

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	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 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61

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	62
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	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12	市场中性策略执行情况	62
7.13	投资组合报告附注	62
§ 8	基金份额持有人信息	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	65
§ 9	开放式基金份额变动	66
§ 10	重大事件揭示	66
10.1	基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4	基金投资策略的改变	66
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	67
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8	其他重大事件	68
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12	备查文件目录	69
12.1	备查文件目录	69
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	69

§ 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	44,986,653.73 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	27,773,766.54 份	17,212,887.19 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	张姗
	联系电话	0755-82509999	0755-83077987
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@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(2023 年 1 月 1 日-2023 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	101,528.60	-11,678.78
本期利润	572,017.27	164,690.38
加权平均基金份额本期利润	0.0180	0.0134
本期加权平均净值利润率	1.52%	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.54%	1.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,657,294.39	2,520,262.26
期末可供分配基金份额利润	0.1677	0.1464

期末基金资产净值	33,167,244.85	20,193,059.61
期末基金份额净值	1.1942	1.1731
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	19.42%	6.91%

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）扣除相关费用及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
过去一个月	1.07%	0.15%	0.12%	0.00%	0.95%	0.15%
过去三个月	1.13%	0.18%	0.37%	0.00%	0.76%	0.18%
过去六个月	1.54%	0.18%	0.74%	0.01%	0.80%	0.17%
过去一年	-0.44%	0.18%	1.50%	0.00%	-1.94%	0.18%
过去三年	8.41%	0.23%	4.50%	0.00%	3.91%	0.23%
自基金合同生效起至今	19.42%	0.20%	8.35%	0.00%	11.07%	0.20%

安信阿尔法定开混合 C

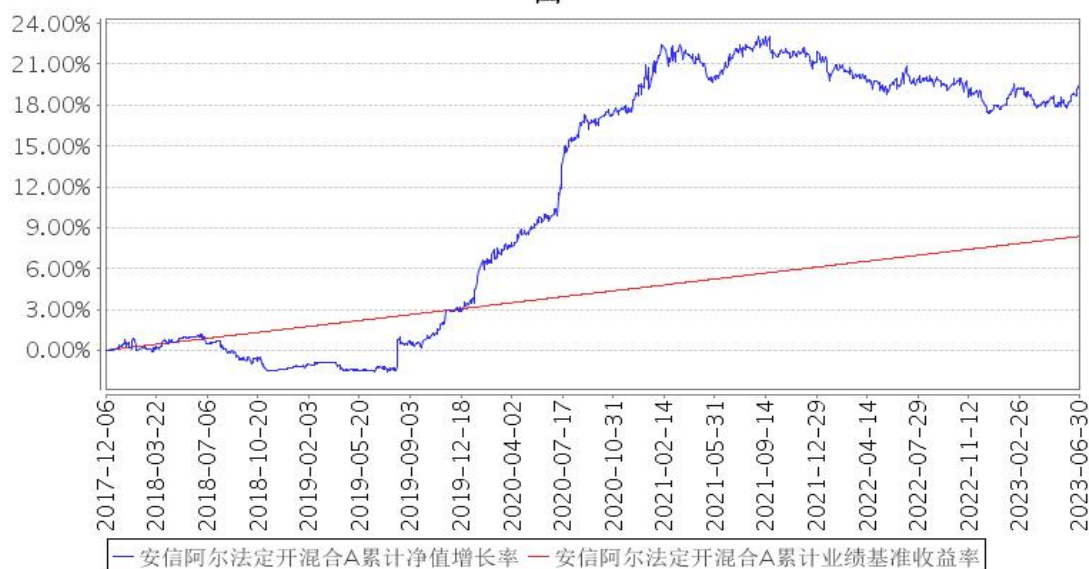
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.02%	0.15%	0.12%	0.00%	0.90%	0.15%
过去三个月	0.97%	0.17%	0.37%	0.00%	0.60%	0.17%
过去六个月	1.23%	0.18%	0.74%	0.01%	0.49%	0.17%
过去一年	-1.05%	0.18%	1.50%	0.00%	-2.55%	0.18%

过去三年	6.51%	0.23%	4.50%	0.00%	2.01%	0.23%
自基金合同生效起至今	6.91%	0.23%	4.57%	0.00%	2.34%	0.23%

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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增

强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐黄玮	本基金的基金经理	2017 年 12 月 29	-	16 年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管

	理，量化 投资部总 经理	日			理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。
--	--------------------	---	--	--	--

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年股票市场先上后下，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，创业板下跌 5.61%，市场风格整体偏向小盘价值。

上半年策略配置方面保持价值成长均衡风格，除了原基本面量化模型外，还配置了基于神经网络的交易模型，基于 Gpt 的文本模型，股票端超额收益为正。

现在这个阶段，对于宽基指数是好的底部建仓区域。一方面估值相对来说比较便宜，从去年到今年调整较充分。另一方面，在今年这样一个行业轮动较快的情况下，量化产品的持有体验会是比较好的，相对来说，它的波动要小于权益的波动。

我们认为没有哪个单一类别的策略，可以穿越所有市场环境和周期。我们希望能让投资组合的收益尽量平滑，能从一个更长的周期实现正收益。均衡配置比精准预测更重要，通过多因子组合的复合策略组合，实现长期正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信阿尔法定开混合 A 基金份额净值为 1.1942 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.54%；安信阿尔法定开混合 C 基金份额净值为 1.1731 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%；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

展望下半年，经济已经出现了企稳迹象，预计稳增长政策仍将持续推出；美联储加息终于接近尾声。

市场对于经济数据有所担忧，但 6 月开始陆续出台了一些稳增长政策，也有助于经济预期企稳。

风格方面，由于经济预期相对稳定，寻找产业趋势明确或者政策支持能够提估值的方向仍然是主要思路。

行业配置层面，综合基本面、事件和政策，从经济的情况来看，围绕业绩边际改善的电子、消费和部分中游行业去优选，相关出行链也可以关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

告。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	608,009.37	1,785,739.28
结算备付金		2,159,595.49	3,247,696.40
存出保证金		4,297,120.13	2,892,365.00
交易性金融资产	6.4.7.2	41,185,070.06	28,822,618.74
其中：股票投资		38,245,813.25	25,986,445.12
基金投资		-	-
债券投资		2,939,256.81	2,836,173.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,468,935.20	14,874,084.01
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	576,040.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		53,718,730.25	52,198,543.96
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		78,111.22	723,227.09
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		43,211.25	44,179.45
应付托管费		10,802.82	11,044.85
应付销售服务费		9,138.29	4,642.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,985.84	35.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	207,176.37	294,190.65
负债合计		358,425.79	1,077,319.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	44,986,653.73	43,591,557.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	8,373,650.73	7,529,666.95
净资产合计		53,360,304.46	51,121,224.01
负债和净资产总计		53,718,730.25	52,198,543.96

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 44,986,653.73 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额 27,773,766.54 份，基金份额净值 1.1942 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额 17,212,887.19 份，基金份额净值 1.1731 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
一、营业总收入		1,161,279.35	-2,358,248.92
1. 利息收入		107,493.46	490,782.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,761.50	209,398.27
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		82,731.96	281,383.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		406,360.14	-800,861.74
其中：股票投资收益	6.4.7.10	191,481.54	-22,728,482.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	108,797.22	182,521.27
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-331,997.69	21,326,175.58
股利收益	6.4.7.15	438,079.07	418,924.20
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	646,857.83	-2,154,251.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	567.92	106,082.66
减：二、营业总支出		424,571.70	1,330,902.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	258,105.80	839,131.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,526.49	209,782.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	42,746.49	113,727.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		34.32	84,555.05
8. 其他费用	6.4.7.19	59,158.60	83,705.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		736,707.65	-3,689,151.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		736,707.65	-3,689,151.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		736,707.65	-3,689,151.18

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	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)	1,395,096.67	-	843,983.78	2,239,080.45
(一)、综合收益总额	-	-	736,707.65	736,707.65
(二)、本期基金份额 交易产生的基金 净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)	1,395,096.67	-	107,276.13	1,502,372.80
其中：1. 基金申购款	11,453,250.97	-	1,932,661.40	13,385,912.37
2. 基金赎回款	-10,058,154.30	-	-1,825,385.27	-11,883,539.57
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	44,986,653.73	-	8,373,650.73	53,360,304.46
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产 (基金净值)	185,379,494.39	-	40,195,917.14	225,575,411.53
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	185,379,494.39	-	40,195,917.14	225,575,411.53
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-118,440,411.39	-	-27,019,084.83	-145,459,496.22
(一)、综合收益总额	-	-	-3,689,151.18	-3,689,151.18
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-118,440,411.39	-	-23,329,933.65	-141,770,345.04
其中: 1. 基金申购款	25,557.78	-	5,100.79	30,658.57
2. 基金赎回款	-118,465,969.17	-	-23,335,034.44	-141,801,003.61
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	66,939,083.00	-	13,176,832.31	80,115,915.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

刘入领

廖维坤

苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

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

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

暂免征收印花税。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

(5) 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	608,009.37
等于：本金	607,828.15
加：应计利息	181.22
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	608,009.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	38,345,165.63	-	38,245,813.25	-99,352.38	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,884,325.35	13,267.69	2,939,256.81	41,663.77
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,884,325.35	13,267.69	2,939,256.81	41,663.77
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	41,229,490.98	13,267.69	41,185,070.06	-57,688.61	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-36,279,420.00	-	-	
其	-36,279,420.00	-	-	

中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-36,279,420.00	-	-	-

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。

6.4.7.3.2 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
IC2307	IC2307	-24.00	-28,755,840.00	508,000.00
IF2307	IF2307	-6.00	-6,894,720.00	120,860.00
合计				628,860.00
减：可抵销期货暂收款				628,860.00
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）之间按抵消后的净额为 0。

（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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,468,935.20	-
银行间市场	-	-
合计	5,468,935.20	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	153,087.80
其中：交易所市场	153,087.80
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	39,671.58
应付审计费	9,916.99
应付银行间账户维护费	4,500.00
合计	207,176.37

6.4.7.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,980,571.51	34,980,571.51
本期申购	325,186.49	325,186.49
本期赎回（以“-”号填列）	-7,531,991.46	-7,531,991.46
本期末	27,773,766.54	27,773,766.54

安信阿尔法定开混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,610,985.55	8,610,985.55
本期申购	11,128,064.48	11,128,064.48
本期赎回（以“-”号填列）	-2,526,162.84	-2,526,162.84
本期末	17,212,887.19	17,212,887.19

注：赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,763,902.28	397,639.64	6,161,541.92
本期利润	101,528.60	470,488.67	572,017.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,208,136.49	-131,944.39	-1,340,080.88
其中：基金申购款	55,061.53	5,613.35	60,674.88
基金赎回款	-1,263,198.02	-137,557.74	-1,400,755.76
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,657,294.39	736,183.92	5,393,478.31
-----	--------------	------------	--------------

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	1,266,321.78	101,803.25	1,368,125.03
本期利润	-11,678.78	176,369.16	164,690.38
本期基金份额交易产生的变动数	1,265,619.26	181,737.75	1,447,357.01
其中：基金申购款	1,644,764.68	227,221.84	1,871,986.52
基金赎回款	-379,145.42	-45,484.09	-424,629.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,520,262.26	459,910.16	2,980,172.42

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	3,750.59
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	20,822.49
其他	188.42
合计	24,761.50

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	177,601,644.62
减：卖出股票成本总额	176,939,338.89
减：交易费用	470,824.19
买卖股票差价收入	191,481.54

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	40,201.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	68,595.28
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	108,797.22
----	------------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,314,003.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,175,096.22
减：应计利息总额	69,440.90
减：交易费用	871.33
买卖债券差价收入	68,595.28

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-331,997.69

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	438,079.07
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	438,079.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	150,519.55
股票投资	65,526.14
债券投资	84,993.41
资产支持证券投资	-
基金投资	-

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	506,270.48
权证投资	-
期货投资	506,270.48
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	9,932.20
合计	646,857.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	567.92
合计	567.92

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	570.03
银行间账户维护费	9,000.00
合计	59,158.60

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
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
安信证券	-	-	147,471,336.32	9.06

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例（%）
安信证券	45,907.23	4.17	39,922.85	17.99

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

算风险基金后的净额列示。

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和 market 信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	258,105.80	839,131.27
其中：支付销售机构的客户维护费	79,319.81	202,730.45

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,526.49	209,782.88

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	6,398.10	6,398.10
安信证券	-	383.00	383.00
合计	-	6,781.10	6,781.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	56,315.83	56,315.83
安信证券	-	391.14	391.14
合计	-	56,706.97	56,706.97

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
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	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	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	-	-	-	-
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	14.94%	-	-	-

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 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)

安信乾盛 财富管理 (深圳)有 限公司	1,694,053.87	3.77	1,694,053.87	3.89
------------------------------	--------------	------	--------------	------

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	608,009.37	3,750.59	1,758,401.19	14,862.62

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023年6月27日	1-6个月（含）	配股未上市	2.02	2.64	1,200	2,424.00	3,168.00	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总	备注
------	----	------	------	------	----	-------	-------	--------	-------	----

	名称			单价	日期	价			额	
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	3,600	26,492.63	25,092.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作

中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、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 5.51%（2022 年 12 月 31 日：2.98%）。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	1,960,844.16	394,888.10
AAA 以下	978,412.65	1,127,142.23
未评级	-	1,314,143.29
合计	2,939,256.81	2,836,173.62

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	608,009.37	-	-	-	608,009.37
结算备付金	2,159,595.49	-	-	-	2,159,595.49

存出保证金	4,297,120.13	-	-	-	4,297,120.13
交易性金融资产	108,830.45	2,582,713.13	247,713.23	38,245,813.25	41,185,070.06
买入返售金融资产	5,468,935.20	-	-	-	5,468,935.20
资产总计	12,642,490.64	2,582,713.13	247,713.23	38,245,813.25	53,718,730.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	43,211.25	43,211.25
应付托管费	-	-	-	10,802.82	10,802.82
应付清算款	-	-	-	78,111.22	78,111.22
应付销售服务费	-	-	-	9,138.29	9,138.29
应交税费	-	-	-	9,985.84	9,985.84
其他负债	-	-	-	207,176.37	207,176.37
负债总计	-	-	-	358,425.79	358,425.79
利率敏感度缺口	12,642,490.64	2,582,713.13	247,713.23	37,887,387.46	53,360,304.46
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,785,739.28	-	-	-	1,785,739.28
结算备付金	3,247,696.40	-	-	-	3,247,696.40
存出保证金	2,892,365.00	-	-	-	2,892,365.00
交易性金融资产	1,314,143.29	1,216,128.05	305,902.28	25,986,445.12	28,822,618.74
买入返售金融资产	14,874,084.01	-	-	-	14,874,084.01
应收清算款	-	-	-	576,040.53	576,040.53
资产总计	24,114,027.98	1,216,128.05	305,902.28	26,562,485.65	52,198,543.96
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,179.45	44,179.45
应付托管费	-	-	-	11,044.85	11,044.85
应付清算款	-	-	-	723,227.09	723,227.09
应付销售服务费	-	-	-	4,642.00	4,642.00
应交税费	-	-	-	35.91	35.91
其他负债	-	-	-	294,190.65	294,190.65
负债总计	-	-	-	1,077,319.95	1,077,319.95
利率敏感度缺口	24,114,027.98	1,216,128.05	305,902.28	25,485,165.70	51,121,224.01

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

分析	1. 市场利率下降 25 个基点	24,274.46	16,504.75
	2. 市场利率上升 25 个基点	-23,999.03	-16,297.40

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	38,245,813.25	71.67	25,986,445.12	50.83
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	38,245,813.25	71.67	25,986,445.12	50.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,575,146.89	1,193,134.23
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,575,146.89	-1,193,134.23

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	41,156,810.06	27,498,474.27
第二层次	28,260.00	1,324,144.47
第三层次	-	-
合计	41,185,070.06	28,822,618.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,245,813.25	71.20
	其中：股票	38,245,813.25	71.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,939,256.81	5.47
	其中：债券	2,939,256.81	5.47
	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	5,468,935.20	10.18
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,767,604.86	5.15
8	其他各项资产	4,297,120.13	8.00
9	合计	53,718,730.25	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	386,634.00	0.72
B	采矿业	1,175,131.00	2.20
C	制造业	23,689,343.52	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,366,830.00	2.56
E	建筑业	541,221.40	1.01
F	批发和零售业	1,179,620.14	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,105,626.00	2.07
H	住宿和餐饮业	136,440.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,962,287.69	5.55
J	金融业	3,883,885.40	7.28
K	房地产业	482,140.00	0.90
L	租赁和商务服务业	230,206.60	0.43
M	科学研究和技术服务业	380,185.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	245,447.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,076.00	0.04
Q	卫生和社会工作	50,356.50	0.09
R	文化、体育和娱乐业	308,950.00	0.58
S	综合	99,433.00	0.19
	合计	38,245,813.25	71.67

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	600546	山煤国际	25,100	363,197.00	0.68
2	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.63
3	000001	平安银行	29,200	327,916.00	0.61
4	601318	中国平安	6,900	320,160.00	0.60
5	688390	固德威	1,821	303,852.06	0.57
6	601958	金钼股份	25,200	280,980.00	0.53
7	000333	美的集团	4,500	265,140.00	0.50
8	688599	天合光能	5,900	251,399.00	0.47
9	002600	领益智造	35,500	245,305.00	0.46
10	002236	大华股份	12,400	244,900.00	0.46
11	601985	中国核电	34,100	240,405.00	0.45
12	688777	中控技术	3,815	239,505.70	0.45

13	600316	洪都航空	10,200	239,190.00	0.45
14	300146	汤臣倍健	9,900	237,402.00	0.44
15	601006	大秦铁路	30,400	225,872.00	0.42
16	601665	齐鲁银行	57,600	225,792.00	0.42
17	002459	晶澳科技	5,400	225,180.00	0.42
18	002304	洋河股份	1,700	223,295.00	0.42
19	603225	新凤鸣	20,000	221,000.00	0.41
20	000630	铜陵有色	76,000	219,640.00	0.41
21	603885	吉祥航空	14,200	219,106.00	0.41
22	002372	伟星新材	10,600	217,724.00	0.41
23	002223	鱼跃医疗	5,900	212,341.00	0.40
24	600038	中直股份	5,200	207,064.00	0.39
25	000063	中兴通讯	4,500	204,930.00	0.38
26	002568	百润股份	5,500	199,925.00	0.37
27	600637	东方明珠	25,300	197,846.00	0.37
28	600566	济川药业	6,800	197,472.00	0.37
29	603688	石英股份	1,700	193,528.00	0.36
30	301029	怡合达	4,260	190,336.80	0.36
31	002273	水晶光电	15,800	188,652.00	0.35
32	603712	七一二	6,200	187,302.00	0.35
33	000750	国海证券	55,300	185,255.00	0.35
34	600166	福田汽车	54,400	184,960.00	0.35
35	002129	TCL 中环	5,550	184,260.00	0.35
36	300026	红日药业	33,800	183,196.00	0.34
37	600998	九州通	17,433	180,954.54	0.34
38	000807	云铝股份	14,200	180,766.00	0.34
39	600909	华安证券	38,700	180,729.00	0.34
40	000998	隆平高科	11,700	179,595.00	0.34
41	600369	西南证券	49,200	179,580.00	0.34
42	600563	法拉电子	1,300	178,490.00	0.33
43	688006	杭可科技	5,817	177,243.99	0.33
44	300308	中际旭创	1,200	176,940.00	0.33
45	601717	郑煤机	14,100	175,545.00	0.33
46	688009	中国通号	30,162	174,939.60	0.33
47	002429	兆驰股份	31,400	172,700.00	0.32
48	000625	长安汽车	13,300	171,969.00	0.32
49	300850	新强联	4,600	171,948.00	0.32
50	600755	厦门国贸	22,100	171,054.00	0.32
51	000623	吉林敖东	10,600	170,024.00	0.32
52	000999	华润三九	2,800	169,848.00	0.32
53	002056	横店东磁	9,300	169,353.00	0.32
54	600968	海油发展	55,100	169,157.00	0.32
55	601668	中国建筑	29,300	168,182.00	0.32

56	600282	南钢股份	49,900	168,163.00	0.32
57	600352	浙江龙盛	17,900	167,365.00	0.31
58	000338	潍柴动力	13,400	166,964.00	0.31
59	000728	国元证券	24,800	161,696.00	0.30
60	601688	华泰证券	11,600	159,732.00	0.30
61	600567	山鹰国际	69,700	159,613.00	0.30
62	000997	新大陆	8,400	158,760.00	0.30
63	600549	厦门钨业	8,300	157,949.00	0.30
64	000538	云南白药	3,000	157,440.00	0.30
65	601139	深圳燃气	21,500	156,735.00	0.29
66	601857	中国石油	20,850	155,749.50	0.29
67	002546	新联电子	25,200	154,980.00	0.29
68	601000	唐山港	43,900	154,967.00	0.29
69	000651	格力电器	4,200	153,342.00	0.29
70	600642	申能股份	21,400	149,586.00	0.28
71	301168	通灵股份	2,400	149,520.00	0.28
72	002025	航天电器	2,300	146,740.00	0.27
73	002673	西部证券	23,100	146,685.00	0.27
74	600167	联美控股	21,000	146,370.00	0.27
75	600026	中远海能	11,500	145,360.00	0.27
76	600528	中铁工业	14,700	145,236.00	0.27
77	002926	华西证券	17,300	143,763.00	0.27
78	603267	鸿远电子	2,200	143,660.00	0.27
79	600663	陆家嘴	14,500	143,115.00	0.27
80	688521	芯原股份	1,983	142,617.36	0.27
81	600372	中航电子	9,200	139,656.00	0.26
82	000778	新兴铸管	34,100	139,128.00	0.26
83	300776	帝尔激光	2,140	138,886.00	0.26
84	601398	工商银行	28,500	137,370.00	0.26
85	601969	海南矿业	20,800	136,864.00	0.26
86	600258	首旅酒店	7,200	136,440.00	0.26
87	688301	奕瑞科技	480	135,566.40	0.25
88	601058	赛轮轮胎	11,900	135,541.00	0.25
89	300357	我武生物	4,000	134,520.00	0.25
90	000988	华工科技	3,500	133,035.00	0.25
91	000858	五粮液	800	130,856.00	0.25
92	300628	亿联网络	3,680	129,057.60	0.24
93	300014	亿纬锂能	2,100	127,050.00	0.24
94	002475	立讯精密	3,900	126,555.00	0.24
95	600399	抚顺特钢	12,400	126,480.00	0.24
96	002439	启明星辰	4,200	124,992.00	0.23
97	000733	振华科技	1,300	124,605.00	0.23
98	000563	陕国投 A	40,600	123,830.00	0.23

99	000898	鞍钢股份	43,800	121,764.00	0.23
100	002244	滨江集团	13,700	120,834.00	0.23
101	688690	纳微科技	3,100	120,435.00	0.23
102	688195	腾景科技	2,197	117,385.71	0.22
103	002281	光迅科技	3,100	114,979.00	0.22
104	002212	天融信	11,800	114,460.00	0.21
105	600728	佳都科技	16,200	112,266.00	0.21
106	688579	山大地纬	6,800	112,064.00	0.21
107	300347	泰格医药	1,700	109,718.00	0.21
108	600918	中泰证券	15,600	107,796.00	0.20
109	601939	建设银行	17,200	107,672.00	0.20
110	600177	雅戈尔	16,900	106,639.00	0.20
111	300677	英科医疗	4,700	103,400.00	0.19
112	300869	康泰医学	4,500	103,320.00	0.19
113	600438	通威股份	3,000	102,930.00	0.19
114	600941	中国移动	1,100	102,630.00	0.19
115	002049	紫光国微	1,100	102,575.00	0.19
116	600089	特变电工	4,600	102,534.00	0.19
117	300676	华大基因	1,700	101,983.00	0.19
118	300861	美畅股份	2,300	99,751.00	0.19
119	000987	越秀资本	15,700	99,695.00	0.19
120	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.19
121	600332	白云山	3,100	98,828.00	0.19
122	601991	大唐发电	29,800	98,638.00	0.18
123	300115	长盈精密	8,100	96,471.00	0.18
124	002326	永太科技	6,300	96,327.00	0.18
125	601600	中国铝业	17,500	96,075.00	0.18
126	688662	富信科技	1,600	95,216.00	0.18
127	603596	伯特利	1,200	95,112.00	0.18
128	300122	智飞生物	2,150	95,030.00	0.18
129	600919	江苏银行	12,800	94,080.00	0.18
130	002384	东山精密	3,600	93,240.00	0.17
131	000155	川能动力	6,400	92,160.00	0.17
132	300750	宁德时代	400	91,516.00	0.17
133	002466	天齐锂业	1,300	90,883.00	0.17
134	600901	江苏金租	21,980	90,777.40	0.17
135	603707	健友股份	6,700	90,450.00	0.17
136	601778	晶科科技	18,300	90,402.00	0.17
137	601998	中信银行	15,100	90,298.00	0.17
138	600329	达仁堂	2,000	89,780.00	0.17
139	688185	康希诺	1,100	89,650.00	0.17
140	002233	塔牌集团	11,600	89,552.00	0.17
141	600803	新奥股份	4,700	89,206.00	0.17

142	300363	博腾股份	3,000	88,770.00	0.17
143	688819	天能股份	2,394	88,194.96	0.17
144	603579	荣泰健康	4,200	87,864.00	0.16
145	603808	歌力思	6,600	86,658.00	0.16
146	600845	宝信软件	1,700	86,377.00	0.16
147	600704	物产中大	17,100	84,474.00	0.16
148	000408	藏格矿业	3,700	83,509.00	0.16
149	688281	华秦科技	400	81,000.00	0.15
150	300474	景嘉微	900	80,991.00	0.15
151	688109	品茗科技	3,070	79,513.00	0.15
152	002500	山西证券	14,200	79,236.00	0.15
153	600648	外高桥	7,000	79,170.00	0.15
154	600848	上海临港	6,600	78,870.00	0.15
155	600216	浙江医药	7,200	78,840.00	0.15
156	600959	江苏有线	23,300	78,754.00	0.15
157	601577	长沙银行	10,100	78,376.00	0.15
158	603517	绝味食品	2,100	78,015.00	0.15
159	002901	大博医疗	2,500	77,700.00	0.15
160	603026	胜华新材	1,300	77,025.00	0.14
161	600170	上海建工	28,500	76,665.00	0.14
162	002745	木林森	8,200	75,440.00	0.14
163	688385	复旦微电	1,500	75,150.00	0.14
164	002756	永兴材料	1,200	75,132.00	0.14
165	688282	理工导航	1,300	74,815.00	0.14
166	600809	山西汾酒	400	74,028.00	0.14
167	603369	今世缘	1,400	73,920.00	0.14
168	002966	苏州银行	11,200	73,360.00	0.14
169	000887	中鼎股份	5,600	73,304.00	0.14
170	002624	完美世界	4,300	72,627.00	0.14
171	002434	万里扬	8,100	72,495.00	0.14
172	002138	顺络电子	3,000	71,730.00	0.13
173	002252	上海莱士	9,500	71,345.00	0.13
174	300618	寒锐钴业	2,200	71,302.00	0.13
175	600837	海通证券	7,700	70,994.00	0.13
176	300316	晶盛机电	1,000	70,900.00	0.13
177	601898	中煤能源	8,400	70,896.00	0.13
178	600885	宏发股份	2,200	70,070.00	0.13
179	000423	东阿阿胶	1,300	69,485.00	0.13
180	000960	锡业股份	4,400	68,420.00	0.13
181	601666	平煤股份	8,900	67,106.00	0.13
182	002249	大洋电机	11,700	66,690.00	0.12
183	002124	天邦食品	14,600	66,284.00	0.12
184	600926	杭州银行	5,600	65,800.00	0.12

185	002497	雅化集团	3,700	65,786.00	0.12
185	002867	周大生	3,700	65,786.00	0.12
186	603786	科博达	1,000	65,700.00	0.12
187	600039	四川路桥	6,660	65,334.60	0.12
188	301117	佳缘科技	1,000	64,620.00	0.12
189	600131	国网信通	3,200	64,608.00	0.12
190	002777	久远银海	1,800	63,846.00	0.12
191	601098	中南传媒	5,500	63,800.00	0.12
192	002179	中航光电	1,400	63,490.00	0.12
193	300682	朗新科技	2,700	62,856.00	0.12
194	002422	科伦药业	2,100	62,328.00	0.12
195	300568	星源材质	3,600	61,884.00	0.12
196	603233	大参林	2,200	61,622.00	0.12
197	000786	北新建材	2,500	61,275.00	0.11
198	000895	双汇发展	2,500	61,225.00	0.11
199	601288	农业银行	17,100	60,363.00	0.11
200	601333	广深铁路	15,000	59,400.00	0.11
201	300832	新产业	1,000	59,000.00	0.11
202	688295	中复神鹰	1,600	58,688.00	0.11
203	600350	山东高速	9,100	57,967.00	0.11
204	300529	健帆生物	2,500	57,950.00	0.11
205	688029	南微医学	700	57,092.00	0.11
206	002007	华兰生物	2,500	56,025.00	0.10
207	300073	当升科技	1,100	55,363.00	0.10
208	688569	铁科轨道	1,300	54,691.00	0.10
209	000009	中国宝安	4,500	54,315.00	0.10
210	600841	动力新科	8,900	54,290.00	0.10
211	000581	威孚高科	3,400	53,550.00	0.10
212	002093	国脉科技	6,300	53,172.00	0.10
213	600066	宇通客车	3,600	53,064.00	0.10
214	002608	江苏国信	7,000	52,990.00	0.10
215	000050	深天马 A	5,700	52,326.00	0.10
216	002468	申通快递	4,800	51,936.00	0.10
217	600600	青岛啤酒	500	51,815.00	0.10
218	601869	长飞光纤	1,400	51,814.00	0.10
219	000921	海信家电	1,900	51,205.00	0.10
220	603338	浙江鼎力	900	50,409.00	0.09
221	002511	中顺洁柔	4,500	50,175.00	0.09
222	600582	天地科技	8,600	50,138.00	0.09
223	600859	王府井	2,500	49,475.00	0.09
224	000883	湖北能源	10,800	49,248.00	0.09
225	688772	珠海冠宇	2,444	49,246.60	0.09
226	002595	豪迈科技	1,400	49,182.00	0.09

227	002373	千方科技	3,600	49,104.00	0.09
228	601211	国泰君安	3,500	48,965.00	0.09
229	002465	海格通信	4,700	48,598.00	0.09
230	601877	正泰电器	1,700	47,005.00	0.09
231	002865	钧达股份	300	45,759.00	0.09
232	002557	洽洽食品	1,100	45,705.00	0.09
233	002385	大北农	6,900	45,540.00	0.09
234	002508	老板电器	1,800	45,522.00	0.09
235	300908	仲景食品	1,000	45,350.00	0.08
236	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.08
237	002033	丽江股份	4,100	44,608.00	0.08
238	603083	剑桥科技	700	44,023.00	0.08
239	603218	日月股份	2,300	43,677.00	0.08
240	000166	申万宏源	9,200	42,504.00	0.08
241	002065	东华软件	6,000	42,360.00	0.08
242	300136	信维通信	2,100	42,168.00	0.08
243	600060	海信视像	1,700	42,075.00	0.08
244	000937	冀中能源	6,500	41,470.00	0.08
245	603136	天目湖	1,600	41,280.00	0.08
246	300012	华测检测	2,100	40,950.00	0.08
247	600498	烽火通信	2,000	40,740.00	0.08
248	300693	盛弘股份	1,100	40,612.00	0.08
249	688099	晶晨股份	479	40,389.28	0.08
250	000785	居然之家	10,600	40,386.00	0.08
251	300999	金龙鱼	1,000	39,990.00	0.07
252	300972	万辰生物	900	39,906.00	0.07
253	601108	财通证券	5,500	39,820.00	0.07
254	002850	科达利	300	39,675.00	0.07
255	002506	协鑫集成	13,500	39,555.00	0.07
256	000400	许继电气	1,700	39,185.00	0.07
257	002852	道道全	3,000	38,790.00	0.07
258	300496	中科创达	400	38,540.00	0.07
259	002772	众兴菌业	3,400	38,420.00	0.07
260	002266	浙富控股	9,300	38,409.00	0.07
261	000559	万向钱潮	7,000	38,150.00	0.07
262	300182	捷成股份	6,000	37,860.00	0.07
263	601138	工业富联	1,500	37,800.00	0.07
264	301256	华融化学	4,200	37,212.00	0.07
265	002858	力盛体育	1,600	36,704.00	0.07
266	002489	浙江永强	9,000	36,450.00	0.07
267	603893	瑞芯微	500	36,425.00	0.07
268	002170	芭田股份	5,300	36,411.00	0.07
269	000060	中金岭南	7,600	36,100.00	0.07

270	600373	中文传媒	2,700	35,964.00	0.07
271	000066	中国长城	2,600	35,958.00	0.07
272	002458	益生股份	2,900	35,815.00	0.07
272	002674	兴业科技	2,900	35,815.00	0.07
273	002286	保龄宝	3,800	35,682.00	0.07
274	600271	航天信息	2,600	35,594.00	0.07
275	603355	莱克电气	1,400	35,574.00	0.07
276	301187	欧圣电气	1,900	35,093.00	0.07
277	002418	康盛股份	11,200	35,056.00	0.07
278	605259	绿田机械	900	34,938.00	0.07
279	000027	深圳能源	5,300	34,927.00	0.07
280	600603	广汇物流	5,000	34,800.00	0.07
281	301158	德石股份	2,000	34,620.00	0.06
282	603032	德新科技	1,000	34,540.00	0.06
283	688257	新锐股份	1,300	34,463.00	0.06
284	688611	杭州柯林	800	34,280.00	0.06
285	300378	鼎捷软件	1,000	34,250.00	0.06
286	002783	凯龙股份	4,100	34,194.00	0.06
287	600027	华电国际	5,100	34,119.00	0.06
288	605208	永茂泰	3,400	34,068.00	0.06
289	300751	迈为股份	200	33,876.00	0.06
290	300515	三德科技	2,100	33,852.00	0.06
291	605058	澳弘电子	1,500	33,675.00	0.06
292	000729	燕京啤酒	2,700	33,669.00	0.06
293	600827	百联股份	2,500	33,425.00	0.06
294	300017	网宿科技	4,700	33,417.00	0.06
295	000153	丰原药业	3,300	33,330.00	0.06
296	300383	光环新网	3,100	33,325.00	0.06
297	688210	统联精密	1,700	33,184.00	0.06
298	300800	力合科技	2,400	33,144.00	0.06
299	002131	利欧股份	14,400	33,120.00	0.06
299	603776	永安行	2,300	33,120.00	0.06
299	688399	硕世生物	600	33,120.00	0.06
300	603856	东宏股份	2,500	32,975.00	0.06
301	002879	长缆科技	2,000	32,940.00	0.06
302	301205	联特科技	180	32,898.60	0.06
303	688551	科威尔	500	32,790.00	0.06
304	300822	贝仕达克	2,400	32,736.00	0.06
305	002027	分众传媒	4,800	32,688.00	0.06
306	605336	帅丰电器	1,900	32,680.00	0.06
307	605378	野马电池	1,400	32,634.00	0.06
308	300695	兆丰股份	700	32,606.00	0.06
309	600298	安琪酵母	900	32,589.00	0.06

310	600048	保利发展	2,500	32,575.00	0.06
311	002153	石基信息	2,320	32,480.00	0.06
312	002825	纳尔股份	2,600	32,422.00	0.06
313	603836	海程邦达	2,100	32,277.00	0.06
314	003011	海象新材	1,000	32,250.00	0.06
315	603558	健盛集团	3,900	32,214.00	0.06
316	000407	胜利股份	8,800	32,120.00	0.06
317	300483	首华燃气	2,600	32,110.00	0.06
317	601611	中国核建	3,800	32,110.00	0.06
318	605500	森林包装	4,300	32,078.00	0.06
319	600315	上海家化	1,100	31,911.00	0.06
320	300839	博汇股份	2,400	31,896.00	0.06
321	300878	维康药业	1,400	31,780.00	0.06
322	600318	新力金融	5,000	31,700.00	0.06
323	603797	联泰环保	5,700	31,692.00	0.06
324	600572	康恩贝	4,600	31,510.00	0.06
325	300692	中环环保	4,300	31,433.00	0.06
326	603176	汇通集团	4,900	31,360.00	0.06
327	002739	万达电影	2,500	31,350.00	0.06
328	603216	梦天家居	2,300	31,349.00	0.06
329	688767	博拓生物	1,100	31,306.00	0.06
330	300763	锦浪科技	300	31,230.00	0.06
331	601601	中国太保	1,200	31,176.00	0.06
332	600113	浙江东日	4,300	31,175.00	0.06
333	603967	中创物流	3,400	31,076.00	0.06
334	688633	星球石墨	700	31,073.00	0.06
335	002925	盈趣科技	1,600	31,040.00	0.06
336	300699	光威复材	1,000	30,850.00	0.06
337	600727	鲁北化工	5,400	30,780.00	0.06
338	000869	张裕 A	1,000	30,660.00	0.06
339	603019	中科曙光	600	30,540.00	0.06
340	600028	中国石化	4,800	30,528.00	0.06
341	688499	利元亨	480	30,489.60	0.06
342	300638	广和通	1,340	30,391.20	0.06
343	600362	江西铜业	1,600	30,368.00	0.06
344	600906	财达证券	4,200	30,240.00	0.06
345	600557	康缘药业	1,100	30,206.00	0.06
346	002032	苏泊尔	600	30,000.00	0.06
347	601728	中国电信	5,300	29,839.00	0.06
348	000829	天音控股	3,300	29,832.00	0.06
349	300773	拉卡拉	1,700	29,648.00	0.06
350	603000	人民网	1,000	29,200.00	0.05
351	603898	好莱客	3,000	29,160.00	0.05

352	000629	钒钛股份	7,400	28,934.00	0.05
353	300604	长川科技	600	28,494.00	0.05
354	600801	华新水泥	2,300	28,405.00	0.05
355	002690	美亚光电	1,100	28,325.00	0.05
356	603699	纽威股份	1,900	28,272.00	0.05
357	000682	东方电子	2,900	28,188.00	0.05
358	002334	英威腾	2,200	28,028.00	0.05
359	002701	奥瑞金	6,200	27,962.00	0.05
360	688696	极米科技	200	27,878.00	0.05
361	002191	劲嘉股份	4,600	27,692.00	0.05
362	600325	华发股份	2,800	27,580.00	0.05
363	603737	三棵树	420	27,476.40	0.05
364	600529	山东药玻	1,000	27,220.00	0.05
365	600161	天坛生物	1,000	27,150.00	0.05
366	002737	葵花药业	1,100	26,774.00	0.05
367	002841	视源股份	400	26,736.00	0.05
368	601233	桐昆股份	2,000	26,500.00	0.05
369	600378	昊华科技	700	26,348.00	0.05
370	002456	欧菲光	4,700	26,320.00	0.05
371	300866	安克创新	300	26,250.00	0.05
372	000932	华菱钢铁	5,500	26,235.00	0.05
373	688596	正帆科技	600	25,980.00	0.05
374	002797	第一创业	4,500	25,740.00	0.05
375	600808	马钢股份	10,000	25,700.00	0.05
376	601319	中国人保	4,400	25,696.00	0.05
377	002851	麦格米特	700	25,529.00	0.05
378	605266	健之佳	300	25,149.00	0.05
379	601298	青岛港	3,600	25,092.00	0.05
380	000739	普洛药业	1,400	24,836.00	0.05
381	002080	中材科技	1,200	24,624.00	0.05
382	002050	三花智控	800	24,208.00	0.05
383	001872	招商港口	1,400	24,178.00	0.05
384	000531	穗恒运 A	3,300	23,859.00	0.04
385	000031	大悦城	6,500	23,790.00	0.04
386	688289	圣湘生物	1,400	23,576.00	0.04
387	600690	海尔智家	1,000	23,480.00	0.04
388	300624	万兴科技	200	23,430.00	0.04
388	600509	天富能源	3,000	23,430.00	0.04
389	601156	东航物流	1,800	23,400.00	0.04
390	601168	西部矿业	2,200	23,122.00	0.04
391	601658	邮储银行	4,700	22,983.00	0.04
392	601012	隆基绿能	800	22,936.00	0.04
393	688116	天奈科技	500	22,875.00	0.04

394	002560	通达股份	2,400	22,848.00	0.04
395	688220	翱捷科技	300	22,617.00	0.04
396	002396	星网锐捷	1,000	22,590.00	0.04
397	600348	华阳股份	2,850	22,543.50	0.04
398	002948	青岛银行	7,200	22,536.00	0.04
399	600299	安迪苏	2,800	22,316.00	0.04
400	002195	二三四五	7,700	22,253.00	0.04
401	603283	赛腾股份	500	22,250.00	0.04
402	603383	顶点软件	400	22,168.00	0.04
403	601328	交通银行	3,800	22,040.00	0.04
404	603456	九洲药业	800	21,904.00	0.04
405	688409	富创精密	200	21,800.00	0.04
406	601636	旗滨集团	2,500	21,550.00	0.04
407	601088	中国神华	700	21,525.00	0.04
408	600556	天下秀	3,000	21,270.00	0.04
409	300257	开山股份	1,400	21,238.00	0.04
410	688208	道通科技	700	21,217.00	0.04
411	301039	中集车辆	1,600	21,168.00	0.04
412	002057	中钢天源	2,000	21,000.00	0.04
413	002250	联化科技	2,000	20,920.00	0.04
414	603757	大元泵业	700	20,888.00	0.04
415	600863	内蒙华电	5,000	20,750.00	0.04
416	002155	湖南黄金	1,700	20,740.00	0.04
417	000967	盈峰环境	4,100	20,705.00	0.04
418	002368	太极股份	500	20,585.00	0.04
419	600487	亨通光电	1,400	20,524.00	0.04
420	601928	凤凰传媒	1,800	20,520.00	0.04
421	000725	京东方 A	5,000	20,450.00	0.04
422	601988	中国银行	5,200	20,332.00	0.04
423	300767	震安科技	800	20,288.00	0.04
424	300900	广联航空	700	20,167.00	0.04
425	600141	兴发集团	900	19,998.00	0.04
426	600050	中国联通	4,100	19,680.00	0.04
427	600153	建发股份	1,800	19,638.00	0.04
428	002536	飞龙股份	1,300	19,500.00	0.04
429	600763	通策医疗	200	19,372.00	0.04
430	688711	宏微科技	330	19,252.20	0.04
431	002572	索菲亚	1,100	19,162.00	0.04
432	688389	普门科技	800	18,792.00	0.04
433	002532	天山铝业	3,100	18,569.00	0.03
434	002262	恩华药业	600	18,498.00	0.03
435	300634	彩讯股份	700	18,480.00	0.03
436	603662	柯力传感	500	18,400.00	0.03

437	002002	鸿达兴业	8,200	18,368.00	0.03
438	688088	虹软科技	429	18,339.75	0.03
439	601866	中远海发	7,400	18,278.00	0.03
440	601126	四方股份	1,200	18,228.00	0.03
441	600853	龙建股份	4,300	18,189.00	0.03
442	600008	首创环保	6,300	18,144.00	0.03
443	603605	珀莱雅	160	17,984.00	0.03
444	603899	晨光股份	400	17,856.00	0.03
445	300957	贝泰妮	200	17,776.00	0.03
446	688621	阳光诺和	300	17,646.00	0.03
447	002987	京北方	800	17,536.00	0.03
448	601628	中国人寿	500	17,480.00	0.03
449	002555	三七互娱	500	17,440.00	0.03
450	600062	华润双鹤	1,000	17,420.00	0.03
451	605499	东鹏饮料	100	17,290.00	0.03
452	001227	兰州银行	6,000	17,160.00	0.03
453	601838	成都银行	1,400	17,094.00	0.03
454	603489	八方股份	240	16,828.80	0.03
455	688630	芯碁微装	200	16,804.00	0.03
456	000552	甘肃能化	5,000	16,650.00	0.03
457	300058	蓝色光标	1,700	16,439.00	0.03
458	603129	春风动力	100	16,190.00	0.03
459	688568	中科星图	200	16,116.00	0.03
460	600285	羚锐制药	1,000	16,060.00	0.03
461	300705	九典制药	600	15,858.00	0.03
462	688480	赛恩斯	500	15,480.00	0.03
463	688097	博众精工	500	15,180.00	0.03
464	601077	渝农商行	4,200	15,078.00	0.03
465	301153	中科江南	200	14,992.00	0.03
466	601231	环旭电子	1,000	14,960.00	0.03
467	601117	中国化学	1,800	14,904.00	0.03
468	603589	口子窖	300	14,805.00	0.03
469	603345	安井食品	100	14,680.00	0.03
470	300015	爱尔眼科	790	14,654.50	0.03
471	002472	双环传动	400	14,520.00	0.03
472	002351	漫步者	700	14,476.00	0.03
473	601169	北京银行	3,100	14,353.00	0.03
474	001979	招商蛇口	1,100	14,333.00	0.03
475	002507	涪陵榨菜	780	14,281.80	0.03
476	688076	诺泰生物	400	14,232.00	0.03
477	002832	比音勒芬	400	14,164.00	0.03
478	603298	杭叉集团	600	14,130.00	0.03
479	688036	传音控股	96	14,112.00	0.03

480	600015	华夏银行	2,600	14,066.00	0.03
481	300853	申昊科技	400	14,040.00	0.03
482	600933	爱柯迪	600	13,974.00	0.03
483	688123	聚辰股份	260	13,967.20	0.03
484	601828	美凯龙	2,900	13,891.00	0.03
485	688192	迪哲医药	400	13,880.00	0.03
486	603676	卫信康	1,000	13,820.00	0.03
487	002430	杭氧股份	400	13,744.00	0.03
488	601916	浙商银行	5,200	13,728.00	0.03
489	300926	博俊科技	600	13,704.00	0.03
490	688041	海光信息	200	13,654.00	0.03
491	301031	中熔电气	100	13,571.00	0.03
492	603599	广信股份	500	13,540.00	0.03
493	300415	伊之密	700	13,440.00	0.03
494	002299	圣农发展	700	13,405.00	0.03
495	300700	岱勒新材	700	13,335.00	0.02
496	003031	中瓷电子	100	13,312.00	0.02
497	600570	恒生电子	300	13,287.00	0.02
498	002401	中远海科	500	13,160.00	0.02
499	000801	四川九洲	1,800	13,140.00	0.02
500	688639	华恒生物	145	13,119.60	0.02
501	603901	永创智能	900	13,104.00	0.02
502	002975	博杰股份	300	13,092.00	0.02
503	601699	潞安环能	800	13,056.00	0.02
504	605300	佳禾食品	600	13,044.00	0.02
505	002929	润建股份	300	13,023.00	0.02
506	300229	拓尔思	500	12,985.00	0.02
507	601155	新城控股	900	12,969.00	0.02
508	603912	佳力图	1,260	12,852.00	0.02
509	002454	松芝股份	1,500	12,705.00	0.02
510	002338	奥普光电	300	12,645.00	0.02
511	002284	亚太股份	1,400	12,558.00	0.02
512	603518	锦泓集团	1,100	12,485.00	0.02
513	605168	三人行	145	12,461.30	0.02
514	002011	盾安环境	900	12,447.00	0.02
515	002061	浙江交科	2,780	12,398.80	0.02
516	600312	平高电气	1,000	12,390.00	0.02
517	300928	华安鑫创	300	12,372.00	0.02
518	603156	养元饮品	500	12,350.00	0.02
519	300532	今天国际	600	12,336.00	0.02
519	603056	德邦股份	800	12,336.00	0.02
520	301116	益客食品	800	12,320.00	0.02
521	000555	神州信息	1,000	12,300.00	0.02

521	603098	森特股份	600	12,300.00	0.02
522	603657	春光科技	700	12,285.00	0.02
523	301269	华大九天	100	12,284.00	0.02
524	300978	东箭科技	900	12,267.00	0.02
525	000962	东方钽业	1,000	12,250.00	0.02
526	603096	新经典	600	12,216.00	0.02
527	000425	徐工机械	1,800	12,186.00	0.02
528	603515	欧普照明	600	12,180.00	0.02
529	002003	伟星股份	1,300	12,168.00	0.02
530	002376	新北洋	1,500	12,105.00	0.02
531	003006	百亚股份	700	12,096.00	0.02
532	002270	华明装备	1,100	12,045.00	0.02
533	688103	国力股份	200	11,982.00	0.02
534	603093	南华期货	1,100	11,979.00	0.02
535	000403	派林生物	600	11,976.00	0.02
536	603883	老百姓	400	11,940.00	0.02
537	002051	中工国际	1,000	11,930.00	0.02
538	601618	中国中冶	3,000	11,910.00	0.02
539	600129	太极集团	200	11,898.00	0.02
540	605098	行动教育	300	11,877.00	0.02
541	603619	中曼石油	700	11,844.00	0.02
542	300041	回天新材	1,000	11,800.00	0.02
543	300005	探路者	1,400	11,760.00	0.02
544	000800	一汽解放	1,400	11,718.00	0.02
545	301004	嘉益股份	300	11,640.00	0.02
546	603551	奥普家居	900	11,637.00	0.02
547	605167	利柏特	1,200	11,616.00	0.02
548	002973	侨银股份	1,000	11,600.00	0.02
548	600861	北京人力	500	11,600.00	0.02
549	601128	常熟银行	1,700	11,594.00	0.02
550	000928	中钢国际	1,200	11,580.00	0.02
551	688501	青达环保	520	11,570.00	0.02
552	688248	南网科技	300	11,517.00	0.02
553	600085	同仁堂	200	11,512.00	0.02
554	601021	春秋航空	200	11,494.00	0.02
555	000893	亚钾国际	500	11,470.00	0.02
556	300575	中旗股份	1,100	11,418.00	0.02
557	300087	荃银高科	1,100	11,374.00	0.02
558	000028	国药一致	260	11,338.60	0.02
559	300251	光线传媒	1,400	11,326.00	0.02
560	600109	国金证券	1,300	11,271.00	0.02
561	600072	中船科技	400	11,268.00	0.02
562	600488	津药药业	2,000	11,240.00	0.02

563	301322	绿通科技	200	11,230.00	0.02
564	300738	奥飞数据	1,100	11,220.00	0.02
565	601607	上海医药	500	11,205.00	0.02
566	688308	欧科亿	280	11,200.00	0.02
567	601528	瑞丰银行	2,300	11,155.00	0.02
568	000089	深圳机场	1,600	11,120.00	0.02
569	600007	中国国贸	600	11,112.00	0.02
570	300349	金卡智能	800	11,104.00	0.02
571	601888	中国中免	100	11,053.00	0.02
572	000878	云南铜业	1,000	11,050.00	0.02
572	601766	中国中车	1,700	11,050.00	0.02
573	002990	盛视科技	300	11,040.00	0.02
574	000811	冰轮环境	700	11,032.00	0.02
575	301011	华立科技	470	11,012.10	0.02
576	603871	嘉友国际	700	10,997.00	0.02
577	605060	联德股份	400	10,984.00	0.02
578	300825	阿尔特	600	10,974.00	0.02
579	688513	苑东生物	200	10,972.00	0.02
580	300833	浩洋股份	100	10,943.00	0.02
581	300570	太辰光	200	10,942.00	0.02
582	000913	钱江摩托	600	10,938.00	0.02
583	601003	柳钢股份	2,700	10,908.00	0.02
584	600449	宁夏建材	700	10,892.00	0.02
585	300592	华凯易佰	400	10,888.00	0.02
586	688588	凌志软件	700	10,885.00	0.02
587	600016	民生银行	2,900	10,875.00	0.02
588	300845	捷安高科	500	10,865.00	0.02
589	002275	桂林三金	600	10,806.00	0.02
590	300284	苏交科	1,800	10,800.00	0.02
591	688793	倍轻松	200	10,780.00	0.02
592	002558	巨人网络	600	10,758.00	0.02
593	300360	炬华科技	600	10,728.00	0.02
594	300364	中文在线	600	10,692.00	0.02
595	002036	联创电子	1,100	10,681.00	0.02
596	600718	东软集团	1,000	10,660.00	0.02
597	300779	惠城环保	200	10,658.00	0.02
598	002878	元隆雅图	600	10,644.00	0.02
599	603118	共进股份	800	10,632.00	0.02
600	688556	高测股份	200	10,628.00	0.02
601	603027	千禾味业	500	10,560.00	0.02
602	300206	理邦仪器	700	10,556.00	0.02
602	688112	鼎阳科技	200	10,556.00	0.02
603	603611	诺力股份	400	10,536.00	0.02

604	605598	上海港湾	200	10,532.00	0.02
605	601816	京沪高铁	2,000	10,520.00	0.02
606	603018	华设集团	1,200	10,500.00	0.02
606	688410	山外山	200	10,500.00	0.02
607	002609	捷顺科技	900	10,494.00	0.02
608	300785	值得买	400	10,472.00	0.02
609	603811	诚意药业	840	10,441.20	0.02
610	603222	济民医疗	1,000	10,430.00	0.02
611	600273	嘉化能源	1,100	10,362.00	0.02
611	688561	奇安信	200	10,362.00	0.02
612	002258	利尔化学	800	10,328.00	0.02
613	600212	绿能慧充	1,100	10,318.00	0.02
614	300413	芒果超媒	300	10,263.00	0.02
615	600054	黄山旅游	800	10,240.00	0.02
616	688213	思特威	200	10,228.00	0.02
617	688358	祥生医疗	200	10,200.00	0.02
618	003032	传智教育	700	10,199.00	0.02
619	300166	东方国信	900	10,116.00	0.02
620	688425	铁建重工	2,100	10,101.00	0.02
621	688365	光云科技	700	10,094.00	0.02
622	603998	方盛制药	800	10,088.00	0.02
623	301339	通行宝	400	10,052.00	0.02
624	300587	天铁股份	1,300	10,010.00	0.02
625	600138	中青旅	800	10,008.00	0.02
626	300145	中金环境	3,400	9,996.00	0.02
627	002530	金财互联	1,100	9,966.00	0.02
628	300788	中信出版	300	9,963.00	0.02
629	300144	宋城演艺	800	9,920.00	0.02
630	605016	百龙创园	400	9,904.00	0.02
631	605186	健麾信息	200	9,900.00	0.02
632	300881	盛德鑫泰	300	9,885.00	0.02
633	000032	深桑达 A	300	9,870.00	0.02
634	301052	果麦文化	200	9,864.00	0.02
635	301087	可孚医疗	200	9,860.00	0.02
636	688488	艾迪药业	800	9,856.00	0.02
637	300002	神州泰岳	700	9,800.00	0.02
638	002410	广联达	300	9,747.00	0.02
639	300226	上海钢联	300	9,720.00	0.02
640	603983	丸美股份	300	9,705.00	0.02
641	603529	爱玛科技	300	9,666.00	0.02
642	002045	国光电器	600	9,636.00	0.02
643	002078	太阳纸业	900	9,621.00	0.02
644	603307	扬州金泉	200	9,568.00	0.02

645	688033	天宜上佳	500	9,560.00	0.02
646	600416	湘电股份	500	9,545.00	0.02
647	688609	九联科技	800	9,520.00	0.02
648	603208	江山欧派	260	9,469.20	0.02
649	600609	金杯汽车	1,800	9,468.00	0.02
650	300777	中简科技	200	9,452.00	0.02
651	300622	博士眼镜	400	9,440.00	0.02
652	002984	森麒麟	300	9,438.00	0.02
653	603279	景津装备	300	9,408.00	0.02
654	601166	兴业银行	600	9,390.00	0.02
655	688266	泽璟制药	200	9,310.00	0.02
656	300470	中密控股	200	9,244.00	0.02
657	002185	华天科技	1,000	9,200.00	0.02
658	002728	特一药业	600	9,150.00	0.02
659	300842	帝科股份	100	9,144.00	0.02
660	601899	紫金矿业	800	9,096.00	0.02
661	301051	信濠光电	150	9,073.50	0.02
662	603993	洛阳钼业	1,700	9,061.00	0.02
663	001914	招商积余	600	9,030.00	0.02
664	600502	安徽建工	1,700	8,976.00	0.02
665	688028	沃尔德	400	8,960.00	0.02
666	002997	瑞鹄模具	300	8,919.00	0.02
667	000401	冀东水泥	1,200	8,844.00	0.02
668	601009	南京银行	1,100	8,800.00	0.02
669	002917	金奥博	700	8,652.00	0.02
670	300491	通合科技	300	8,610.00	0.02
671	300133	华策影视	1,200	8,508.00	0.02
672	002847	盐津铺子	100	8,505.00	0.02
673	300507	苏奥传感	1,300	8,476.00	0.02
674	603319	湘油泵	500	8,465.00	0.02
675	301296	新巨丰	500	8,440.00	0.02
676	600537	亿晶光电	1,100	8,404.00	0.02
677	301103	何氏眼科	200	8,392.00	0.02
678	002976	瑞玛精密	300	8,391.00	0.02
679	002623	亚玛顿	300	8,382.00	0.02
680	688246	嘉和美康	200	8,374.00	0.02
681	002959	小熊电器	100	8,350.00	0.02
682	688322	奥比中光	200	8,344.00	0.02
683	300795	米奥会展	200	8,342.00	0.02
684	300554	三超新材	400	8,332.00	0.02
685	601808	中海油服	600	8,328.00	0.02
686	600756	浪潮软件	500	8,310.00	0.02
687	002986	宇新股份	300	8,274.00	0.02

688	605333	沪光股份	500	8,270.00	0.02
689	603711	香飘飘	400	8,212.00	0.02
690	601702	华峰铝业	600	8,208.00	0.02
691	000821	京山轻机	400	8,184.00	0.02
692	002062	宏润建设	1,500	8,115.00	0.02
693	002540	亚太科技	1,400	8,092.00	0.02
694	600985	淮北矿业	700	8,064.00	0.02
695	300418	昆仑万维	200	8,056.00	0.02
696	002795	永和智控	900	7,974.00	0.01
697	688315	诺禾致源	300	7,965.00	0.01
698	601868	中国能建	3,400	7,956.00	0.01
699	600765	中航重机	300	7,953.00	0.01
700	301045	天禄科技	300	7,944.00	0.01
701	300143	盈康生命	700	7,938.00	0.01
702	600064	南京高科	1,200	7,932.00	0.01
703	603628	清源股份	500	7,915.00	0.01
704	002895	川恒股份	400	7,880.00	0.01
705	300856	科思股份	100	7,877.00	0.01
706	002956	西麦食品	500	7,815.00	0.01
707	002014	永新股份	900	7,812.00	0.01
707	603920	世运电路	400	7,812.00	0.01
708	002582	好想你	1,000	7,810.00	0.01
709	301102	兆讯传媒	290	7,792.30	0.01
710	603035	常熟汽饰	400	7,772.00	0.01
710	603100	川仪股份	200	7,772.00	0.01
711	688420	美腾科技	200	7,746.00	0.01
712	300510	金冠股份	1,100	7,678.00	0.01
713	002116	中国海诚	600	7,668.00	0.01
714	002782	可立克	500	7,645.00	0.01
715	603816	顾家家居	200	7,630.00	0.01
716	300830	金现代	800	7,600.00	0.01
717	600862	中航高科	300	7,593.00	0.01
718	000688	国城矿业	500	7,585.00	0.01
719	603556	海兴电力	300	7,572.00	0.01
720	000065	北方国际	500	7,510.00	0.01
721	603719	良品铺子	300	7,503.00	0.01
722	003020	立方制药	200	7,402.00	0.01
723	688359	三孚新科	100	7,400.00	0.01
724	601336	新华保险	200	7,354.00	0.01
725	688102	斯瑞新材	600	7,320.00	0.01
726	002276	万马股份	600	7,266.00	0.01
727	002512	达华智能	1,800	7,218.00	0.01
728	000426	兴业银锡	800	7,104.00	0.01

729	301266	宇邦新材	100	7,031.00	0.01
730	000409	云鼎科技	700	6,993.00	0.01
731	603690	至纯科技	200	6,968.00	0.01
732	600483	福能股份	600	6,930.00	0.01
733	002544	普天科技	300	6,870.00	0.01
734	002230	科大讯飞	100	6,796.00	0.01
735	300382	斯莱克	500	6,595.00	0.01
736	603396	金辰股份	100	6,560.00	0.01
736	603650	彤程新材	200	6,560.00	0.01
737	603198	迎驾贡酒	100	6,380.00	0.01
738	600928	西安银行	1,800	6,336.00	0.01
739	300863	卡倍亿	100	6,291.00	0.01
740	603979	金诚信	200	6,220.00	0.01
741	300442	润泽科技	200	6,152.00	0.01
742	300811	铂科新材	100	5,944.00	0.01
743	600879	航天电子	700	5,943.00	0.01
744	600211	西藏药业	100	5,940.00	0.01
745	688002	睿创微纳	130	5,824.00	0.01
746	300633	开立医疗	100	5,450.00	0.01
747	688039	当虹科技	140	5,017.60	0.01
748	688229	博睿数据	100	4,994.00	0.01
749	603606	东方电缆	100	4,903.00	0.01
750	002831	裕同科技	200	4,878.00	0.01
751	300979	华利集团	100	4,874.00	0.01
752	000977	浪潮信息	100	4,850.00	0.01
753	600276	恒瑞医药	100	4,790.00	0.01
754	000708	中信特钢	300	4,752.00	0.01
755	002152	广电运通	400	4,688.00	0.01
756	601881	中国银河	400	4,644.00	0.01
757	688626	翔宇医疗	100	4,551.00	0.01
758	600009	上海机场	100	4,542.00	0.01
759	002352	顺丰控股	100	4,509.00	0.01
760	688698	伟创电气	100	3,998.00	0.01
761	000598	兴蓉环境	700	3,801.00	0.01
762	688273	麦澜德	100	3,701.00	0.01
763	688168	安博通	100	3,560.00	0.01
764	688087	英科再生	140	3,333.40	0.01
765	002970	锐明技术	100	3,149.00	0.01
766	605376	博迁新材	100	3,138.00	0.01
767	601997	贵阳银行	600	3,096.00	0.01
768	600674	川投能源	200	3,010.00	0.01
769	600643	爱建集团	600	3,000.00	0.01
770	600188	兖矿能源	100	2,992.00	0.01

771	002019	亿帆医药	200	2,920.00	0.01
772	600118	中国卫星	100	2,821.00	0.01
773	300545	联得装备	100	2,777.00	0.01
774	300148	天舟文化	500	2,760.00	0.01
775	002374	中锐股份	700	2,758.00	0.01
776	603918	金桥信息	100	2,747.00	0.01
777	600989	宝丰能源	200	2,522.00	0.00
778	000975	银泰黄金	200	2,340.00	0.00
779	002885	京泉华	100	2,184.00	0.00
780	603300	华铁应急	400	2,180.00	0.00
781	600810	神马股份	300	2,133.00	0.00
782	000830	鲁西化工	200	2,112.00	0.00
783	300389	艾比森	100	2,037.00	0.00
784	002404	嘉欣丝绸	300	2,022.00	0.00
785	601598	中国外运	400	1,864.00	0.00
786	300498	温氏股份	100	1,835.00	0.00
787	002081	金螳螂	400	1,804.00	0.00
788	600019	宝钢股份	300	1,686.00	0.00
789	300207	欣旺达	100	1,632.00	0.00
790	000900	现代投资	400	1,612.00	0.00
791	600356	恒丰纸业	200	1,566.00	0.00
792	600782	新钢股份	400	1,484.00	0.00
793	300230	永利股份	400	1,416.00	0.00
794	002649	博彦科技	100	1,413.00	0.00
795	601360	三六零	100	1,254.00	0.00
796	600817	宇通重工	100	1,119.00	0.00
797	300215	电科院	200	1,024.00	0.00
798	688285	高铁电气	100	1,000.00	0.00
799	300129	泰胜风能	100	959.00	0.00
800	300095	华伍股份	100	946.00	0.00
801	600057	厦门象屿	100	870.00	0.00
802	000789	万年青	100	775.00	0.00
803	601236	红塔证券	100	745.00	0.00
804	600478	科力远	100	714.00	0.00
805	600133	东湖高新	100	659.00	0.00
806	600531	豫光金铅	100	630.00	0.00
807	601933	永辉超市	100	313.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600519	贵州茅台	1,057,307.00	2.07
2	601318	中国平安	907,763.00	1.78
3	600546	山煤国际	856,233.00	1.67
4	601398	工商银行	793,793.00	1.55
5	688777	中控技术	735,578.39	1.44
6	002475	立讯精密	706,874.00	1.38
7	601298	青岛港	684,128.00	1.34
8	000999	华润三九	645,815.00	1.26
9	000001	平安银行	627,808.00	1.23
10	601958	金铂股份	614,853.00	1.20
11	600282	南钢股份	611,469.00	1.20
12	002273	水晶光电	610,652.00	1.19
13	002372	伟星新材	578,786.00	1.13
14	300026	红日药业	564,615.00	1.10
15	600958	东方证券	561,913.00	1.10
16	600998	九州通	560,973.00	1.10
17	300750	宁德时代	557,270.00	1.09
18	000988	华工科技	554,697.00	1.09
19	600968	海油发展	551,965.00	1.08
20	601869	长飞光纤	544,865.00	1.07

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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	1,392,020.00	2.72
2	601398	工商银行	1,062,293.00	2.08
3	300750	宁德时代	895,405.00	1.75
4	002475	立讯精密	833,059.00	1.63
5	601318	中国平安	786,000.00	1.54
6	601298	青岛港	773,406.00	1.51
7	000858	五粮液	728,931.00	1.43
8	300760	迈瑞医疗	618,298.00	1.21
9	600958	东方证券	570,586.00	1.12
10	601869	长飞光纤	564,792.00	1.10
11	000988	华工科技	538,864.00	1.05
12	000999	华润三九	533,700.00	1.04
13	603228	景旺电子	514,780.00	1.01
14	600998	九州通	509,929.00	1.00
15	688777	中控技术	508,101.53	0.99
16	600546	山煤国际	483,160.00	0.95

17	002142	宁波银行	478,053.00	0.94
18	002281	光迅科技	473,521.00	0.93
19	002396	星网锐捷	471,949.00	0.92
20	002594	比亚迪	471,506.00	0.92

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	189,133,180.88
卖出股票收入（成交）总额	177,601,644.62

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,939,256.81	5.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,939,256.81	5.51

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	113056	重银转债	5,090	514,994.35	0.97
2	113042	上银转债	3,780	409,057.10	0.77
3	110059	浦发转债	3,770	407,507.87	0.76
4	113021	中信转债	1,800	207,206.33	0.39
5	113065	齐鲁转债	2,010	198,495.15	0.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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 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 38,245,813.25 元，占基金资产净值的比例为 71.67%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 35,650,560.00 元，占基金资产净值的比例为 66.81%，空头合约市值占股票资产的比例为 93.21%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -140,516.15 元，公允价值变动损益为 571,796.62 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重银转债（代码：113056 SH）、上银转债（代码：113042 SH）、浦发转债（代码：110059 SH）、平安银行（代码：000001 SZ）、中国平安（代码：601318 SH）、金钼股份（代码：601958 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. 重庆银行股份有限公司

2023 年 3 月 16 日，重庆银行股份有限公司因内部制度不完善，违规经营被中国证券监督管理委员会重庆监管局警示。

2023 年 4 月 24 日，重庆银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被重庆市通信管理局、四川省通信管理局责令改正。

2. 上海银行股份有限公司

2023 年 4 月 21 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得。

3. 上海浦东发展银行股份有限公司

2022 年 8 月 17 日，上海浦东发展银行股份有限公司因未依法履行职责被上海市市场监督管理局罚款。

2022 年 9 月 2 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得、通知整改。

2022 年 10 月 24 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被中国银行间市场交易商协会诫勉谈话、通知整改。

2022 年 10 月 26 日，上海浦东发展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诫勉谈话。

4. 平安银行股份有限公司

2023 年 1 月 18 日，平安银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律规定被中国银行间市场交易商协会通报批评。

5. 中国平安保险(集团)股份有限公司

2022 年 8 月 22 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局深圳市分局警告、罚款、通知整改。

6. 金堆城钼业股份有限公司

2023 年 6 月 29 日，金堆城钼业股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被中国证券监督管理委员会陕西监管局出具警示函。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.13.2 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	4,297,120.13
2	应收清算款	-
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	4,297,120.13

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113056	重银转债	514,994.35	0.97
2	113042	上银转债	409,057.10	0.77
3	110059	浦发转债	407,507.87	0.76
4	113021	中信转债	207,206.33	0.39
5	113065	齐鲁转债	198,495.15	0.37
6	113052	兴业转债	147,483.95	0.28
7	113589	天创转债	101,202.16	0.19
8	128081	海亮转债	99,488.89	0.19
9	113037	紫银转债	99,343.53	0.19
10	113596	城地转债	97,920.84	0.18
11	113033	利群转债	78,411.88	0.15
12	123128	首华转债	77,522.50	0.15
13	127018	本钢转债	76,099.41	0.14
14	110064	建工转债	70,001.74	0.13
15	113505	杭电转债	59,943.11	0.11
16	113519	长久转债	52,307.25	0.10
17	128108	蓝帆转债	49,123.37	0.09
18	128035	大族转债	48,887.34	0.09
19	110063	鹰 19 转债	47,551.36	0.09
20	113610	灵康转债	47,490.60	0.09
21	123167	商络转债	11,505.87	0.02

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中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 (%)
安信阿尔法定开混合 A	1,300	21,364.44	-	-	27,773,766.54	100.00
安信阿尔法定开混合 C	393	43,798.70	12,826,807.68	74.52	4,386,079.51	25.48
合计	1,668	26,970.42	12,826,807.68	28.51	32,159,846.05	71.49

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	896,939.95	3.23
	安信阿尔法定开混合 C	2,751.69	0.02
	合计	899,691.64	2.00

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	50~100
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	50~100
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

8.4 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。

§ 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	34,980,571.51	8,610,985.55
本报告期基金总申购份额	325,186.49	11,128,064.48
减：本报告期基金总赎回份额	7,531,991.46	2,526,162.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,773,766.54	17,212,887.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基

金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

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 (%)	
浙商证券	2	263,615,678.00	71.93	190,146.81	71.93	-
东方证券	2	102,895,805.77	28.07	74,218.28	28.07	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	新租
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	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、系统支持等服务作为交易单元的选择标准，由分管投资领导、投资部门、研究部门、交易部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

		(%)		比例 (%)		(%)
浙商证券	7,844,172.70	35.05	399,560,000.00	57.26	-	-
东方证券	14,533,285.71	64.95	298,200,000.00	42.74	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-01-19
2	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 2023 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2023-03-07
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-03-30
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-04-21
5	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-20
6	安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2023-05-22
7	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 2023 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2023-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230615-202	-	11,128,0	-	11,128,020.70	24.74

		30630		20.70		
产品特有风险						
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>						

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

2023 年 8 月 29 日