

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 | 4 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 5 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 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 | 10 |
| 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 | 11 |
| 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 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 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内容的真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 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 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 54 |
| 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 | 55 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 55 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 55 |
| 7.12 市场中性策略执行情况 | 56 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 56 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 58 |
| 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 | 58 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 58 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 59 |
| § 10 重大事件揭示 | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 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 | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 59 |
| 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 | 60 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 60 |
| 10.8 其他重大事件 | 60 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| 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 | 62 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| § 12 备查文件目录 | 62 |
| 12.1 备查文件目录 | 62 |
| 12.2 存放地点 | 63 |
| 12.3 查阅方式 | 63 |

§ 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 | 538,597,371.56 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 | 346,059,596.27 份 | 192,537,775.29 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 | 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。 |

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 |
| | 联系电话 | 0755-82509999 |
| | | 张燕 |
| | | 0755-83199084 |

| | | |
|--------|-------------------------------------|------------------------|
| 电子邮箱 | service@essencefund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | 4008-088-088 | 95555 |
| 传真 | 0755-82799292 | 0755-83195201 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 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 | 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| | 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 | 6,718,122.18 | 2,773,327.10 |
| 本期利润 | 3,716,507.19 | 2,594,810.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0132 | 0.0116 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.09% | 0.96% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.73% | 1.43% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配利润 | 55,299,614.62 | 29,405,717.64 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1598 | 0.1527 |
| 期末基金资产净值 | 420,274,846.02 | 232,470,056.62 |
| 期末基金份额净值 | 1.2145 | 1.2074 |

| | | |
|--------------|------------------|--------|
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 21.45% | 10.03% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信阿尔法定开混合 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.18% | 0.19% | 0.12% | 0.00% | 1.06% | 0.19% |
| 过去三个月 | -0.43% | 0.18% | 0.37% | 0.00% | -0.80% | 0.18% |
| 过去六个月 | 1.73% | 0.30% | 0.74% | 0.00% | 0.99% | 0.30% |
| 过去一年 | 10.25% | 0.28% | 1.50% | 0.00% | 8.75% | 0.28% |
| 过去三年 | 20.22% | 0.22% | 4.50% | 0.00% | 15.72% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.45% | 0.21% | 5.35% | 0.00% | 16.10% | 0.21% |

安信阿尔法定开混合 C

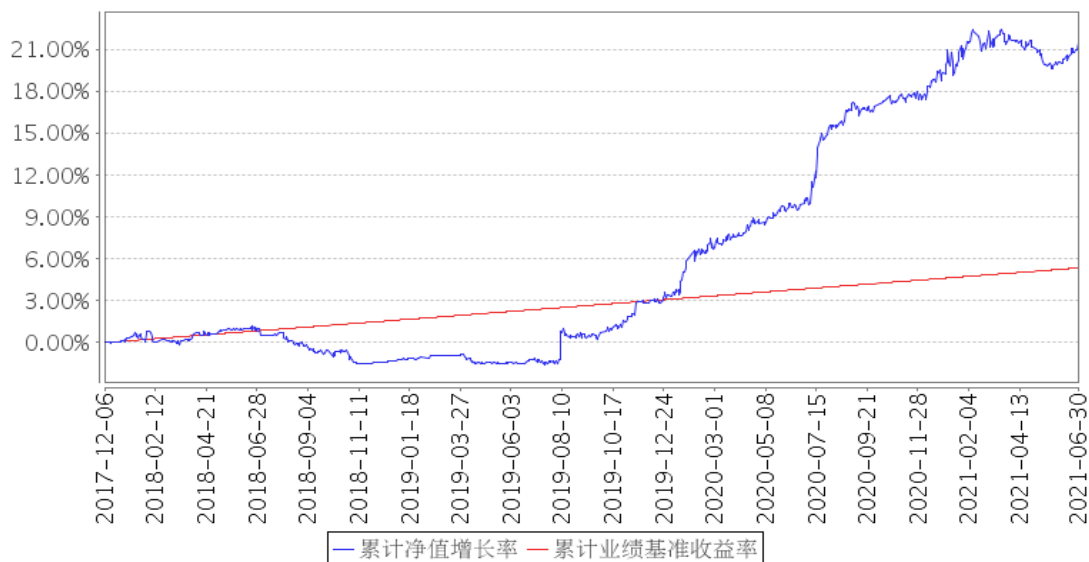
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.13% | 0.19% | 0.12% | 0.00% | 1.01% | 0.19% |
| 过去三个月 | -0.59% | 0.18% | 0.37% | 0.00% | -0.96% | 0.18% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.30% | 0.74% | 0.00% | 0.69% | 0.30% |
| 过去一年 | 9.62% | 0.28% | 1.50% | 0.00% | 8.12% | 0.28% |
| 自基金合同生效起 至今 | 10.03% | 0.28% | 1.57% | 0.00% | 8.46% | 0.28% |

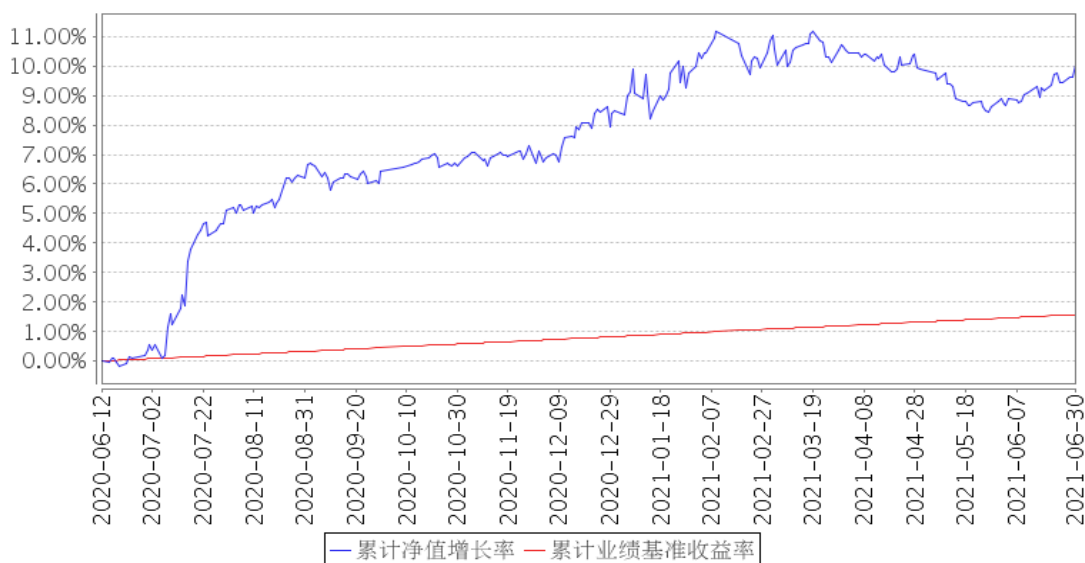
注：根据《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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。

§ 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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 72 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主

题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----------|-------------------|------------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐 黄 玮 | 本基金的基金经理，量化投资部总经理 | 2017 年 12 月 29 日 | - | 14.0 年 | 徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。 |

注：1、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会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

2021 年上半年，国内疫情持续控制较好，疫苗接种稳步进行。国内经济在此基础上稳步复苏，但介于整个上半年原材料持续上涨，给企业造成了一定的压力。国家后续出台了相应政策，以抑制大宗商品的上涨。经济增速上半年是逐步放缓的一个过程，下半年预计有一定压力。海外方面，上半年部分国家疫情仍然在反复，美国随着疫苗接种率上升，国内经济活动逐步恢复正常。美国市场由于就业数据较差，流动性方面预计不会采取过激的措施。国内流动性方面，整个上半年基本维持一个相对宽松的状态。

市场方面，上半年前期机会主要是集中在疫情受益以及出口受益方向，如部分周期股；随着国内经济活动逐步恢复正常，市场继续转向高景气度行业进行投资，如新能源、半导体等。

本基金主要通过量化多因子的方法来构建多头，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素，精选优质、具有投资价值和合理估值的个股作为主要的投资标的，同时运用股指期货进行对冲。此外，本基金积极把握了个股事件驱动、科创板新股、可转债、固定收益等确定性增强机会，也密切关注运用期货基差波动的交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.2145 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.73%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.2074 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.43%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年第三季度，国内经济将继续保持复苏状态，增长或将趋缓，有一定的压力，且结构性也将发生一定变化。我们认为，下半年将从制造业投资、服务性消费以及外需三方面拉动经济增长，会更多地依靠内生增长来稳住经济。在政策支持下，预计仍将以高端制造业作为重点发展方向。大宗商品方面，我们认为目前快速上涨带来的通胀风险还是可控的，主要认为供需格局下半年会有所改善，全球流动性也会有一定边际变化，从而抑制大宗商品的持续上涨。货币政策方面，预计仍将保持相对中性的态度，流动性趋于平稳。国内主要目标主要集中在稳增长，保证疫情后的经济活动平稳过渡。但是要密切关注海外流动性收紧对 A 股市场造成的影响。美联储有

在三季度集中缩减 QE 的预期。社融方面，上半年缩减的较快，有基数原因和稳杠杆的原因。下半年预计社融收敛速度将小于上半年，仍将重点防止资金流入房市，鼓励流向制造业等实体经济。所以在流动性变化不大背景下，上半年估值已经有所扩张，下半年估值提升空间较小，要重点关注企业盈利能力的变化。因此接下来我们将继续重视公司的盈利，困境反转，企业质量，关注事件驱动以及分析师预期等方式，来产生更多的阿尔法。此外，本基金将积极把握新股、可转债、科创板新股、事件驱动等增强机会，同时运用股指期货进行对冲，此外，也将去抓不同期货的基差波动带来的建平仓机会。

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，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 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

无。

§ 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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 9,675,030.82 | 27,885,895.04 |
| 结算备付金 | | 18,232,732.33 | 20,869,846.96 |
| 存出保证金 | | 38,770,449.99 | 40,977,717.51 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 510,480,022.59 | 409,640,550.10 |
| 其中：股票投资 | | 356,897,744.62 | 361,034,604.16 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 153,582,277.97 | 48,605,945.94 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 76,000,000.00 | 25,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 1,542,055.79 | 213,238.57 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,544,490.85 | 1,139,230.76 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 656,244,782.37 | 525,726,478.94 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | - | 22,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 927,238.38 | 16,135,920.99 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 539,679.44 | 823,443.55 |
| 应付托管费 | | 134,919.85 | 96,114.95 |
| 应付销售服务费 | | 127,031.63 | 103,625.62 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,686,707.87 | 419,892.28 |
| 应交税费 | | - | 0.53 |
| 应付利息 | | - | 16,056.45 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 84,302.56 | 160,000.00 |
| 负债合计 | | 3,499,879.73 | 39,755,054.37 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 538,597,371.56 | 407,641,712.67 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 114,147,531.08 | 78,329,711.90 |
| 所有者权益合计 | | 652,744,902.64 | 485,971,424.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 656,244,782.37 | 525,726,478.94 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 538,597,371.56 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额 346,059,596.27 份，基金份额净值 1.2145 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额 192,537,775.29 份，基金份额净值 1.2074 元。

6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|
|-----|-----|----|---------|

| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 一、收入 | | 18,205,400.06 | 9,916,759.75 |
| 1. 利息收入 | | 1,736,083.66 | 706,552.29 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 245,862.02 | 43,515.00 |
| 债券利息收入 | | 782,143.82 | 437,058.12 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 708,077.82 | 225,979.17 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 19,499,740.12 | 10,133,252.34 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 52,111,507.07 | 7,955,519.05 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -73,496.25 | 40,777.81 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.14 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | -35,606,993.35 | 1,240,339.01 |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 3,068,722.65 | 896,616.47 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | -3,180,131.50 | -979,254.44 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 149,707.78 | 56,209.56 |
| 减：二、费用 | | 11,894,082.28 | 1,871,779.96 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,345,946.29 | 989,110.78 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 749,943.85 | 169,008.19 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 798,450.03 | 24,060.58 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 5,758,167.48 | 450,996.93 |
| 5. 利息支出 | | 154,700.95 | 145,644.87 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 154,700.95 | 145,644.87 |
| 6. 税金及附加 | | 0.18 | 16,735.76 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 86,873.50 | 76,222.85 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 6,311,317.78 | 8,044,979.79 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,311,317.78 | 8,044,979.79 |

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 407,641,712.67 | 78,329,711.90 | 485,971,424.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 6,311,317.78 | 6,311,317.78 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | 130,955,658.89 | 29,506,501.40 | 160,462,160.29 |
| 其中：1. 基金申购款 | 285,758,608.60 | 61,206,485.53 | 346,965,094.13 |
| 2. 基金赎回款 | -154,802,949.71 | -31,699,984.13 | -186,502,933.84 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 538,597,371.56 | 114,147,531.08 | 652,744,902.64 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 99,748,397.41 | 3,450,524.50 | 103,198,921.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 8,044,979.79 | 8,044,979.79 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | 193,846,632.00 | 18,315,356.49 | 212,161,988.49 |
| 其中：1. 基金申购款 | 236,104,504.23 | 22,167,667.64 | 258,272,171.87 |
| 2. 基金赎回款 | -42,257,872.23 | -3,852,311.15 | -46,110,183.38 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 293,595,029.41 | 29,810,860.78 | 323,405,890.19 |

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

范瑛

苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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《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》及《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》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和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、赎回时收取赎回费用，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、赎回时收取赎回费用，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），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）。

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、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债

券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.6.4 个人所得税

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

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 9,675,030.82 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |

| | |
|-------------|--------------|
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 9,675,030.82 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 340,787,337.29 | 356,897,744.62 | 16,110,407.33 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 153,769,352.57 | 153,582,277.97 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 153,769,352.57 | 153,582,277.97 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 494,556,689.86 | 510,480,022.59 | 15,923,332.73 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | | 备注 |
|-----------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | |
| 货币衍生工具 | - | - | - | |
| 权益衍生工具 | -315,495,215.04 | - | - | |
| 其中：股指期货投资 | -315,495,215.04 | - | - | |
| 其他衍生工具 | - | - | - | |
| 合计 | -315,495,215.04 | - | - | |

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）之间按抵消后的净额为 0。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 21 手 IF2109 卖出合约，其合约市值-32,548,320.00 元，141 手 IF2108 卖出合约，其合约市值-218,987,100.00 元，44 手 IF2107 卖出合约，其合约市值-68,523,840.00 元。

2、买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 76,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 76,000,000.00 | - |

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 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,434.32 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 6,578.50 |
| 应收债券利息 | 1,536,314.53 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 163.50 |
| 合计 | 1,544,490.85 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,686,707.87 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,686,707.87 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 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 | - |
| 应付信息披露费 | 59,507.37 |
| 应付审计费 | 24,795.19 |
| 合计 | 84,302.56 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 205,140,936.34 | 205,140,936.34 |
| 本期申购 | 226,476,919.54 | 226,476,919.54 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -85,558,259.61 | -85,558,259.61 |
| 本期末 | 346,059,596.27 | 346,059,596.27 |

安信阿尔法定开混合 C

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 202,500,776.33 | 202,500,776.33 |
| 本期申购 | 59,281,689.06 | 59,281,689.06 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -69,244,690.10 | -69,244,690.10 |
| 本期末 | 192,537,775.29 | 192,537,775.29 |

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 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 | 29,874,650.37 | 9,905,043.45 | 39,779,693.82 |
| 本期利润 | 6,718,122.18 | -3,001,614.99 | 3,716,507.19 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 18,706,842.07 | 12,012,206.67 | 30,719,048.74 |
| 其中：基金申购款 | 31,037,662.60 | 17,474,474.82 | 48,512,137.42 |
| 基金赎回款 | -12,330,820.53 | -5,462,268.15 | -17,793,088.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 55,299,614.62 | 18,915,635.13 | 74,215,249.75 |

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 | 28,775,718.63 | 9,774,299.45 | 38,550,018.08 |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期利润 | 2,773,327.10 | -178,516.51 | 2,594,810.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,143,328.09 | 930,780.75 | -1,212,547.34 |
| 其中：基金申购款 | 7,421,374.86 | 5,272,973.25 | 12,694,348.11 |
| 基金赎回款 | -9,564,702.95 | -4,342,192.50 | -13,906,895.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 29,405,717.64 | 10,526,563.69 | 39,932,281.33 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-----------|----------------------------|------------|
| 活期存款利息收入 | | 57,034.87 |
| 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 | | 186,827.09 |
| 其他 | | 2,000.06 |
| 合计 | | 245,862.02 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------------|----------------------------|------------------|
| 卖出股票成交总额 | | 2,472,045,590.41 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 2,419,934,083.34 |
| 买卖股票差价收入 | | 52,111,507.07 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------------------------|----------------------------|---------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | | 49,881,487.16 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | | 48,756,892.18 |
| 减：应收利息总额 | | 1,198,091.23 |
| 买卖债券差价收入 | | -73,496.25 |

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|----------|--------------------------------|----------------|
| 股指期货投资收益 | | -35,606,993.35 |

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,068,722.65 |
| 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 | 3,068,722.65 |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -22,425,824.85 |
| 股票投资 | -22,394,433.36 |
| 债券投资 | -31,391.49 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | 19,245,693.35 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | 19,245,693.35 |
| 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 | -3,180,131.50 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 147,681.29 |
| 基金转换费收入 | 2,026.49 |
| 合计 | 149,707.78 |

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,758,167.48 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 5,758,167.48 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 2,570.94 |
| 合计 | 86,873.50 |

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 |
| 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 |
| 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 |
| 安信乾盛财富管理（深圳）有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 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 |

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 | 2,040,006,833.05 | 41.65 | 142,911,621.73 | 38.28 |

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 2021年1月1日至2021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 | 635,058.88 | 23.80 | 295,037.03 | 17.49 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020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 | 44,495.21 | 21.35 | - | - |

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

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 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,345,946.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 911,798.11 | 224,316.09 |

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的基金资产净值的 1.00% 的费率计提。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。

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 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 749,943.85 | 169,008.19 |

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的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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 | | |
|----------------|---------------------------------|-------------|------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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 | - | 175,732.54 | 175,732.54 |
| 安信证券 | - | 241.91 | 241.91 |
| 合计 | - | 175,974.45 | 175,974.45 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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 | - | 1,710.04 | 1,710.04 |
| 合计 | - | 1,710.04 | 1,710.04 |

注：本基金销售服务费每日计算，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：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021 年6月30日 | 本期 2021年1月1日至2021年6 月30日 |
|----------------------------|-------------------------------------|---|
| | 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）持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.86% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日 | 上年度可比期间 2020年6月12日（基金合同 生效日）至2020年6月30日 |
| | 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）持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |

| | | |
|-------------------------|---------------|---|
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 3.41% | - |

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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

安信阿尔法定开混合 A

| 关联方名称 | 本期末 2021年6月30日 | | 上年度末 2020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 (%) |
| 五矿资本控股有限公司 | 36,640,733.39 | 6.80 | - | - |

注：除基金管理人之外的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 2021年1月1日至2021年6月30 日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020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 |
| 招商银行 | 9,675,030.82 | 57,034.87 | 30,510,558.34 | 17,575.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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(2021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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|----|----|-----|-----|----|-----|----|----|--------|----|
| 证券 | 证券 | 成功 | 可流通 | 流通受 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值总额 | 备注 |

| 代码 | 名称 | 认购日 | 日 | 限类型 | 价格 | 值单价 | (单位: 股) | 成本总额 | | |
|--------|------|-------------|-------------|------|-------|-------|---------|----------|-----------|---|
| 300614 | 百川畅银 | 2021年5月18日 | 2021年11月25日 | 新股锁定 | 9.19 | 40.38 | 329 | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年07月12日 | 新股锁定 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日 | 新股锁定 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021年1月12日 | 2021年07月21日 | 新股锁定 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股锁定 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股锁定 | 4.31 | 13.11 | 672 | 2,896.32 | 8,809.92 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日 | 新股锁定 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021年1月20日 | 2021年7月27日 | 新股锁定 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021年1月27日 | 2021年8月3日 | 新股锁定 | 12.76 | 43.38 | 307 | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年2月2日 | 2021年8月9日 | 新股锁定 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年2月3日 | 2021年8月10日 | 新股锁定 | 9.79 | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021年2月3日 | 2021年8月10日 | 新股锁定 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月 | 2021年8月 | 新股锁定 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 18 日 | 25 日 | | | | | | | |
| 300950 | 德固特 | 2021 年 2 月 24 日 | 2021 年 9 月 3 日 | 新股锁定 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021 年 3 月 3 日 | 2021 年 9 月 13 日 | 新股锁定 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021 年 3 月 11 日 | 2021 年 9 月 22 日 | 新股锁定 | 28.77 | 99.85 | 240 | 6,904.80 | 23,964.00 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021 年 3 月 16 日 | 2021 年 9 月 27 日 | 新股锁定 | 12.85 | 25.80 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80 | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021 年 3 月 18 日 | 2021 年 9 月 27 日 | 新股锁定 | 47.33 | 251.96 | 384 | 18,174.72 | 96,752.64 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021 年 3 月 18 日 | 2021 年 9 月 29 日 | 新股锁定 | 8.53 | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021 年 3 月 22 日 | 2021 年 9 月 29 日 | 新股锁定 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021 年 3 月 29 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021 年 4 月 2 日 | 2021 年 10 月 13 日 | 新股锁定 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021 年 4 月 6 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年 4 月 7 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021 年 4 月 8 日 | 2021 年 10 月 19 日 | 新股锁定 | 7.19 | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 | 2021 年 10 | 新股锁定 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | | 8 日 | 月 15 日 | | | | | | | |
| 300975 | 商络电子 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 21 日 | 新股锁定 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股锁定 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股锁定 | 33.22 | 87.50 | 920 | 30,562.40 | 80,500.00 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021 年 4 月 19 日 | 2021 年 10 月 27 日 | 新股锁定 | 48.59 | 90.39 | 579 | 28,133.61 | 52,335.81 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021 年 4 月 19 日 | 2021 年 10 月 27 日 | 新股锁定 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 10 月 29 日 | 新股锁定 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 11 月 1 日 | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021 年 4 月 28 日 | 2021 年 11 月 11 日 | 新股锁定 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021 年 5 月 17 日 | 2021 年 11 月 26 日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021 年 5 月 26 日 | 2021 年 12 月 3 日 | 新股锁定 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021 年 5 月 25 日 | 2021 年 12 月 2 日 | 新股锁定 | 6.02 | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301002 | 崧盛 | 2021 | 2021 | 新股锁 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |

| | 股份 | 年 5 月 27 日 | 年 12 月 7 日 | 定 | | | | | | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|-----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301004 | 嘉益 股份 | 2021 年 6 月 18 日 | 2021 年 12 月 27 日 | 新股锁 定 | 7.81 | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 301007 | 德迈 仕 | 2021 年 6 月 4 日 | 2021 年 12 月 16 日 | 新股锁 定 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301009 | 可靠 股份 | 2021 年 6 月 8 日 | 2021 年 12 月 17 日 | 新股锁 定 | 12.54 | 27.89 | 801 | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301010 | 晶雪 节能 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 20 日 | 新股锁 定 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 301011 | 华立 科技 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 17 日 | 新股锁 定 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 301012 | 扬电 科技 | 2021 年 6 月 15 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 新股锁 定 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 301013 | 利和 兴 | 2021 年 6 月 21 日 | 2021 年 12 月 29 日 | 新股锁 定 | 8.72 | 27.11 | 471 | 4,107.12 | 12,768.81 | - |
| 301015 | 百洋 医药 | 2021 年 6 月 22 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股锁 定 | 7.64 | 38.83 | 462 | 3,529.68 | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔 伟 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股锁 定 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50 | - |
| 301021 | 英诺 激光 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未 上市 | 9.46 | 9.46 | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺 激光 | 2021 年 06 月 28 | 2022 年 01 月 06 | 新股锁 定 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-------------|-------|-------|--------|---------|--------------|--------------|---|
| 300919 | 中伟股份 | 2020年12月15日 | 2021年07月02日 | 新股锁定 | 24.60 | 163.00 | 506 | 12,447.60 | 82,478.00 | - |
| 600905 | 三峡能源 | 2021年6月2日 | 2021年12月10日 | 新股锁定 | 2.65 | 5.67 | 907,763 | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | - |
| 605162 | 新中港 | 2021年6月29日 | 2021年7月7日 | 新股未上市 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年6月30日 | 2021年7月9日 | 新股未上市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688183 | 生益电子 | 2021年2月10日 | 2021年8月25日 | 新股锁定 | 12.42 | 14.19 | 15,410 | 191,392.20 | 218,667.90 | - |
| 688195 | 腾景科技 | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股锁定 | 13.60 | 19.87 | 2,693 | 36,624.80 | 53,509.91 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股未上市 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021年6月23日 | 2021年7月1日 | 新股未上市 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 688607 | 康众医疗 | 2021年1月25日 | 2021年8月2日 | 新股锁定 | 23.21 | 44.50 | 1,890 | 43,866.90 | 84,105.00 | - |
| 688619 | 罗普特 | 2021年2月8日 | 2021年8月23日 | 新股锁定 | 19.31 | 26.74 | 5,856 | 113,079.36 | 156,589.44 | - |
| 688639 | 华恒生物 | 2021年4月14日 | 2021年10月22日 | 新股锁定 | 23.16 | 42.28 | 2,302 | 53,314.32 | 97,328.56 | - |
| 688661 | 和林微纳 | 2021年3月19日 | 2021年9月29日 | 新股锁定 | 17.71 | 84.01 | 1,452 | 25,714.92 | 121,982.52 | - |
| 688665 | 四方 | 2021 | 2021 | 新股锁 | 29.53 | 129.46 | 1,687 | 49,817.11 | 218,399.02 | - |

| | 光电 | 年 2 月 2 日 | 年 8 月 9 日 | 定 | | | | | | |
|----------------------|----------|-----------------------|---------------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 688690 | 纳微科技 | 2021 年 6 月 16 日 | 2021 年 12 月 23 日 | 新股锁 定 | 8.07 | 79.89 | 3,477 | 28,059.39 | 277,777.53 | - |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券 代码 | 证券 名称 | 成功 认购日 | 可流通 日 | 流通受 限类型 | 认购 价格 | 期末估 值单价 | 数量 (单位： 张) | 期末 成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113049 | 长汽 转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 8 日 | 配债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 50 | 4,999.98 | 4,999.98 | - |
| 113050 | 南银 转债 | 2021 年 6 月 15 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 配债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 3,140 | 313,998.62 | 313,998.62 | - |
| 113050 | 南银 转债 | 2021 年 6 月 17 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 1,450 | 144,998.09 | 144,998.09 | - |
| 127037 | 银轮 转债 | 2021 年 6 月 7 日 | 2021 年 7 月 9 日 | 配债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 22 | 2,199.99 | 2,199.99 | - |
| 127038 | 国微 转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 14 日 | 配债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 10 | 1,000.00 | 1,000.00 | - |

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，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，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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08%（2020 年 12 月 31 日：0.06%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 40,571,572.10 | 36,196,380.00 |
| 合计 | 40,571,572.10 | 36,196,380.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 463,996.69 | 225,997.03 |
| AAA 以下 | 29,528.98 | 43,999.81 |
| 未评级 | 112,517,180.20 | 12,139,569.10 |
| 合计 | 113,010,705.87 | 12,409,565.94 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以净价列示。

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

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2021 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 | 9,675,030.82 | - | - | - | 9,675,030.82 |
| 结算备付金 | 18,232,732.33 | - | - | - | 18,232,732.33 |
| 存出保证金 | 38,770,449.99 | - | - | - | 38,770,449.99 |
| 交易性金融资产 | 40,914,572.30 | 112,174,180.00 | 493,525.67 | 356,897,744.62 | 510,480,022.59 |
| 买入返售金融资产 | 76,000,000.00 | - | - | - | 76,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,544,490.85 | 1,544,490.85 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|------------|----------------|----------------|
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,542,055.79 | 1,542,055.79 |
| 资产总计 | 183,592,785.44 | 112,174,180.00 | 493,525.67 | 359,984,291.26 | 656,244,782.37 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 539,679.44 | 539,679.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 134,919.85 | 134,919.85 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 927,238.38 | 927,238.38 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 127,031.63 | 127,031.63 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,686,707.87 | 1,686,707.87 |
| 其他负债 | - | - | - | 84,302.56 | 84,302.56 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,499,879.73 | 3,499,879.73 |
| 利率敏感度缺口 | 183,592,785.44 | 112,174,180.00 | 493,525.67 | 356,484,411.53 | 652,744,902.64 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 27,885,895.04 | - | - | - | 27,885,895.04 |
| 结算备付金 | 20,869,846.96 | - | - | - | 20,869,846.96 |
| 存出保证金 | 40,977,717.51 | - | - | - | 40,977,717.51 |
| 交易性金融资产 | 36,196,380.00 | 12,139,569.10 | 269,996.84 | 361,034,604.16 | 409,640,550.10 |
| 买入返售金融资产 | 25,000,000.00 | - | - | - | 25,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,139,230.76 | 1,139,230.76 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 213,238.57 | 213,238.57 |
| 资产总计 | 150,929,839.51 | 12,139,569.10 | 269,996.84 | 362,387,073.49 | 525,726,478.94 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 823,443.55 | 823,443.55 |
| 应付托管费 | - | - | - | 96,114.95 | 96,114.95 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 16,135,920.99 | 16,135,920.99 |
| 卖出回购金融资产款 | 22,000,000.00 | - | - | - | 22,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 103,625.62 | 103,625.62 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 419,892.28 | 419,892.28 |
| 应付利息 | - | - | - | 16,056.45 | 16,056.45 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.53 | 0.53 |
| 其他负债 | - | - | - | 160,000.00 | 160,000.00 |
| 负债总计 | 22,000,000.00 | - | - | 17,755,054.37 | 39,755,054.37 |
| 利率敏感度缺口 | 128,929,839.51 | 12,139,569.10 | 269,996.84 | 344,632,019.12 | 485,971,424.57 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2021 年 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 | |

| | | | |
|----|------------------|-------------|------------|
| | | | 31 日) |
| 分析 | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 523,953.83 | 45,685.93 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -521,037.87 | -45,402.47 |

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。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 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 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 | 356,897,744.62 | 54.68 | 361,034,604.16 | 74.29 |
| 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 | 356,897,744.62 | 54.68 | 361,034,604.16 | 74.29 |

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（2021 年 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） | |
| 分析 | 1. 沪深 300 指数上升 5% | 19,797,086.13 | 19,362,171.88 |
| | 2. 沪深 300 指数下降 5% | -19,797,086.13 | -19,362,171.88 |

§ 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 | 356,897,744.62 | 54.38 |
| | 其中：股票 | 356,897,744.62 | 54.38 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 153,582,277.97 | 23.40 |
| | 其中：债券 | 153,582,277.97 | 23.40 |
| | 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 | 76,000,000.00 | 11.58 |
| | 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 | 27,907,763.15 | 4.25 |
| 8 | 其他各项资产 | 41,856,996.63 | 6.38 |
| 9 | 合计 | 656,244,782.37 | 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 | 3,300,922.44 | 0.51 |
| B | 采矿业 | 6,303,968.08 | 0.97 |
| C | 制造业 | 210,063,125.80 | 32.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,623,567.60 | 1.47 |
| E | 建筑业 | 3,057,264.37 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | 874,059.58 | 0.13 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,151,521.80 | 0.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | 244,885.00 | 0.04 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,682,553.74 | 1.79 |
| J | 金融业 | 77,916,068.12 | 11.94 |
| K | 房地产业 | 3,445,345.00 | 0.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,598,163.50 | 1.16 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,983,347.30 | 0.92 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 152,175.75 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 11,964,147.74 | 1.83 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,536,628.80 | 0.24 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 356,897,744.62 | 54.68 |

7.2.2 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。

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

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 | 600519 | 贵州茅台 | 9,500 | 19,538,650.00 | 2.99 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 35,100 | 10,455,939.00 | 1.60 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 314,152 | 10,301,044.08 | 1.58 |
| 4 | 002142 | 宁波银行 | 256,304 | 9,988,166.88 | 1.53 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 338,300 | 7,652,346.00 | 1.17 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 103,850 | 6,675,478.00 | 1.02 |
| 7 | 601012 | 隆基股份 | 73,156 | 6,499,179.04 | 1.00 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 297,800 | 6,119,790.00 | 0.94 |
| 9 | 300015 | 爱尔眼科 | 78,113 | 5,544,460.74 | 0.85 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 215,900 | 5,384,546.00 | 0.82 |
| 11 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.79 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 12 | 601888 | 中国中免 | 16,555 | 4,968,155.50 | 0.76 |
| 13 | 603501 | 韦尔股份 | 15,300 | 4,926,600.00 | 0.75 |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 9,100 | 4,866,680.00 | 0.75 |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 75,400 | 4,863,300.00 | 0.75 |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 30,670 | 4,802,615.30 | 0.74 |
| 17 | 000725 | 京东方 A | 741,300 | 4,625,712.00 | 0.71 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 84,500 | 4,402,450.00 | 0.67 |
| 19 | 600809 | 山西汾酒 | 9,400 | 4,211,200.00 | 0.65 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 58,600 | 4,182,282.00 | 0.64 |
| 21 | 300124 | 汇川技术 | 54,050 | 4,013,753.00 | 0.61 |
| 22 | 002594 | 比亚迪 | 15,700 | 3,940,700.00 | 0.60 |
| 23 | 002475 | 立讯精密 | 82,300 | 3,785,800.00 | 0.58 |
| 24 | 600919 | 江苏银行 | 514,100 | 3,650,110.00 | 0.56 |
| 25 | 600276 | 恒瑞医药 | 53,353 | 3,626,403.41 | 0.56 |
| 26 | 600900 | 长江电力 | 174,200 | 3,595,488.00 | 0.55 |
| 27 | 600763 | 通策医疗 | 8,700 | 3,575,700.00 | 0.55 |
| 28 | 300122 | 智飞生物 | 19,100 | 3,566,543.00 | 0.55 |
| 29 | 600887 | 伊利股份 | 92,400 | 3,403,092.00 | 0.52 |
| 30 | 600309 | 万华化学 | 30,600 | 3,329,892.00 | 0.51 |
| 31 | 002714 | 牧原股份 | 54,088 | 3,289,632.16 | 0.50 |
| 32 | 000568 | 泸州老窖 | 13,800 | 3,255,972.00 | 0.50 |
| 33 | 600031 | 三一重工 | 109,155 | 3,173,135.85 | 0.49 |
| 34 | 601628 | 中国人寿 | 89,700 | 3,039,933.00 | 0.47 |
| 35 | 000661 | 长春高新 | 7,300 | 2,825,100.00 | 0.43 |
| 36 | 601009 | 南京银行 | 242,100 | 2,546,892.00 | 0.39 |
| 37 | 002179 | 中航光电 | 30,900 | 2,441,718.00 | 0.37 |
| 38 | 002230 | 科大讯飞 | 34,500 | 2,331,510.00 | 0.36 |
| 39 | 002027 | 分众传媒 | 241,300 | 2,270,633.00 | 0.35 |
| 40 | 600436 | 片仔癀 | 4,868 | 2,182,324.40 | 0.33 |
| 41 | 601838 | 成都银行 | 172,300 | 2,177,872.00 | 0.33 |
| 42 | 603288 | 海天味业 | 16,828 | 2,169,970.60 | 0.33 |
| 43 | 002304 | 洋河股份 | 10,400 | 2,154,880.00 | 0.33 |
| 44 | 002812 | 恩捷股份 | 9,200 | 2,153,720.00 | 0.33 |
| 45 | 601211 | 国泰君安 | 125,129 | 2,144,711.06 | 0.33 |
| 46 | 601688 | 华泰证券 | 135,670 | 2,143,586.00 | 0.33 |
| 47 | 002271 | 东方雨虹 | 38,300 | 2,118,756.00 | 0.32 |
| 48 | 300529 | 健帆生物 | 24,000 | 2,072,640.00 | 0.32 |
| 49 | 600438 | 通威股份 | 47,700 | 2,063,979.00 | 0.32 |
| 50 | 000063 | 中兴通讯 | 61,800 | 2,053,614.00 | 0.31 |
| 51 | 300274 | 阳光电源 | 17,000 | 1,956,020.00 | 0.30 |
| 52 | 300014 | 亿纬锂能 | 18,800 | 1,953,884.00 | 0.30 |
| 53 | 600999 | 招商证券 | 101,600 | 1,932,432.00 | 0.30 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 54 | 601899 | 紫金矿业 | 197,032 | 1,909,240.08 | 0.29 |
| 55 | 600690 | 海尔智家 | 73,332 | 1,900,032.12 | 0.29 |
| 56 | 600132 | 重庆啤酒 | 9,200 | 1,821,140.00 | 0.28 |
| 57 | 300347 | 泰格医药 | 9,300 | 1,797,690.00 | 0.28 |
| 58 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,600 | 1,767,914.00 | 0.27 |
| 59 | 601336 | 新华保险 | 37,800 | 1,735,398.00 | 0.27 |
| 60 | 601601 | 中国太保 | 59,800 | 1,732,406.00 | 0.27 |
| 61 | 002241 | 歌尔股份 | 40,500 | 1,730,970.00 | 0.27 |
| 62 | 603986 | 兆易创新 | 9,200 | 1,728,680.00 | 0.26 |
| 63 | 603799 | 华友钴业 | 14,500 | 1,655,900.00 | 0.25 |
| 64 | 300408 | 三环集团 | 34,900 | 1,480,458.00 | 0.23 |
| 65 | 000100 | TCL 科技 | 187,900 | 1,437,435.00 | 0.22 |
| 66 | 600570 | 恒生电子 | 15,400 | 1,436,050.00 | 0.22 |
| 67 | 601319 | 中国人保 | 239,400 | 1,419,642.00 | 0.22 |
| 68 | 601939 | 建设银行 | 209,100 | 1,390,515.00 | 0.21 |
| 69 | 601377 | 兴业证券 | 143,400 | 1,385,244.00 | 0.21 |
| 70 | 002129 | 中环股份 | 35,600 | 1,374,160.00 | 0.21 |
| 71 | 002311 | 海大集团 | 16,500 | 1,346,400.00 | 0.21 |
| 72 | 002352 | 顺丰控股 | 19,800 | 1,340,460.00 | 0.21 |
| 73 | 600600 | 青岛啤酒 | 11,500 | 1,329,975.00 | 0.20 |
| 74 | 600660 | 福耀玻璃 | 23,800 | 1,329,230.00 | 0.20 |
| 75 | 002049 | 紫光国微 | 8,600 | 1,326,034.00 | 0.20 |
| 76 | 000625 | 长安汽车 | 50,200 | 1,319,256.00 | 0.20 |
| 77 | 000786 | 北新建材 | 33,600 | 1,318,800.00 | 0.20 |
| 78 | 688111 | 金山办公 | 3,200 | 1,263,360.00 | 0.19 |
| 79 | 600196 | 复星医药 | 16,900 | 1,218,997.00 | 0.19 |
| 80 | 002371 | 北方华创 | 4,300 | 1,192,734.00 | 0.18 |
| 81 | 601668 | 中国建筑 | 249,900 | 1,162,035.00 | 0.18 |
| 82 | 601633 | 长城汽车 | 26,500 | 1,155,135.00 | 0.18 |
| 83 | 300450 | 先导智能 | 18,960 | 1,140,254.40 | 0.17 |
| 84 | 300413 | 芒果超媒 | 16,500 | 1,131,900.00 | 0.17 |
| 85 | 600028 | 中国石化 | 255,600 | 1,114,416.00 | 0.17 |
| 86 | 300142 | 沃森生物 | 17,700 | 1,092,090.00 | 0.17 |
| 87 | 600703 | 三安光电 | 34,000 | 1,089,700.00 | 0.17 |
| 88 | 601857 | 中国石油 | 201,200 | 1,064,348.00 | 0.16 |
| 89 | 600104 | 上汽集团 | 48,300 | 1,061,151.00 | 0.16 |
| 90 | 601818 | 光大银行 | 276,400 | 1,044,792.00 | 0.16 |
| 91 | 600926 | 杭州银行 | 69,100 | 1,019,225.00 | 0.16 |
| 92 | 002601 | 龙蟠佰利 | 29,300 | 1,013,194.00 | 0.16 |
| 93 | 600588 | 用友网络 | 30,200 | 1,004,452.00 | 0.15 |
| 94 | 600050 | 中国联通 | 225,800 | 975,456.00 | 0.15 |
| 95 | 000157 | 中联重科 | 105,200 | 972,048.00 | 0.15 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 96 | 000977 | 浪潮信息 | 32,200 | 905,786.00 | 0.14 |
| 97 | 002821 | 凯莱英 | 2,400 | 894,240.00 | 0.14 |
| 98 | 600346 | 恒力石化 | 33,729 | 885,048.96 | 0.14 |
| 99 | 601155 | 新城控股 | 21,200 | 881,920.00 | 0.14 |
| 100 | 600741 | 华域汽车 | 33,500 | 880,045.00 | 0.13 |
| 101 | 002493 | 荣盛石化 | 50,432 | 870,960.64 | 0.13 |
| 102 | 002966 | 苏州银行 | 117,900 | 866,565.00 | 0.13 |
| 103 | 601390 | 中国中铁 | 161,900 | 848,356.00 | 0.13 |
| 104 | 688012 | 中微公司 | 4,900 | 813,008.00 | 0.12 |
| 105 | 601100 | 恒立液压 | 9,400 | 807,648.00 | 0.12 |
| 106 | 603444 | 吉比特 | 1,500 | 795,000.00 | 0.12 |
| 107 | 600585 | 海螺水泥 | 19,280 | 791,444.00 | 0.12 |
| 108 | 601600 | 中国铝业 | 149,080 | 790,124.00 | 0.12 |
| 109 | 300595 | 欧普康视 | 7,600 | 786,980.00 | 0.12 |
| 110 | 000776 | 广发证券 | 51,500 | 779,710.00 | 0.12 |
| 111 | 603806 | 福斯特 | 7,300 | 767,449.00 | 0.12 |
| 112 | 000002 | 万 科 A | 32,000 | 761,920.00 | 0.12 |
| 113 | 300957 | 贝泰妮 | 2,784 | 748,808.64 | 0.11 |
| 114 | 600176 | 中国巨石 | 47,586 | 738,058.86 | 0.11 |
| 115 | 600893 | 航发动力 | 13,800 | 734,022.00 | 0.11 |
| 116 | 000807 | 云铝股份 | 61,600 | 733,040.00 | 0.11 |
| 117 | 300012 | 华测检测 | 22,900 | 730,052.00 | 0.11 |
| 118 | 601658 | 邮储银行 | 143,300 | 719,366.00 | 0.11 |
| 119 | 002508 | 老板电器 | 15,400 | 716,100.00 | 0.11 |
| 120 | 600019 | 宝钢股份 | 89,260 | 681,946.40 | 0.10 |
| 121 | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,400 | 672,070.00 | 0.10 |
| 122 | 002841 | 视源股份 | 5,400 | 671,166.00 | 0.10 |
| 123 | 603659 | 璞泰来 | 4,900 | 669,340.00 | 0.10 |
| 124 | 001979 | 招商蛇口 | 60,500 | 662,475.00 | 0.10 |
| 125 | 600584 | 长电科技 | 17,300 | 651,864.00 | 0.10 |
| 126 | 002410 | 广联达 | 9,400 | 641,080.00 | 0.10 |
| 127 | 000963 | 华东医药 | 13,900 | 639,539.00 | 0.10 |
| 128 | 603882 | 金域医学 | 4,000 | 639,080.00 | 0.10 |
| 129 | 688169 | 石头科技 | 500 | 630,500.00 | 0.10 |
| 130 | 300601 | 康泰生物 | 4,200 | 625,800.00 | 0.10 |
| 131 | 002008 | 大族激光 | 15,300 | 617,967.00 | 0.09 |
| 132 | 600111 | 北方稀土 | 29,336 | 607,255.20 | 0.09 |
| 133 | 600426 | 华鲁恒升 | 19,300 | 597,335.00 | 0.09 |
| 134 | 603833 | 欧派家居 | 4,200 | 596,232.00 | 0.09 |
| 135 | 000069 | 华侨城 A | 78,100 | 581,064.00 | 0.09 |
| 136 | 600760 | 中航沈飞 | 9,620 | 580,086.00 | 0.09 |
| 137 | 000739 | 普洛药业 | 19,200 | 564,480.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 138 | 002648 | 卫星石化 | 14,400 | 564,336.00 | 0.09 |
| 139 | 000938 | 紫光股份 | 25,500 | 557,940.00 | 0.09 |
| 140 | 603369 | 今世缘 | 10,100 | 547,016.00 | 0.08 |
| 141 | 601618 | 中国中冶 | 181,400 | 540,572.00 | 0.08 |
| 142 | 300671 | 富满电子 | 4,100 | 539,724.00 | 0.08 |
| 143 | 600183 | 生益科技 | 23,000 | 538,430.00 | 0.08 |
| 144 | 000596 | 古井贡酒 | 2,200 | 526,900.00 | 0.08 |
| 145 | 688396 | 华润微 | 5,700 | 518,814.00 | 0.08 |
| 146 | 002050 | 三花智控 | 21,600 | 517,968.00 | 0.08 |
| 147 | 600018 | 上港集团 | 106,000 | 505,620.00 | 0.08 |
| 148 | 600383 | 金地集团 | 49,000 | 501,760.00 | 0.08 |
| 149 | 688696 | 极米科技 | 600 | 499,200.00 | 0.08 |
| 150 | 601238 | 广汽集团 | 38,300 | 495,985.00 | 0.08 |
| 151 | 603392 | 万泰生物 | 1,900 | 492,442.00 | 0.08 |
| 152 | 002624 | 完美世界 | 20,400 | 487,764.00 | 0.07 |
| 153 | 300558 | 贝达药业 | 4,500 | 487,080.00 | 0.07 |
| 154 | 601233 | 桐昆股份 | 20,200 | 486,618.00 | 0.07 |
| 155 | 300628 | 亿联网络 | 5,700 | 477,660.00 | 0.07 |
| 156 | 688363 | 华熙生物 | 1,700 | 472,362.00 | 0.07 |
| 157 | 000338 | 潍柴动力 | 26,200 | 468,194.00 | 0.07 |
| 158 | 603517 | 绝味食品 | 5,500 | 463,595.00 | 0.07 |
| 159 | 601225 | 陕西煤业 | 39,000 | 462,150.00 | 0.07 |
| 160 | 603993 | 洛阳钼业 | 88,400 | 456,144.00 | 0.07 |
| 161 | 688008 | 澜起科技 | 7,300 | 455,374.00 | 0.07 |
| 162 | 300363 | 博腾股份 | 5,400 | 454,248.00 | 0.07 |
| 163 | 601799 | 星宇股份 | 2,000 | 451,440.00 | 0.07 |
| 164 | 300676 | 华大基因 | 3,800 | 450,680.00 | 0.07 |
| 165 | 600522 | 中天科技 | 44,700 | 447,000.00 | 0.07 |
| 166 | 688083 | 中望软件 | 801 | 442,392.30 | 0.07 |
| 167 | 300037 | 新宙邦 | 4,400 | 440,440.00 | 0.07 |
| 168 | 300979 | 华利集团 | 4,020 | 433,590.00 | 0.07 |
| 169 | 300782 | 卓胜微 | 800 | 430,000.00 | 0.07 |
| 170 | 000983 | 山西焦煤 | 51,100 | 424,641.00 | 0.07 |
| 171 | 601615 | 明阳智能 | 25,700 | 416,083.00 | 0.06 |
| 172 | 688383 | 新益昌 | 2,900 | 408,929.00 | 0.06 |
| 173 | 002044 | 美年健康 | 44,700 | 407,217.00 | 0.06 |
| 174 | 300144 | 宋城演艺 | 24,091 | 404,728.80 | 0.06 |
| 175 | 603195 | 公牛集团 | 2,000 | 404,000.00 | 0.06 |
| 176 | 601088 | 中国神华 | 20,000 | 390,400.00 | 0.06 |
| 177 | 002459 | 晶澳科技 | 7,900 | 387,100.00 | 0.06 |
| 178 | 600009 | 上海机场 | 8,000 | 385,040.00 | 0.06 |
| 179 | 603236 | 移远通信 | 2,230 | 380,460.30 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 180 | 603786 | 科博达 | 5,000 | 377,500.00 | 0.06 |
| 181 | 688981 | 中芯国际 | 6,100 | 377,102.00 | 0.06 |
| 182 | 600765 | 中航重机 | 16,300 | 369,195.00 | 0.06 |
| 183 | 688777 | 中控技术 | 3,900 | 367,185.00 | 0.06 |
| 184 | 600795 | 国电电力 | 150,700 | 366,201.00 | 0.06 |
| 185 | 601881 | 中国银河 | 33,700 | 363,286.00 | 0.06 |
| 186 | 300496 | 中科创达 | 2,300 | 361,238.00 | 0.06 |
| 187 | 300033 | 同花顺 | 3,200 | 360,896.00 | 0.06 |
| 188 | 600057 | 厦门象屿 | 57,500 | 359,375.00 | 0.06 |
| 189 | 600958 | 东方证券 | 35,900 | 358,641.00 | 0.05 |
| 190 | 300316 | 晶盛机电 | 7,100 | 358,550.00 | 0.05 |
| 191 | 002353 | 杰瑞股份 | 8,000 | 357,600.00 | 0.05 |
| 192 | 601138 | 工业富联 | 28,800 | 357,408.00 | 0.05 |
| 193 | 000898 | 鞍钢股份 | 80,300 | 357,335.00 | 0.05 |
| 194 | 601005 | 重庆钢铁 | 132,000 | 352,440.00 | 0.05 |
| 195 | 688018 | 乐鑫科技 | 1,500 | 350,130.00 | 0.05 |
| 196 | 002541 | 鸿路钢构 | 6,000 | 350,100.00 | 0.05 |
| 197 | 688208 | 道通科技 | 4,000 | 347,960.00 | 0.05 |
| 198 | 300171 | 东富龙 | 8,500 | 345,525.00 | 0.05 |
| 199 | 601988 | 中国银行 | 111,800 | 344,344.00 | 0.05 |
| 200 | 600808 | 马钢股份 | 80,100 | 343,629.00 | 0.05 |
| 201 | 002928 | 华夏航空 | 22,600 | 341,260.00 | 0.05 |
| 202 | 300115 | 长盈精密 | 16,440 | 338,664.00 | 0.05 |
| 203 | 000825 | 太钢不锈 | 43,700 | 327,313.00 | 0.05 |
| 204 | 601995 | 中金公司 | 5,300 | 325,950.00 | 0.05 |
| 205 | 000538 | 云南白药 | 2,800 | 324,016.00 | 0.05 |
| 206 | 601985 | 中国核电 | 63,400 | 320,804.00 | 0.05 |
| 207 | 000039 | 中集集团 | 17,600 | 319,968.00 | 0.05 |
| 208 | 600350 | 山东高速 | 50,300 | 309,345.00 | 0.05 |
| 209 | 300894 | 火星人 | 4,428 | 301,104.00 | 0.05 |
| 210 | 300677 | 英科医疗 | 2,400 | 299,520.00 | 0.05 |
| 211 | 300394 | 天孚通信 | 11,720 | 296,750.40 | 0.05 |
| 212 | 603899 | 晨光文具 | 3,500 | 295,960.00 | 0.05 |
| 213 | 688126 | 沪硅产业 | 10,000 | 291,800.00 | 0.04 |
| 214 | 000513 | 丽珠集团 | 5,700 | 285,114.00 | 0.04 |
| 215 | 002555 | 三七互娱 | 11,698 | 280,985.96 | 0.04 |
| 216 | 601699 | 潞安环能 | 23,600 | 278,716.00 | 0.04 |
| 217 | 601998 | 中信银行 | 54,600 | 278,460.00 | 0.04 |
| 218 | 688690 | 纳微科技 | 3,477 | 277,777.53 | 0.04 |
| 219 | 603486 | 科沃斯 | 1,200 | 273,696.00 | 0.04 |
| 220 | 300009 | 安科生物 | 17,400 | 259,260.00 | 0.04 |
| 221 | 300035 | 中科电气 | 10,500 | 256,725.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 222 | 000012 | 南玻A | 24,900 | 254,976.00 | 0.04 |
| 223 | 688007 | 光峰科技 | 6,000 | 251,280.00 | 0.04 |
| 224 | 600039 | 四川路桥 | 39,400 | 247,038.00 | 0.04 |
| 225 | 603816 | 顾家家居 | 3,186 | 246,214.08 | 0.04 |
| 226 | 600754 | 锦江酒店 | 4,300 | 244,885.00 | 0.04 |
| 227 | 601006 | 大秦铁路 | 36,200 | 238,196.00 | 0.04 |
| 228 | 002867 | 周大生 | 11,850 | 234,274.50 | 0.04 |
| 229 | 601117 | 中国化学 | 26,700 | 233,892.00 | 0.04 |
| 230 | 688183 | 生益电子 | 15,410 | 218,667.90 | 0.03 |
| 231 | 688665 | 四方光电 | 1,687 | 218,399.02 | 0.03 |
| 232 | 300841 | 康华生物 | 800 | 215,040.00 | 0.03 |
| 233 | 603180 | 金牌厨柜 | 4,500 | 214,605.00 | 0.03 |
| 234 | 605499 | 东鹏饮料 | 832 | 208,665.60 | 0.03 |
| 235 | 600845 | 宝信软件 | 4,050 | 206,145.00 | 0.03 |
| 236 | 603267 | 鸿远电子 | 1,600 | 204,672.00 | 0.03 |
| 237 | 601918 | 新集能源 | 41,700 | 203,913.00 | 0.03 |
| 238 | 688005 | 容百科技 | 1,600 | 193,920.00 | 0.03 |
| 239 | 600702 | 舍得酒业 | 900 | 192,402.00 | 0.03 |
| 240 | 002643 | 万润股份 | 10,800 | 192,024.00 | 0.03 |
| 241 | 000425 | 徐工机械 | 30,000 | 191,100.00 | 0.03 |
| 242 | 600989 | 宝丰能源 | 13,900 | 190,152.00 | 0.03 |
| 243 | 000733 | 振华科技 | 3,100 | 189,317.00 | 0.03 |
| 244 | 688122 | 西部超导 | 2,900 | 188,123.00 | 0.03 |
| 245 | 600546 | 山煤国际 | 26,200 | 188,116.00 | 0.03 |
| 246 | 002906 | 华阳集团 | 5,900 | 186,322.00 | 0.03 |
| 247 | 600060 | 海信视像 | 11,000 | 185,900.00 | 0.03 |
| 248 | 000932 | 华菱钢铁 | 27,800 | 183,480.00 | 0.03 |
| 249 | 300775 | 三角防务 | 4,800 | 183,360.00 | 0.03 |
| 250 | 300726 | 宏达电子 | 2,600 | 183,274.00 | 0.03 |
| 251 | 600884 | 杉杉股份 | 7,800 | 181,896.00 | 0.03 |
| 252 | 603020 | 爱普股份 | 9,700 | 181,099.00 | 0.03 |
| 253 | 600011 | 华能国际 | 42,900 | 181,038.00 | 0.03 |
| 254 | 601689 | 拓普集团 | 4,800 | 179,664.00 | 0.03 |
| 255 | 603179 | 新泉股份 | 5,200 | 170,976.00 | 0.03 |
| 256 | 002414 | 高德红外 | 5,775 | 159,274.50 | 0.02 |
| 257 | 688619 | 罗普特 | 5,856 | 156,589.44 | 0.02 |
| 258 | 688680 | 海优新材 | 600 | 154,200.00 | 0.02 |
| 259 | 600161 | 天坛生物 | 4,400 | 150,700.00 | 0.02 |
| 260 | 300474 | 景嘉微 | 1,500 | 146,880.00 | 0.02 |
| 261 | 002709 | 天赐材料 | 1,200 | 127,896.00 | 0.02 |
| 262 | 688661 | 和林微纳 | 1,452 | 121,982.52 | 0.02 |
| 263 | 000301 | 东方盛虹 | 5,800 | 121,220.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 264 | 603568 | 伟明环保 | 5,100 | 116,433.00 | 0.02 |
| 265 | 300308 | 中际旭创 | 2,900 | 111,708.00 | 0.02 |
| 266 | 300999 | 金龙鱼 | 1,200 | 101,952.00 | 0.02 |
| 267 | 603260 | 合盛硅业 | 1,300 | 99,983.00 | 0.02 |
| 268 | 688639 | 华恒生物 | 2,302 | 97,328.56 | 0.01 |
| 269 | 600219 | 南山铝业 | 25,300 | 91,080.00 | 0.01 |
| 270 | 300973 | 立高食品 | 660 | 88,155.60 | 0.01 |
| 271 | 002568 | 百润股份 | 900 | 85,311.00 | 0.01 |
| 272 | 688607 | 康众医疗 | 1,890 | 84,105.00 | 0.01 |
| 273 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 274 | 300919 | 中伟股份 | 506 | 82,478.00 | 0.01 |
| 275 | 002202 | 金风科技 | 5,800 | 70,528.00 | 0.01 |
| 276 | 600848 | 上海临港 | 3,140 | 56,206.00 | 0.01 |
| 277 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 278 | 688195 | 腾景科技 | 2,693 | 53,509.91 | 0.01 |
| 279 | 300981 | 中红医疗 | 579 | 52,335.81 | 0.01 |
| 280 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 281 | 601872 | 招商轮船 | 6,840 | 31,600.80 | 0.00 |
| 282 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 283 | 300953 | 震裕科技 | 240 | 23,964.00 | 0.00 |
| 284 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 285 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 286 | 002126 | 银轮股份 | 1,900 | 19,760.00 | 0.00 |
| 287 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 288 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 289 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 290 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 291 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 292 | 300940 | 南极光 | 307 | 13,317.66 | 0.00 |
| 293 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 294 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 295 | 600406 | 国电南瑞 | 560 | 13,014.40 | 0.00 |
| 296 | 301013 | 利和兴 | 471 | 12,768.81 | 0.00 |
| 297 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 298 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 299 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 300 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 301 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 302 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 303 | 300956 | 英力股份 | 371 | 9,571.80 | 0.00 |
| 304 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 305 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 306 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 307 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 308 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 309 | 300931 | 通用电梯 | 672 | 8,809.92 | 0.00 |
| 310 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 311 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 312 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 313 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 314 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 315 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 316 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 317 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 318 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 319 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 320 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 321 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 322 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 323 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 324 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 325 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 326 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 327 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 328 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 329 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 330 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 331 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 332 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 333 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 334 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 601398 | 工商银行 | 39,165,308.00 | 8.06 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 37,678,237.00 | 7.75 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 32,423,337.36 | 6.67 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 30,334,561.60 | 6.24 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 24,860,286.00 | 5.12 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 22,674,699.00 | 4.67 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 21,941,722.00 | 4.52 |
| 8 | 600809 | 山西汾酒 | 21,877,008.40 | 4.50 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 20,413,550.62 | 4.20 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 20,308,936.65 | 4.18 |
| 11 | 000725 | 京东方 A | 19,945,586.00 | 4.10 |
| 12 | 000333 | 美的集团 | 19,311,189.00 | 3.97 |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 19,209,162.00 | 3.95 |
| 14 | 603501 | 韦尔股份 | 19,156,510.22 | 3.94 |
| 15 | 601668 | 中国建筑 | 18,899,646.80 | 3.89 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 18,223,061.41 | 3.75 |
| 17 | 601012 | 隆基股份 | 18,069,763.23 | 3.72 |
| 18 | 601628 | 中国人寿 | 17,969,460.00 | 3.70 |
| 19 | 600600 | 青岛啤酒 | 17,880,777.00 | 3.68 |
| 20 | 000002 | 万 科 A | 17,702,026.64 | 3.64 |
| 21 | 002415 | 海康威视 | 16,978,115.00 | 3.49 |
| 22 | 600900 | 长江电力 | 16,936,381.00 | 3.49 |
| 23 | 000100 | TCL 科技 | 16,004,459.00 | 3.29 |
| 24 | 601888 | 中国中免 | 15,847,230.00 | 3.26 |
| 25 | 000001 | 平安银行 | 15,834,476.00 | 3.26 |
| 26 | 600690 | 海尔智家 | 15,826,502.34 | 3.26 |
| 27 | 600276 | 恒瑞医药 | 15,781,124.00 | 3.25 |
| 28 | 601336 | 新华保险 | 15,643,021.42 | 3.22 |
| 29 | 002475 | 立讯精密 | 15,636,762.30 | 3.22 |
| 30 | 300015 | 爱尔眼科 | 15,378,463.46 | 3.16 |
| 31 | 601328 | 交通银行 | 15,245,534.00 | 3.14 |
| 32 | 002304 | 洋河股份 | 14,791,605.32 | 3.04 |
| 33 | 601899 | 紫金矿业 | 14,718,821.59 | 3.03 |
| 34 | 600030 | 中信证券 | 14,334,422.98 | 2.95 |
| 35 | 601939 | 建设银行 | 14,010,951.00 | 2.88 |
| 36 | 002230 | 科大讯飞 | 13,869,778.00 | 2.85 |
| 37 | 300124 | 汇川技术 | 13,864,789.72 | 2.85 |
| 38 | 601633 | 长城汽车 | 13,777,314.00 | 2.84 |
| 39 | 300529 | 健帆生物 | 13,711,613.00 | 2.82 |
| 40 | 603259 | 药明康德 | 13,634,598.04 | 2.81 |
| 41 | 603799 | 华友钴业 | 13,560,075.00 | 2.79 |
| 42 | 002594 | 比亚迪 | 13,418,307.00 | 2.76 |
| 43 | 002027 | 分众传媒 | 13,249,299.89 | 2.73 |
| 44 | 600585 | 海螺水泥 | 13,113,240.38 | 2.70 |
| 45 | 601211 | 国泰君安 | 13,113,002.84 | 2.70 |
| 46 | 300122 | 智飞生物 | 13,056,296.60 | 2.69 |
| 47 | 600028 | 中国石化 | 12,989,081.51 | 2.67 |
| 48 | 601100 | 恒立液压 | 12,927,371.12 | 2.66 |
| 49 | 600031 | 三一重工 | 12,772,449.00 | 2.63 |
| 50 | 000661 | 长春高新 | 12,754,963.51 | 2.62 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 51 | 300014 | 亿纬锂能 | 12,733,512.00 | 2.62 |
| 52 | 600176 | 中国巨石 | 12,263,574.70 | 2.52 |
| 53 | 002271 | 东方雨虹 | 12,249,551.00 | 2.52 |
| 54 | 300408 | 三环集团 | 12,123,078.44 | 2.49 |
| 55 | 000568 | 泸州老窖 | 12,004,793.40 | 2.47 |
| 56 | 300033 | 同花顺 | 11,964,417.00 | 2.46 |
| 57 | 601688 | 华泰证券 | 11,803,239.50 | 2.43 |
| 58 | 002714 | 牧原股份 | 11,623,552.00 | 2.39 |
| 59 | 002179 | 中航光电 | 11,469,969.00 | 2.36 |
| 60 | 600438 | 通威股份 | 11,335,646.28 | 2.33 |
| 61 | 002049 | 紫光国微 | 11,186,584.00 | 2.30 |
| 62 | 603288 | 海天味业 | 10,956,429.08 | 2.25 |
| 63 | 600104 | 上汽集团 | 10,893,438.89 | 2.24 |
| 64 | 601377 | 兴业证券 | 10,703,717.50 | 2.20 |
| 65 | 600436 | 片仔癀 | 10,566,298.28 | 2.17 |
| 66 | 600000 | 浦发银行 | 10,425,861.00 | 2.15 |
| 67 | 601601 | 中国太保 | 10,351,034.41 | 2.13 |
| 68 | 601390 | 中国中铁 | 10,266,305.00 | 2.11 |
| 69 | 600999 | 招商证券 | 10,218,507.20 | 2.10 |
| 70 | 600741 | 华域汽车 | 9,788,098.00 | 2.01 |
| 71 | 002493 | 荣盛石化 | 9,744,814.42 | 2.01 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 42,345,305.50 | 8.71 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 40,985,537.96 | 8.43 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 39,262,982.87 | 8.08 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 28,889,050.81 | 5.94 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 26,228,741.75 | 5.40 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 26,118,001.81 | 5.37 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 21,814,513.54 | 4.49 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 21,638,708.00 | 4.45 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 21,529,355.12 | 4.43 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 21,101,806.10 | 4.34 |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 20,815,182.69 | 4.28 |
| 12 | 000002 | 万科A | 20,346,438.00 | 4.19 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 20,264,778.00 | 4.17 |
| 14 | 000725 | 京东方A | 20,014,234.00 | 4.12 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 15 | 603501 | 韦尔股份 | 19,634,547.00 | 4.04 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 19,119,265.57 | 3.93 |
| 17 | 600600 | 青岛啤酒 | 18,518,984.75 | 3.81 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 18,075,516.00 | 3.72 |
| 19 | 601012 | 隆基股份 | 17,923,991.00 | 3.69 |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 16,955,448.92 | 3.49 |
| 21 | 601628 | 中国人寿 | 16,914,808.52 | 3.48 |
| 22 | 600690 | 海尔智家 | 16,869,911.71 | 3.47 |
| 23 | 002415 | 海康威视 | 16,869,583.86 | 3.47 |
| 24 | 601888 | 中国中免 | 16,522,530.22 | 3.40 |
| 25 | 600900 | 长江电力 | 16,224,185.87 | 3.34 |
| 26 | 000001 | 平安银行 | 16,100,349.38 | 3.31 |
| 27 | 002304 | 洋河股份 | 15,900,963.00 | 3.27 |
| 28 | 002142 | 宁波银行 | 15,697,919.00 | 3.23 |
| 29 | 002475 | 立讯精密 | 15,682,320.65 | 3.23 |
| 30 | 601328 | 交通银行 | 15,509,999.15 | 3.19 |
| 31 | 601336 | 新华保险 | 15,147,381.53 | 3.12 |
| 32 | 002230 | 科大讯飞 | 14,965,644.98 | 3.08 |
| 33 | 601633 | 长城汽车 | 14,772,128.00 | 3.04 |
| 34 | 600000 | 浦发银行 | 14,676,193.00 | 3.02 |
| 35 | 002027 | 分众传媒 | 14,434,642.10 | 2.97 |
| 36 | 603259 | 药明康德 | 14,413,500.40 | 2.97 |
| 37 | 600585 | 海螺水泥 | 14,381,983.00 | 2.96 |
| 38 | 601939 | 建设银行 | 14,294,409.00 | 2.94 |
| 39 | 600031 | 三一重工 | 14,232,438.00 | 2.93 |
| 40 | 600030 | 中信证券 | 14,032,400.00 | 2.89 |
| 41 | 600438 | 通威股份 | 13,854,224.00 | 2.85 |
| 42 | 002594 | 比亚迪 | 13,822,729.23 | 2.84 |
| 43 | 000100 | TCL 科技 | 13,629,346.00 | 2.80 |
| 44 | 603799 | 华友钴业 | 13,468,548.94 | 2.77 |
| 45 | 000661 | 长春高新 | 13,414,570.00 | 2.76 |
| 46 | 300014 | 亿纬锂能 | 13,402,732.80 | 2.76 |
| 47 | 601688 | 华泰证券 | 12,788,053.99 | 2.63 |
| 48 | 300122 | 智飞生物 | 12,639,345.60 | 2.60 |
| 49 | 601211 | 国泰君安 | 12,463,854.00 | 2.56 |
| 50 | 601818 | 光大银行 | 12,432,931.00 | 2.56 |
| 51 | 600048 | 保利地产 | 12,418,940.77 | 2.56 |
| 52 | 300529 | 健帆生物 | 12,231,392.33 | 2.52 |
| 53 | 000568 | 泸州老窖 | 12,205,523.05 | 2.51 |
| 54 | 600176 | 中国巨石 | 12,034,914.33 | 2.48 |
| 55 | 603288 | 海天味业 | 11,955,481.00 | 2.46 |
| 56 | 300124 | 汇川技术 | 11,895,338.00 | 2.45 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 57 | 600028 | 中国石化 | 11,837,810.00 | 2.44 |
| 58 | 600104 | 上汽集团 | 11,807,202.73 | 2.43 |
| 59 | 601100 | 恒立液压 | 11,739,950.82 | 2.42 |
| 60 | 601601 | 中国太保 | 11,371,916.09 | 2.34 |
| 61 | 300408 | 三环集团 | 11,230,062.12 | 2.31 |
| 62 | 300033 | 同花顺 | 11,076,512.42 | 2.28 |
| 63 | 002714 | 牧原股份 | 10,888,449.20 | 2.24 |
| 64 | 300015 | 爱尔眼科 | 10,855,733.52 | 2.23 |
| 65 | 002241 | 歌尔股份 | 10,841,672.85 | 2.23 |
| 66 | 600999 | 招商证券 | 10,643,765.90 | 2.19 |
| 67 | 601006 | 大秦铁路 | 10,447,192.00 | 2.15 |
| 68 | 601390 | 中国中铁 | 10,418,819.00 | 2.14 |
| 69 | 002179 | 中航光电 | 10,374,050.40 | 2.13 |
| 70 | 002493 | 荣盛石化 | 10,232,419.00 | 2.11 |
| 71 | 002271 | 东方雨虹 | 10,203,983.83 | 2.10 |
| 72 | 600741 | 华域汽车 | 10,032,363.39 | 2.06 |
| 73 | 002049 | 紫光国微 | 10,008,743.48 | 2.06 |
| 74 | 600019 | 宝钢股份 | 9,836,830.34 | 2.02 |
| 75 | 002352 | 顺丰控股 | 9,808,149.00 | 2.02 |

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 | 2,438,191,657.16 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,472,045,590.41 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 152,745,752.10 | 23.40 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 343,000.20 | 0.05 |
| | 其中：政策性金融债 | 343,000.20 | 0.05 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 493,525.67 | 0.08 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 153,582,277.97 | 23.53 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 010303 | 03 国债(3) | 1,106,800 | 112,174,180.00 | 17.18 |
| 2 | 019645 | 20 国债 15 | 259,910 | 26,071,572.10 | 3.99 |
| 3 | 019640 | 20 国债 10 | 145,000 | 14,500,000.00 | 2.22 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 4,590 | 458,996.71 | 0.07 |
| 5 | 018006 | 国开 1702 | 3,390 | 343,000.20 | 0.05 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|-----------------|---------------|----------------|
| IF2107 | IF2107 | -44 | -68,523,840.00 | -546,984.96 | - |
| IF2108 | IF2108 | -141 | -218,987,100.00 | -4,124,520.00 | - |
| IF2109 | IF2109 | -21 | -32,548,320.00 | 107,460.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -4,564,044.96 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -35,606,993.35 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 19,245,693.35 |

注：1、股指期货投资主要是用于套期保值，有利于对冲大盘风险，降低组合亏损；

2、该部分投资符合既定的投资政策以及投资目标。

7.10.2 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。

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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 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。

7.12 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 356,897,744.62 元，占基金资产净值的比例为 54.68%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 320,059,260.00 元，占基金资产净值的比例为 49.03%，空头合约市值占股票资产的比例为 89.68%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 16,504,513.72 元，公允价值变动损益为-3,148,740.01 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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中国平安（股票代码：601318 SH）、平安银行（股票代码：000001 SZ）、宁波银行（股票代码：002142 SZ）、贵州茅台（股票代码：600519 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。

2021 年 2 月 23 日，中国平安保险（集团）股份有限公司因未依法履行职责被广东省通信管理局责令改正。

2021 年 6 月 8 日，平安银行股份有限公司因违规经营被云南银保监局罚款【云银保监罚决字（2021）34 号】。

2021 年 5 月 11 日，平安银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银保监会消费者权益保护局通报批评【银保监消保发（2021）8 号】。

2021 年 5 月 10 日，平安银行股份有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室责令改正。

2020 年 10 月 27 日，平安银行股份有限公司因未依法履行职责被宁波银保监局罚款【甬银保监罚决字（2020）66 号】。

2021 年 6 月 11 日，宁波银行股份有限公司因违规经营被宁波银保监局罚款 25 万元【甬银保监罚决字（2021）36 号】。

2020 年 12 月 31 日，宁波银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会警告、停止接受新业务。

2020 年 10 月 27 日，宁波银行股份有限公司因未依法履行职责被宁波银保监局罚款 30 万元，责令改正【甬银保监罚决字（2020）48 号】。

2020 年 7 月 19 日，贵州茅台酒股份有限公司因违规经营被蕲春县烟草专卖局处罚【蕲烟简处（2020）第 282 号】。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 38,770,449.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,542,055.79 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,544,490.85 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 41,856,996.63 |

7.13.4 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。

7.13.5 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不存在流通受限情况。

7.13.6 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。

§ 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（%） |
| 安信阿尔 | 4,065 | 85,131.51 | 167,445,764.97 | 48.39 | 178,613,831.30 | 51.61 |

| | | | | | | |
|-------------|-------|------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 法定开混合 A | | | | | | |
| 安信阿尔法定开混合 C | 1,736 | 110,908.86 | 119,484,222.37 | 62.06 | 73,053,552.92 | 37.94 |
| 合计 | 5,688 | 94,690.11 | 286,929,987.34 | 53.27 | 251,667,384.22 | 46.73 |

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 | 安信阿尔法定开混合 A | 1,299,150.06 | 0.38 |
| | 安信阿尔法定开混合 C | 120,438.41 | 0.06 |
| | 合计 | 1,419,588.47 | 0.26 |

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 | 安信阿尔法定开混合 A | 10~50 |
| | 安信阿尔法定开混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 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 | 10~50 |
| | 安信阿尔法定开混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 1.86 | 10,000,000.00 | 1.86 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 417,490.99 | 0.08 | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | 36,640,733.39 | 6.80 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|----|---------------|------|---------------|------|---|
| 合计 | 47,058,224.38 | 8.74 | 10,000,000.00 | 1.86 | - |
|----|---------------|------|---------------|------|---|

§ 9 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 | 205,140,936.34 | 202,500,776.33 |
| 本报告期基金总申购份额 | 226,476,919.54 | 59,281,689.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 85,558,259.61 | 69,244,690.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 346,059,596.27 | 192,537,775.29 |

§ 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 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度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五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

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。

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

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

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 | |
| 长江证券 | 2 | 2,540,759,310.17 | 51.87% | 1,807,243.99 | 67.74% | - |
| 安信证券 | 2 | 2,040,006,833.05 | 41.65% | 635,058.88 | 23.80% | - |
| 开源证券 | 2 | 317,106,772.41 | 6.47% | 225,557.37 | 8.45% | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | 新租 |

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

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 |
| 长江证券 | 3,600,979.76 | 1.79% | 3,053,000,000.00 | 40.82% | - | - |
| 安信证券 | 189,368,000.60 | 94.21% | 3,994,500,000.00 | 53.41% | - | - |
| 开源证券 | 8,032,000.00 | 4.00% | 431,000,000.00 | 5.76% | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |

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旗下全部基金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 | 2021-01-22 |
| 2 | 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 | 2021-01-27 |
| 3 | 安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告 | 上海证券报、证券时报 | 2021-01-29 |
| 4 | 关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-02-04 |
| 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 2021 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告 | 上海证券报 | 2021-02-10 |
| 6 | 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申购采取比例确认的提示性公告 | 上海证券报 | 2021-03-06 |
| 7 | 关于安信价值精选股票型证券投资基金等 10 只基金新增华林证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2021-03-10 |
| 8 | 安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购、追加申购起点金额的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2021-03-10 |
| 9 | 关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 16 只基金新增华金证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 | 2021-03-15 |
| 10 | 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告 | 上海证券报 | 2021-03-16 |
| 11 | 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告 | 上海证券报 | 2021-03-17 |
| 12 | 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告 | 上海证券报 | 2021-03-18 |
| 13 | 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告 | 上海证券报 | 2021-03-19 |
| 14 | 2021 年度 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 | 2021-03-19 |
| 15 | 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起 | 上海证券报 | 2021-03-20 |

| | | | |
|----|---|-----------------------|------------|
| | 式证券投资基金申购申请比例确认的公告 | | |
| 16 | 关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-03-23 |
| 17 | 安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-03-29 |
| 18 | 安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-04-21 |
| 19 | 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爱建证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-04-30 |
| 20 | 安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-05-20 |
| 21 | 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取消规模限制的提示性公告 | 上海证券报 | 2021-06-01 |
| 22 | 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 2021 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告 | 上海证券报 | 2021-06-02 |
| 23 | 安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告 | 中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报 | 2021-06-26 |

§ 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

无。

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。

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

2021 年 8 月 27 日