.00	0.68
14	002463	沪电股份	365,852.00	0.67
15	002138	顺络电子	359,368.00	0.66
16	601058	赛轮轮胎	354,659.00	0.65
17	600938	中国海油	351,423.00	0.65
18	688169	石头科技	349,945.22	0.64
19	600887	伊利股份	349,337.00	0.64
20	002028	思源电气	339,701.00	0.62

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	600519	贵州茅台	1,307,623.00	2.40
2	601318	中国平安	1,224,046.00	2.25
3	600900	长江电力	1,098,436.00	2.02
4	300750	宁德时代	720,423.00	1.32
5	000333	美的集团	677,334.00	1.24
6	002409	雅克科技	641,684.00	1.18
7	600030	中信证券	638,941.00	1.17
8	300285	国瓷材料	587,624.00	1.08
9	601166	兴业银行	580,265.00	1.07
10	601728	中国电信	579,246.00	1.06
11	601899	紫金矿业	563,165.00	1.03
12	600309	万华化学	539,943.00	0.99
13	600276	恒瑞医药	502,108.00	0.92
14	601668	中国建筑	501,851.00	0.92
15	600028	中国石化	484,470.00	0.89
16	600690	海尔智家	479,974.00	0.88
17	601088	中国神华	465,186.00	0.85
18	600031	三一重工	451,436.00	0.83

19	601857	中国石油	444,797.00	0.82
20	600066	宇通客车	444,541.00	0.82

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	117,249,107.90
卖出股票收入（成交）总额	131,887,747.36

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

现阶段本基金主要使用股指期货对冲市场系统性风险。基金经理根据对冲比率、期现市场相关性等因素，计算需要对冲的股指期货合约手数，并对风险敞口进行实时跟踪与动态调整。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 27,286,962.23 元，占基金资产净值的比例为 53.62%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 26,889,660.00 元，占基金资产净值的比例为 52.84%，空头合约市值占股票资产的比例为 98.54%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -4,361,175.01 元，公允价值变动损益为 2,705,616.07 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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兴业银行（代码：601166 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. 兴业银行股份有限公司

2024 年 1 月 22 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2024 年 7 月 25 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局福建监管局罚款。

2024 年 10 月 31 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	3,233,594.77
2	应收清算款	1,570.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,235,164.91

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 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 (%)
安信阿尔法定开混合 A	992	26,399.11	1,611,492.37	6.15	24,576,423.45	93.85
安信阿尔法定开混合 C	307	60,404.55	15,524,958.71	83.72	3,019,238.63	16.28
合计	1,278	35,001.65	17,136,451.08	38.31	27,595,662.08	61.69

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	安信阿尔法定开混合 A	1,187,010.00	4.53
	安信阿尔法定开混合 C	-	-
	合计	1,187,010.00	2.65

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、	安信阿尔法定开混合 A	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	50~100
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	50~100

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日(2017年12月6日)基金份额总额	10,298,649.48	-
本报告期期初基金份额总额	29,261,125.03	17,229,745.49
本报告期基金总申购份额	5,854,345.88	5,200,570.35
减：本报告期基金总赎回份额	8,927,555.09	3,886,118.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,187,915.82	18,544,197.34

§ 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，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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、基金托管人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 10,000.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已完成整改
其他	无

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
华泰证券	2	219,743,013.73	88.20	154,347.43	92.01	-
长江证券	2	27,322,651.28	10.97	12,459.18	7.43	-
浙商证券	2	2,071,190.25	0.83	944.61	0.56	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金管理人制定了相应的内部管理规定，明确了证券公司提供证券交易及研究服务的准入标准和程序。准入标准主要包括财务状况、经营行为规范、合规风控能力、交易能力及研究服务能力。对于拟新增合作的证券公司，管理人开展尽职调查，并根据调查结果发起内部评估流程，评估通过后签订合作协议。

本基金管理人根据规定于 2024 年 7 月 1 日调整了交易佣金费率，调整后被动股票型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

本报告期本基金新增券商交易单元：国投证券。

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 (%)
华泰证券	-	-	1,433,480,000.00	80.81	-	-
长江证券	2,013,143.71	100.00	305,320,000.00	17.21	-	-
浙商证券	-	-	35,000,000.00	1.97	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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提醒	证券日报, 证券时报, 中	2024 年 1 月 3 日

	投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	国证券报, 上海证券报	
2	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 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	2024 年 1 月 19 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日
5	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2024 年 3 月 5 日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
7	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
8	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年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	2024 年 3 月 28 日
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 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	2024 年 4 月 19 日
10	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
11	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	2024 年 4 月 26 日
12	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2024 年 6 月 11 日
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下 89 只基金 2024 年第 2 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	2024 年 7 月 18 日
14	安信基金管理有限责任公司关于终止中民财富基金销售(上海)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	2024 年 8 月 23 日
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年中期报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 8 月 29 日
16	安信基金管理有限责任公司关于安信	上海证券报	2024 年 9 月 6 日

	稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第三次开放申购、赎回和转换业务的公告		
17	关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 A 类份额在直销柜台开展费率优惠活动的公告	上海证券报	2024 年 9 月 11 日
18	安信基金管理有限责任公司关于旗下 92 只基金 2024 年第 3 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	2024 年 10 月 24 日
19	安信基金管理有限责任公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 11 月 22 日
20	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第四次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2024 年 12 月 10 日

§ 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	20240101-20241231	12,037,989.74	3,481,831.41	-	15,519,821.15	34.70

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稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

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

2025年3月28日