

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工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。

基金托管人中国工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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	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 .....	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
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 .....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	59
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 .....	59

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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	安信量化沪深 300 增强	
基金主代码	003957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 7 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	99,720,396.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份 额总额	28,366,166.08 份	71,354,230.44 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金将参考标的指数成分股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*90%+商业银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国工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
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	95588
传真	0755-82799292	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518026	100140
法定代表人	刘入领	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
本期已实现收益	366,299.23	435,628.34
本期利润	46,417.21	-720,551.00
加权平均基金份额本期利润	0.0016	-0.0102
本期加权平均净值利润率	0.11%	-0.70%
本期基金份额净值增长率	0.23%	0.13%
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	7,677,167.90	17,714,079.63
期末可供分配基金份额利润	0.2706	0.2483
期末基金资产净值	41,239,813.31	102,042,965.18
期末基金份额净值	1.4538	1.4301
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	37.68%	36.54%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信量化沪深 300 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.15%	0.82%	1.05%	0.79%	1.10%	0.03%
过去三个月	-2.66%	0.75%	-4.62%	0.75%	1.96%	0.00%
过去六个月	0.23%	0.78%	-0.62%	0.76%	0.85%	0.02%
过去一年	-12.67%	0.91%	-12.87%	0.89%	0.20%	0.02%
过去三年	6.26%	1.14%	-6.44%	1.08%	12.70%	0.06%
自基金转型起至今	37.68%	1.16%	4.70%	1.09%	32.98%	0.07%

安信量化沪深 300 增强 C

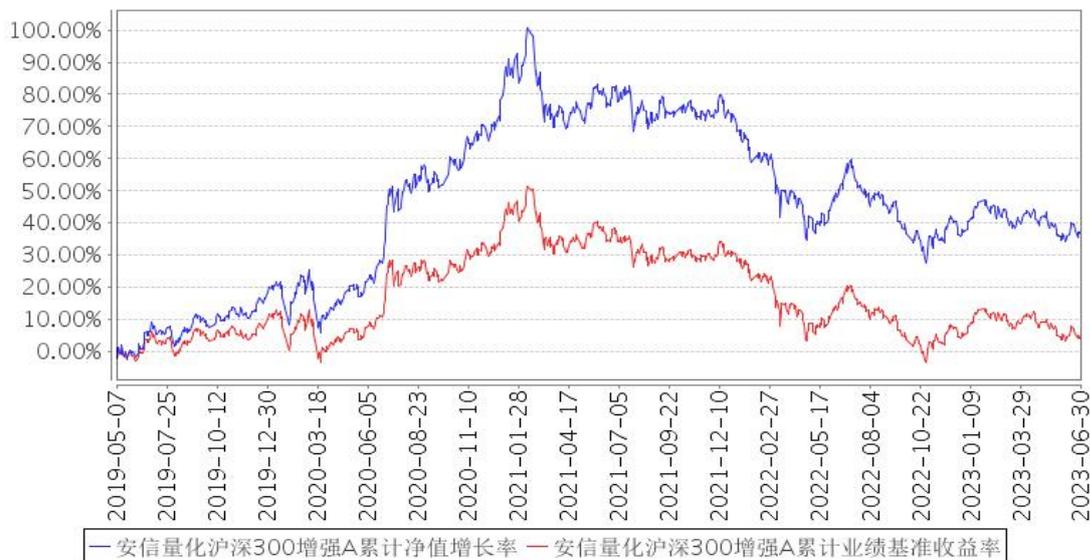
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.14%	0.82%	1.05%	0.79%	1.09%	0.03%
过去三个月	-2.71%	0.76%	-4.62%	0.75%	1.91%	0.01%
过去六个月	0.13%	0.78%	-0.62%	0.76%	0.75%	0.02%
过去一年	-12.84%	0.91%	-12.87%	0.89%	0.03%	0.02%
过去三年	5.62%	1.14%	-6.44%	1.08%	12.06%	0.06%
自基金转型起至今	36.54%	1.16%	4.70%	1.09%	31.84%	0.07%

注：根据《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*90%+商业银行活期存款利率（税后）\*10%。由于本基金投资标的指数为沪深 300 指数，且每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金的业绩比较基准以沪深 300 指数为主要组成部分。

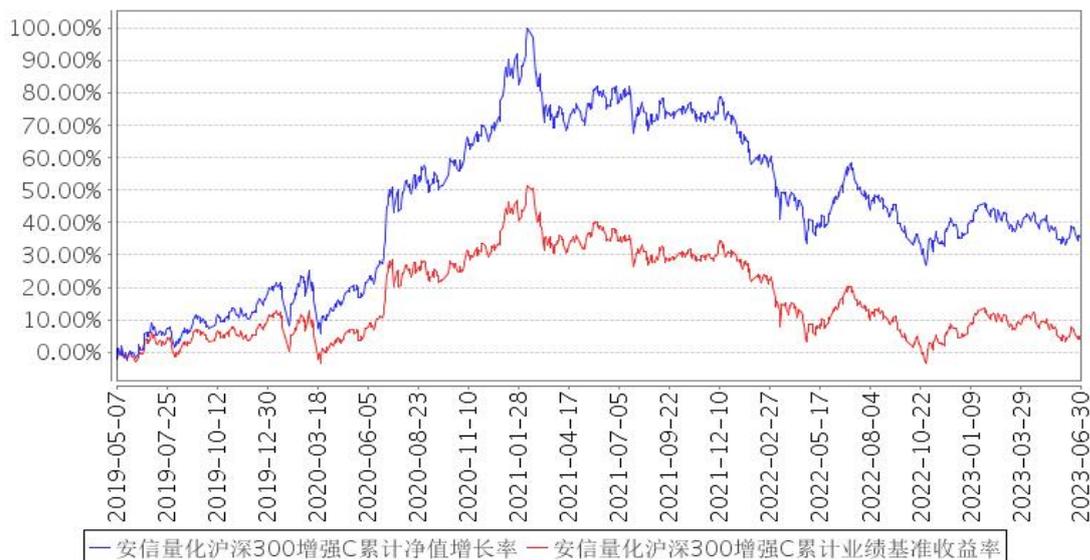
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

安信量化沪深300增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信量化沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金 2019 年 5 月 7 日由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 7 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。建仓期结束后，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐黄玮	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2019 年 5 月 7 日	-	16 年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证

					券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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量化沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.4538 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.23%；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.4301 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.13%；同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,540,634.23	3,109,015.23
结算备付金		1,564,338.66	1,600,194.54
存出保证金		613,303.80	72,588.57
交易性金融资产	6.4.7.2	137,261,995.81	119,528,458.36
其中：股票投资		130,627,379.48	115,875,140.02
基金投资		-	-
债券投资		6,634,616.33	3,653,318.34
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	2,998,901.37	-
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		1,567.34	7,567,876.14
应收股利		-	-
应收申购款		96,676.81	188,488.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		144,077,418.02	132,066,621.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	799,808.35
应付清算款		78,039.13	7,208,377.15

应付赎回款		37,111.35	50,056.14
应付管理人报酬		93,908.76	95,129.52
应付托管费		11,738.62	11,891.21
应付销售服务费		16,760.17	14,163.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	557,081.16	783,720.67
负债合计		794,639.53	8,963,147.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	99,720,396.52	85,757,982.26
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	43,562,381.97	37,345,492.13
净资产合计		143,282,778.49	123,103,474.39
负债和净资产总计		144,077,418.02	132,066,621.39

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 99,720,396.52 份，其中安信量化沪深 300 增强 A 基金份额总额 28,366,166.08 份，基金份额净值 1.4538 元；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额总额 71,354,230.44 份，基金份额净值 1.4301 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		293,136.99	-25,353,701.27
1. 利息收入		39,829.30	76,894.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,017.81	42,870.26
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		16,811.49	34,024.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,707,363.58	-38,744,396.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-201,217.83	-40,329,000.14
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	24,171.32	205,761.19
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	188,338.83	-1,154,091.30
股利收益	6.4.7.15	1,696,071.26	2,532,934.18
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	-1,476,061.36	13,291,079.66
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	22,005.47	22,720.36
<b>减：二、营业总支出</b>		967,270.78	1,395,065.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	584,201.25	944,346.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,025.18	118,043.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	102,923.57	109,455.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,894.87	18,027.65
其中：卖出回购金融资产 支出		6,894.87	18,027.65
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,034.24	0.24
8. 其他费用	6.4.7.19	199,191.67	205,192.10
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		-674,133.79	-26,748,767.00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		-674,133.79	-26,748,767.00
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-674,133.79	-26,748,767.00

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收	未分配利润	净资产合计

		益		
一、上期期末净资产（基金净值）	85,757,982.26	-	37,345,492.13	123,103,474.39
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）	85,757,982.26	-	37,345,492.13	123,103,474.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,962,414.26	-	6,216,889.84	20,179,304.10
（一）、综合收益总额	-	-	-674,133.79	-674,133.79
（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）	13,962,414.26	-	6,891,023.63	20,853,437.89
其中：1. 基金申购款	25,695,703.66	-	12,695,779.03	38,391,482.69
2. 基金赎回款	-11,733,289.40	-	-5,804,755.40	-17,538,044.80
（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）	99,720,396.52	-	43,562,381.97	143,282,778.49
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）	165,634,977.17	-	136,529,479.00	302,164,456.17
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）	165,634,977.17	-	136,529,479.00	302,164,456.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,379,138.93	-	-42,214,686.15	-63,593,825.08
（一）、综合收益总额	-	-	-26,748,767.00	-26,748,767.00
（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）	-21,379,138.93	-	-15,465,919.15	-36,845,058.08
其中：1. 基金申购款	19,281,148.56	-	11,384,341.33	30,665,489.89
2. 基金赎回款	-40,660,287.49	-	-26,850,260.48	-67,510,547.97
（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）	144,255,838.24	-	94,314,792.85	238,570,631.09

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

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“安信新起点混合”）于 2019 年 5 月 7 日转型而来。基金转型事项获中国证券监督管理委员会于 2019 年 3 月 13 日下发的证监许可[2019]375 号文“关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复”的核准，并经安信新起点基金份额持有人大会决议通过。自 2019 年 5 月 7 日起，由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效，原安信新起点混合基金更名为安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），为契约型开放式基金，存续期限不定。

原安信新起点混合于基金合同失效前的基金资产净值为 64,272,976.13 元，基金份额为 64,272,976.13 份，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值、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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、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；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且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《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证），债券（包括国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（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

投资组合比例为：股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*90%+商业银行活期存款利率（税后）\*10%。

#### 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发展费附加的单位外）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	1,540,634.23
等于：本金	1,540,424.41

加：应计利息	209.82
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,540,634.23

#### 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	131,161,496.49	-	130,627,379.48	-534,117.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	74,101.83	6,634,616.33	19,360.22
	银行间市场	-	-	-
	合计	74,101.83	6,634,616.33	19,360.22
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	137,702,650.77	74,101.83	137,261,995.81	-514,756.79

#### 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	4,581,260.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	4,581,260.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-
合计	4,581,260.00	-	-

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
IF2307	IF2307	4.00	4,596,480.00	15,220.00
合计				15,220.00
减：可抵销期货暂收款				15,220.00
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	2,998,901.37	-
银行间市场	-	-
合计	2,998,901.37	-

##### 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	0.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	418,437.42

其中：交易所市场	418,437.42
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
应付审计费	19,835.79
应付银行间账户维护费	9,300.00
合计	557,081.16

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信量化沪深 300 增强 A

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,176,581.11	28,176,581.11
本期申购	6,194,418.63	6,194,418.63
本期赎回（以“-”号填列）	-6,004,833.66	-6,004,833.66
本期末	28,366,166.08	28,366,166.08

##### 安信量化沪深 300 增强 C

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,581,401.15	57,581,401.15
本期申购	19,501,285.03	19,501,285.03
本期赎回（以“-”号填列）	-5,728,455.74	-5,728,455.74
本期末	71,354,230.44	71,354,230.44

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 安信量化沪深 300 增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,377,092.15	5,314,425.10	12,691,517.25
本期利润	366,299.23	-319,882.02	46,417.21
本期基金份额交易产生的变动数	-66,223.48	201,936.25	135,712.77
其中：基金申购款	1,692,286.03	1,475,920.40	3,168,206.43
基金赎回款	-1,758,509.51	-1,273,984.15	-3,032,493.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,677,167.90	5,196,479.33	12,873,647.23

##### 安信量化沪深 300 增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	13,877,994.43	10,775,980.45	24,653,974.88
本期利润	435,628.34	-1,156,179.34	-720,551.00
本期基金份额交易产生的变动数	3,400,456.86	3,354,854.00	6,755,310.86
其中：基金申购款	4,860,654.49	4,666,918.11	9,527,572.60
基金赎回款	-1,460,197.63	-1,312,064.11	-2,772,261.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,714,079.63	12,974,655.11	30,688,734.74

#### 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	8,484.02	
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	14,028.08	
其他	505.71	
合计	23,017.81	

#### 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	655,692,987.96	
减：卖出股票成本总额	654,178,216.34	
减：交易费用	1,715,989.45	
买卖股票差价收入	-201,217.83	

#### 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	60,121.10	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-35,949.78	
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	24,171.32	

##### 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	4,387,338.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,349,949.78
减：应计利息总额	73,338.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-35,949.78

#### 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	188,338.83

#### 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	1,696,071.26
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	1,696,071.26

#### 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	-1,491,281.36
股票投资	-1,531,787.16
债券投资	40,505.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	15,220.00

权证投资	-
期货投资	15,220.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,476,061.36

#### 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	21,947.70
基金转换费收入	57.77
合计	22,005.47

#### 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,248.51
银行间账户维护费	18,600.00
指数使用费	100,000.00
合计	199,191.67

#### 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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
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

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股票交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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	584,201.25	944,346.56
其中：支付销售机构的客户维护费	161,515.65	148,878.00

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,025.18	118,043.30

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	合计
安信基金	-	50,634.67	50,634.67
安信证券	-	62.82	62.82
合计	-	50,697.49	50,697.49
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		
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	合计
安信基金	-	73,187.39	73,187.39
安信证券	-	63.59	63.59
合计	-	73,250.98	73,250.98

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金。

#### 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
工商银行	1,540,634.23	8,484.02	3,551,347.70	8,687.18

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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均无需说明的其他关联交易事项。

### 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
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	148	1,725.68	1,814.48	-
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	3,900	7,878.00	10,296.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	174	6,591.12	5,131.26	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	57	4,275.00	5,173.32	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	550	6,105.00	9,372.00	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	20.92	19.16	173	3,619.16	3,314.68	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	99	3,465.00	5,071.77	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	52	7,061.60	6,261.32	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	326	3,644.68	4,756.34	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	130	3,286.40	3,883.10	-

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 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 0.04%（2022 年 12 月 31 日：无）。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,572,751.92	-
合计	6,572,751.92	-

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。

#### 6.4.13.2.2 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	61,864.41	-
未评级	-	3,653,318.34
合计	61,864.41	3,653,318.34

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	1,540,634.23	-	-	-	1,540,634.23
结算备付金	1,564,338.66	-	-	-	1,564,338.66
存出保证金	613,303.80	-	-	-	613,303.80
交易性金融资产	6,572,751.92	-	61,864.41	130,627,379.48	137,261,995.81
买入返售金融资产	2,998,901.37	-	-	-	2,998,901.37
应收申购款	-	-	-	96,676.81	96,676.81
应收清算款	-	-	-	1,567.34	1,567.34
资产总计	13,289,929.98	-	61,864.41	130,725,623.63	144,077,418.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	37,111.35	37,111.35
应付管理人报酬	-	-	-	93,908.76	93,908.76
应付托管费	-	-	-	11,738.62	11,738.62
应付清算款	-	-	-	78,039.13	78,039.13
应付销售服务费	-	-	-	16,760.17	16,760.17
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	557,081.16	557,081.16
负债总计	-	-	-	794,639.53	794,639.53
利率敏感度缺口	13,289,929.98	-	61,864.41	129,930,984.10	143,282,778.49
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	3,109,015.23	-	-	-	3,109,015.23
结算备付金	1,600,194.54	-	-	-	1,600,194.54
存出保证金	72,588.57	-	-	-	72,588.57
交易性金融资产	3,653,318.34	-	-	115,875,140.02	119,528,458.36
应收申购款	-	-	-	188,488.55	188,488.55
应收清算款	-	-	-	7,567,876.14	7,567,876.14
资产总计	8,435,116.68	-	-	123,631,504.71	132,066,621.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,056.14	50,056.14
应付管理人报酬	-	-	-	95,129.52	95,129.52
应付托管费	-	-	-	11,891.21	11,891.21
应付清算款	-	-	-	7,208,377.15	7,208,377.15
卖出回购金融资产款	799,808.35	-	-	-	799,808.35
应付销售服务费	-	-	-	14,163.96	14,163.96

其他负债	-	-	-	783,720.67	783,720.67
负债总计	799,808.35	-	-	8,163,338.65	8,963,147.00
利率敏感度缺口	7,635,308.33	-	-	-115,468,166.06	123,103,474.39

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	6,106.88	2,663.38
	2. 市场利率上升 25 个基点	-6,084.78	-2,659.50

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	130,627,379.48	91.17	115,875,140.02	94.13
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	130,627,379.48	91.17	115,875,140.02	94.13

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%	6,072,293.01	5,925,942.78
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-6,072,293.01	-5,925,942.78

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	130,634,169.62	115,594,914.28
第二层次	6,583,047.92	3,653,318.34
第三层次	44,778.27	280,225.74
合计	137,261,995.81	119,528,458.36

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	130,627,379.48	90.66
	其中：股票	130,627,379.48	90.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,634,616.33	4.60

	其中：债券	6,634,616.33	4.60
	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	2,998,901.37	2.08
	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	3,104,972.89	2.16
8	其他各项资产	711,547.95	0.49
9	合计	144,077,418.02	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	224,685.00	0.16
B	采矿业	3,958,152.00	2.76
C	制造业	68,428,706.73	47.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,714,528.00	3.29
E	建筑业	3,364,034.80	2.35
F	批发和零售业	40,338.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	3,366,068.00	2.35
H	住宿和餐饮业	8,468.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,497,951.84	3.84
J	金融业	23,389,739.45	16.32
K	房地产业	1,366,220.00	0.95
L	租赁和商务服务业	407,866.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	951,795.00	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	180,480.50	0.13
R	文化、体育和娱乐业	126,577.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	116,025,610.32	80.98

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,442.00	0.01
B	采矿业	138,656.00	0.10
C	制造业	10,596,009.18	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	411,552.28	0.29
F	批发和零售业	272,422.20	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	138,526.80	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,617,576.10	1.13
J	金融业	676,820.00	0.47
K	房地产业	42,244.00	0.03
L	租赁和商务服务业	78,874.60	0.06
M	科学研究和技术服务业	191,194.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	288,688.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,949.00	0.02
Q	卫生和社会工作	28,464.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	65,219.00	0.05
S	综合	13,132.00	0.01
	合计	14,601,769.16	10.19

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,200	5,411,200.00	3.78
2	601318	中国平安	82,000	3,804,800.00	2.66
3	000333	美的集团	48,300	2,845,836.00	1.99

4	601006	大秦铁路	376,200	2,795,166.00	1.95
5	600036	招商银行	76,900	2,519,244.00	1.76
6	688599	天合光能	57,212	2,437,803.32	1.70
7	601985	中国核电	338,400	2,385,720.00	1.67
8	000338	潍柴动力	189,300	2,358,678.00	1.65
9	300750	宁德时代	9,940	2,274,172.60	1.59
10	601668	中国建筑	358,000	2,054,920.00	1.43
11	002236	大华股份	102,600	2,026,350.00	1.41
12	601857	中国石油	270,100	2,017,647.00	1.41
13	601688	华泰证券	140,110	1,929,314.70	1.35
14	000651	格力电器	52,200	1,905,822.00	1.33
15	000858	五粮液	11,500	1,881,055.00	1.31
16	002129	TCL 中环	52,625	1,747,150.00	1.22
17	002459	晶澳科技	41,660	1,737,222.00	1.21
18	000001	平安银行	149,400	1,677,762.00	1.17
19	600941	中国移动	17,500	1,632,750.00	1.14
20	002475	立讯精密	49,000	1,590,050.00	1.11
21	600089	特变电工	67,000	1,493,430.00	1.04
22	600438	通威股份	43,300	1,485,623.00	1.04
23	002466	天齐锂业	20,000	1,398,200.00	0.98
24	601939	建设银行	210,300	1,316,478.00	0.92
25	600803	新奥股份	67,200	1,275,456.00	0.89
26	000733	振华科技	13,200	1,265,220.00	0.88
27	000538	云南白药	23,700	1,243,776.00	0.87
28	603369	今世缘	23,300	1,230,240.00	0.86
29	000625	长安汽车	94,000	1,215,420.00	0.85
30	600845	宝信软件	23,220	1,179,808.20	0.82
31	300122	智飞生物	26,600	1,175,720.00	0.82
32	000063	中兴通讯	25,300	1,152,162.00	0.80
33	002304	洋河股份	8,600	1,129,610.00	0.79
34	601600	中国铝业	203,900	1,119,411.00	0.78
35	600332	白云山	34,000	1,083,920.00	0.76
36	000408	藏格矿业	47,500	1,072,075.00	0.75
37	600276	恒瑞医药	21,200	1,015,480.00	0.71
38	601881	中国银河	87,400	1,014,714.00	0.71
39	002594	比亚迪	3,900	1,007,253.00	0.70
40	300316	晶盛机电	14,100	999,690.00	0.70
41	600600	青岛啤酒	9,600	994,848.00	0.69
42	002179	中航光电	21,900	993,165.00	0.69
43	600309	万华化学	11,300	992,592.00	0.69
44	600919	江苏银行	133,700	982,695.00	0.69
45	600030	中信证券	49,600	981,088.00	0.68
46	002756	永兴材料	15,510	971,081.10	0.68

47	000596	古井贡酒	3,900	964,782.00	0.67
48	002252	上海莱士	126,100	947,011.00	0.66
49	002049	紫光国微	10,100	941,825.00	0.66
50	000895	双汇发展	37,500	918,375.00	0.64
51	600809	山西汾酒	4,900	906,843.00	0.63
52	601898	中煤能源	106,000	894,640.00	0.62
53	600690	海尔智家	37,700	885,196.00	0.62
54	002007	华兰生物	38,900	871,749.00	0.61
55	000786	北新建材	35,500	870,105.00	0.61
56	603259	药明康德	13,100	816,261.00	0.57
57	600048	保利发展	61,900	806,557.00	0.56
58	601998	中信银行	132,200	790,556.00	0.55
59	600926	杭州银行	66,600	782,550.00	0.55
60	601319	中国人保	128,800	752,192.00	0.52
61	601877	正泰电器	27,000	746,550.00	0.52
62	002142	宁波银行	29,200	738,760.00	0.52
63	300014	亿纬锂能	11,500	695,750.00	0.49
64	601211	国泰君安	44,000	615,560.00	0.43
65	300999	金龙鱼	15,200	607,848.00	0.42
66	600016	民生银行	160,400	601,500.00	0.42
67	000425	徐工机械	88,400	598,468.00	0.42
68	601138	工业富联	23,400	589,680.00	0.41
69	600362	江西铜业	30,800	584,584.00	0.41
70	600660	福耀玻璃	16,300	584,355.00	0.41
71	601088	中国神华	19,000	584,250.00	0.41
72	600011	华能国际	62,100	575,046.00	0.40
73	002371	北方华创	1,800	571,770.00	0.40
74	002415	海康威视	17,200	569,492.00	0.40
75	600039	四川路桥	52,680	516,790.80	0.36
76	601288	农业银行	141,200	498,436.00	0.35
77	002230	科大讯飞	7,000	475,720.00	0.33
78	000166	申万宏源	100,800	465,696.00	0.33
79	601336	新华保险	12,400	455,948.00	0.32
80	688111	金山办公	962	454,275.64	0.32
81	601009	南京银行	56,200	449,600.00	0.31
82	601988	中国银行	114,900	449,259.00	0.31
83	601899	紫金矿业	37,100	421,827.00	0.29
84	601601	中国太保	15,400	400,092.00	0.28
85	002027	分众传媒	53,400	363,654.00	0.25
86	300274	阳光电源	2,900	338,227.00	0.24
87	600050	中国联通	70,400	337,920.00	0.24
88	000002	万科 A	24,000	336,480.00	0.23
89	601728	中国电信	58,000	326,540.00	0.23

90	600584	长电科技	10,100	314,817.00	0.22
91	002555	三七互娱	8,900	310,432.00	0.22
92	600025	华能水电	42,500	303,025.00	0.21
93	000938	紫光股份	9,300	296,205.00	0.21
94	601166	兴业银行	18,681	292,357.65	0.20
95	601658	邮储银行	58,900	288,021.00	0.20
96	601117	中国化学	32,600	269,928.00	0.19
97	601628	中国人寿	7,700	269,192.00	0.19
98	603986	兆易创新	2,500	265,625.00	0.19
99	002736	国信证券	29,100	254,043.00	0.18
100	600085	同仁堂	4,400	253,264.00	0.18
101	601800	中国交建	22,700	247,657.00	0.17
102	600029	南方航空	39,200	236,376.00	0.16
103	000977	浪潮信息	4,800	232,800.00	0.16
104	688981	中芯国际	4,500	227,340.00	0.16
105	002714	牧原股份	5,200	219,180.00	0.15
106	600745	闻泰科技	4,400	215,160.00	0.15
107	603392	万泰生物	3,200	213,664.00	0.15
108	601169	北京银行	45,100	208,813.00	0.15
109	600588	用友网络	10,100	207,050.00	0.14
110	002938	鹏鼎控股	8,500	206,465.00	0.14
111	002841	视源股份	2,800	187,152.00	0.13
112	600741	华域汽车	9,700	179,062.00	0.12
113	601618	中国中冶	43,700	173,489.00	0.12
114	600674	川投能源	11,500	173,075.00	0.12
115	600570	恒生电子	3,900	172,731.00	0.12
116	603019	中科曙光	3,200	162,880.00	0.11
117	688012	中微公司	1,033	161,612.85	0.11
118	300033	同花顺	900	157,752.00	0.11
119	605499	东鹏饮料	900	155,610.00	0.11
120	600383	金地集团	20,400	147,084.00	0.10
121	000568	泸州老窖	700	146,699.00	0.10
122	601360	三六零	11,600	145,464.00	0.10
123	601878	浙商证券	14,300	141,284.00	0.10
124	002001	新和成	9,000	138,600.00	0.10
125	600015	华夏银行	25,600	138,496.00	0.10
126	300347	泰格医药	2,100	135,534.00	0.09
127	300751	迈为股份	800	135,504.00	0.09
128	601989	中国重工	28,000	134,960.00	0.09
129	300769	德方纳米	1,200	132,276.00	0.09
130	002352	顺丰控股	2,900	130,761.00	0.09
131	300413	芒果超媒	3,700	126,577.00	0.09
132	000157	中联重科	18,300	123,525.00	0.09

133	300433	蓝思科技	10,500	123,480.00	0.09
134	002410	广联达	3,800	123,462.00	0.09
135	300760	迈瑞医疗	400	119,920.00	0.08
136	300450	先导智能	3,300	119,361.00	0.08
137	603806	福斯特	3,100	115,289.00	0.08
138	300408	三环集团	3,600	105,660.00	0.07
139	688005	容百科技	1,934	104,474.68	0.07
140	300763	锦浪科技	1,000	104,100.00	0.07
141	601818	光大银行	31,800	97,626.00	0.07
142	300015	爱尔眼科	5,030	93,306.50	0.07
143	601328	交通银行	16,000	92,800.00	0.06
144	600763	通策医疗	900	87,174.00	0.06
145	600009	上海机场	1,900	86,298.00	0.06
146	601012	隆基绿能	3,000	86,010.00	0.06
147	600436	片仔癀	300	85,908.00	0.06
148	000708	中信特钢	4,700	74,448.00	0.05
149	688036	传音控股	500	73,500.00	0.05
150	688363	华熙生物	800	71,328.00	0.05
151	002821	凯莱英	600	70,716.00	0.05
152	001979	招商蛇口	5,300	69,059.00	0.05
153	601838	成都银行	5,600	68,376.00	0.05
154	600150	中国船舶	2,000	65,820.00	0.05
155	600887	伊利股份	2,200	62,304.00	0.04
156	601868	中国能建	25,600	59,904.00	0.04
157	688561	奇安信	1,100	56,991.00	0.04
158	688126	沪硅产业	2,717	56,785.30	0.04
159	600918	中泰证券	7,500	51,825.00	0.04
160	601021	春秋航空	800	45,976.00	0.03
161	601888	中国中免	400	44,212.00	0.03
162	688008	澜起科技	762	43,754.04	0.03
163	601607	上海医药	1,800	40,338.00	0.03
164	300919	中伟股份	600	36,150.00	0.03
165	600999	招商证券	2,630	35,689.10	0.02
166	601808	中海油服	2,500	34,700.00	0.02
167	600000	浦发银行	4,700	34,028.00	0.02
168	300454	深信服	300	33,975.00	0.02
169	600837	海通证券	3,600	33,192.00	0.02
170	002074	国轩高科	1,200	33,144.00	0.02
171	688303	大全能源	800	32,360.00	0.02
172	600875	东方电气	1,700	31,705.00	0.02
173	601919	中远海控	3,200	30,080.00	0.02
174	605117	德业股份	200	29,910.00	0.02
175	603185	弘元绿能	400	29,820.00	0.02

176	300496	中科创达	300	28,905.00	0.02
177	600585	海螺水泥	1,100	26,114.00	0.02
178	601186	中国铁建	2,400	23,640.00	0.02
179	002311	海大集团	500	23,420.00	0.02
180	600176	中国巨石	1,600	22,656.00	0.02
181	601633	长城汽车	900	22,653.00	0.02
182	603899	晨光股份	500	22,320.00	0.02
183	601872	招商轮船	3,700	21,423.00	0.01
184	688187	时代电气	494	20,678.84	0.01
185	601615	明阳智能	1,200	20,256.00	0.01
186	601216	君正集团	4,900	20,090.00	0.01
187	601816	京沪高铁	3,800	19,988.00	0.01
188	002601	龙佰集团	1,200	19,800.00	0.01
189	603833	欧派家居	200	19,160.00	0.01
190	300957	贝泰妮	200	17,776.00	0.01
191	600346	恒力石化	1,100	15,763.00	0.01
192	600104	上汽集团	1,100	15,587.00	0.01
193	600893	航发动力	300	12,678.00	0.01
194	000800	一汽解放	1,500	12,555.00	0.01
195	601238	广汽集团	1,200	12,504.00	0.01
196	600426	华鲁恒升	400	12,252.00	0.01
197	600219	南山铝业	4,000	12,080.00	0.01
198	601698	中国卫通	600	11,928.00	0.01
199	601766	中国中车	1,800	11,700.00	0.01
200	002064	华峰化学	1,600	10,976.00	0.01
201	600019	宝钢股份	1,900	10,678.00	0.01
202	000877	天山股份	1,300	10,582.00	0.01
203	600010	包钢股份	5,900	10,561.00	0.01
204	600989	宝丰能源	800	10,088.00	0.01
205	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.01
206	601390	中国中铁	1,200	9,096.00	0.01
207	601669	中国电建	1,500	8,610.00	0.01
208	600754	锦江酒店	200	8,468.00	0.01
209	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.01
210	000069	华侨城 A	1,600	7,040.00	0.00
211	002648	卫星化学	400	5,984.00	0.00
212	300498	温氏股份	300	5,505.00	0.00
213	600028	中国石化	800	5,088.00	0.00
214	002050	三花智控	100	3,026.00	0.00
215	000725	京东方 A	700	2,863.00	0.00
216	600900	长江电力	100	2,206.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002600	领益智造	326,000	2,252,660.00	1.57
2	002867	周大生	14,200	252,476.00	0.18
3	002380	科远智慧	10,300	239,990.00	0.17
4	000921	海信家电	8,600	231,770.00	0.16
5	603043	广州酒家	8,100	228,906.00	0.16
6	601577	长沙银行	27,500	213,400.00	0.15
7	600109	国金证券	24,200	209,814.00	0.15
8	300567	精测电子	2,200	209,330.00	0.15
9	300724	捷佳伟创	1,600	179,760.00	0.13
10	002056	横店东磁	9,500	172,995.00	0.12
11	300651	金陵体育	5,800	156,542.00	0.11
12	601208	东材科技	12,100	153,670.00	0.11
13	300969	恒帅股份	1,700	149,855.00	0.10
14	688389	普门科技	6,193	145,473.57	0.10
15	600323	瀚蓝环境	7,500	141,975.00	0.10
16	603688	石英股份	1,100	125,224.00	0.09
17	301039	中集车辆	9,000	119,070.00	0.08
18	002568	百润股份	2,900	105,415.00	0.07
19	002530	金财互联	11,500	104,190.00	0.07
20	600572	康恩贝	15,100	103,435.00	0.07
21	600557	康缘药业	3,700	101,602.00	0.07
22	002624	完美世界	6,000	101,340.00	0.07
23	002959	小熊电器	1,200	100,200.00	0.07
24	000498	山东路桥	15,300	98,226.00	0.07
25	601128	常熟银行	14,300	97,526.00	0.07
26	688006	杭可科技	3,200	97,504.00	0.07
27	002456	欧菲光	17,400	97,440.00	0.07
28	300638	广和通	4,280	97,070.40	0.07
29	603871	嘉友国际	5,880	92,374.80	0.06
30	002929	润建股份	2,100	91,161.00	0.06
31	300378	鼎捷软件	2,600	89,050.00	0.06
32	600416	湘电股份	4,600	87,814.00	0.06
33	300396	迪瑞医疗	2,700	87,723.00	0.06
34	002737	葵花药业	3,600	87,624.00	0.06
35	002851	麦格米特	2,400	87,528.00	0.06
36	000682	东方电子	9,000	87,480.00	0.06
37	300773	拉卡拉	4,900	85,456.00	0.06
38	002967	广电计量	4,200	84,378.00	0.06
39	605266	健之佳	1,000	83,830.00	0.06
40	002572	索菲亚	4,600	80,132.00	0.06
41	000878	云南铜业	7,100	78,455.00	0.05
42	002078	太阳纸业	7,300	78,037.00	0.05

43	002034	旺能环境	4,900	77,469.00	0.05
44	603027	千禾味业	3,600	76,032.00	0.05
45	603032	德新科技	2,200	75,988.00	0.05
46	000739	普洛药业	4,200	74,508.00	0.05
47	000513	丽珠集团	1,900	73,929.00	0.05
48	601966	玲珑轮胎	3,300	73,326.00	0.05
49	002409	雅克科技	1,000	72,880.00	0.05
50	000933	神火股份	5,600	72,800.00	0.05
51	688208	道通科技	2,400	72,744.00	0.05
52	601126	四方股份	4,700	71,393.00	0.05
53	603283	赛腾股份	1,600	71,200.00	0.05
54	600546	山煤国际	4,900	70,903.00	0.05
55	600549	厦门钨业	3,700	70,411.00	0.05
56	688459	哈铁科技	7,300	70,372.00	0.05
57	600521	华海药业	3,600	66,276.00	0.05
58	002334	英威腾	5,200	66,248.00	0.05
59	002850	科达利	500	66,125.00	0.05
60	600352	浙江龙盛	6,800	63,580.00	0.04
61	688777	中控技术	950	59,641.00	0.04
62	600285	羚锐制药	3,400	54,604.00	0.04
63	603699	纽威股份	3,400	50,592.00	0.04
64	002061	浙江交科	11,280	50,308.80	0.04
65	002865	钧达股份	300	45,759.00	0.03
66	600072	中船科技	1,600	45,072.00	0.03
67	002373	千方科技	3,300	45,012.00	0.03
68	603056	德邦股份	2,900	44,718.00	0.03
69	601916	浙商银行	16,900	44,616.00	0.03
70	603156	养元饮品	1,800	44,460.00	0.03
71	002966	苏州银行	6,500	42,575.00	0.03
72	002847	盐津铺子	500	42,525.00	0.03
73	603298	杭叉集团	1,800	42,390.00	0.03
74	000801	四川九洲	5,800	42,340.00	0.03
75	300415	伊之密	2,200	42,240.00	0.03
76	688266	泽璟制药	900	41,895.00	0.03
77	603757	大元泵业	1,400	41,776.00	0.03
78	688050	爱博医疗	200	41,066.00	0.03
79	000811	冰轮环境	2,600	40,976.00	0.03
80	600312	平高电气	3,300	40,887.00	0.03
81	688568	中科星图	500	40,290.00	0.03
82	002011	盾安环境	2,900	40,107.00	0.03
83	000928	中钢国际	4,100	39,565.00	0.03
84	002051	中工国际	3,300	39,369.00	0.03
85	002036	联创电子	3,900	37,869.00	0.03

86	603619	中曼石油	2,200	37,224.00	0.03
87	601869	长飞光纤	1,000	37,010.00	0.03
88	300634	彩讯股份	1,400	36,960.00	0.03
89	300041	回天新材	3,100	36,580.00	0.03
90	000028	国药一致	820	35,760.20	0.02
91	300226	上海钢联	1,100	35,640.00	0.02
92	603983	丸美股份	1,100	35,585.00	0.02
93	600007	中国国贸	1,900	35,188.00	0.02
94	002560	通达股份	3,600	34,272.00	0.02
95	688588	凌志软件	2,200	34,210.00	0.02
96	688037	芯源微	200	34,190.00	0.02
97	002262	恩华药业	1,100	33,913.00	0.02
98	300229	拓尔思	1,300	33,761.00	0.02
99	688630	芯碁微装	400	33,608.00	0.02
100	603383	顶点软件	600	33,252.00	0.02
101	301205	联特科技	180	32,898.60	0.02
102	300145	中金环境	11,000	32,340.00	0.02
103	300206	理邦仪器	2,100	31,668.00	0.02
104	002057	中钢天源	2,900	30,450.00	0.02
105	688365	光云科技	2,100	30,282.00	0.02
106	301349	信德新材	600	30,084.00	0.02
107	301153	中科江南	400	29,984.00	0.02
108	600756	浪潮软件	1,800	29,916.00	0.02
109	002422	科伦药业	1,000	29,680.00	0.02
110	600066	宇通客车	2,000	29,480.00	0.02
111	688621	阳光诺和	500	29,410.00	0.02
112	603345	安井食品	200	29,360.00	0.02
113	002541	鸿路钢构	1,000	28,810.00	0.02
113	300900	广联航空	1,000	28,810.00	0.02
114	688425	铁建重工	5,960	28,667.60	0.02
115	600853	龙建股份	6,400	27,072.00	0.02
116	688169	石头科技	84	26,937.12	0.02
117	600765	中航重机	1,000	26,510.00	0.02
118	300705	九典制药	1,000	26,430.00	0.02
119	002987	京北方	1,200	26,304.00	0.02
120	603650	彤程新材	800	26,240.00	0.02
121	688551	科威尔	400	26,232.00	0.02
122	002885	京泉华	1,200	26,208.00	0.02
123	605168	三人行	290	24,922.60	0.02
124	603676	卫信康	1,800	24,876.00	0.02
125	605060	联德股份	900	24,714.00	0.02
126	603901	永创智能	1,600	23,296.00	0.02
127	600933	爱柯迪	1,000	23,290.00	0.02

128	002512	达华智能	5,800	23,258.00	0.02
129	600566	济川药业	800	23,232.00	0.02
130	688776	国光电气	280	23,206.40	0.02
131	601611	中国核建	2,700	22,815.00	0.02
132	600862	中航高科	900	22,779.00	0.02
133	688009	中国通号	3,900	22,620.00	0.02
134	603529	爱玛科技	700	22,554.00	0.02
135	603096	新经典	1,100	22,396.00	0.02
136	601958	金钼股份	2,000	22,300.00	0.02
137	600131	国网信通	1,100	22,209.00	0.02
138	688819	天能股份	600	22,104.00	0.02
139	000409	云鼎科技	2,200	21,978.00	0.02
140	300570	太辰光	400	21,884.00	0.02
141	688536	思瑞浦	100	21,800.00	0.02
142	002472	双环传动	600	21,780.00	0.02
143	600704	物产中大	4,400	21,736.00	0.02
144	603599	广信股份	800	21,664.00	0.02
145	002003	伟星股份	2,300	21,528.00	0.02
146	688123	聚辰股份	400	21,488.00	0.01
147	600906	财达证券	2,900	20,880.00	0.01
148	002557	洽洽食品	500	20,775.00	0.01
149	300575	中旗股份	2,000	20,760.00	0.01
150	600985	淮北矿业	1,800	20,736.00	0.01
151	000893	亚钾国际	900	20,646.00	0.01
152	600609	金杯汽车	3,900	20,514.00	0.01
153	000060	中金岭南	4,300	20,425.00	0.01
154	300148	天舟文化	3,700	20,424.00	0.01
155	300389	艾比森	1,000	20,370.00	0.01
156	601108	财通证券	2,800	20,272.00	0.01
157	600718	东软集团	1,900	20,254.00	0.01
158	688305	科德数控	200	20,052.00	0.01
159	002782	可立克	1,300	19,877.00	0.01
160	600060	海信视像	800	19,800.00	0.01
161	300012	华测检测	1,000	19,500.00	0.01
162	002852	道道全	1,500	19,395.00	0.01
163	603198	迎驾贡酒	300	19,140.00	0.01
164	300442	润泽科技	600	18,456.00	0.01
165	603662	柯力传感	500	18,400.00	0.01
166	300842	帝科股份	200	18,288.00	0.01
167	688097	博众精工	600	18,216.00	0.01
168	301051	信濠光电	300	18,147.00	0.01
169	688639	华恒生物	200	18,096.00	0.01
170	002258	利尔化学	1,400	18,074.00	0.01

171	300811	铂科新材	300	17,832.00	0.01
172	600211	西藏药业	300	17,820.00	0.01
173	002975	博杰股份	400	17,456.00	0.01
174	605016	百龙创园	700	17,332.00	0.01
175	300700	岱勒新材	900	17,145.00	0.01
176	603319	湘油泵	1,000	16,930.00	0.01
177	688569	铁科轨道	400	16,828.00	0.01
178	002623	亚玛顿	600	16,764.00	0.01
179	688246	嘉和美康	400	16,748.00	0.01
180	300795	米奥会展	400	16,684.00	0.01
181	300554	三超新材	800	16,664.00	0.01
182	300545	联得装备	600	16,662.00	0.01
183	002986	宇新股份	600	16,548.00	0.01
184	002351	漫步者	800	16,544.00	0.01
185	600380	健康元	1,300	16,523.00	0.01
186	300825	阿尔特	900	16,461.00	0.01
187	000821	京山轻机	800	16,368.00	0.01
188	300633	开立医疗	300	16,350.00	0.01
189	688793	倍轻松	300	16,170.00	0.01
190	600537	亿晶光电	2,100	16,044.00	0.01
191	002795	永和智控	1,800	15,948.00	0.01
192	688556	高测股份	300	15,942.00	0.01
193	000962	东方钨业	1,300	15,925.00	0.01
194	300143	盈康生命	1,400	15,876.00	0.01
195	605098	行动教育	400	15,836.00	0.01
196	688112	鼎阳科技	300	15,834.00	0.01
197	300382	斯莱克	1,200	15,828.00	0.01
198	603611	诺力股份	600	15,804.00	0.01
199	605598	上海港湾	300	15,798.00	0.01
200	603657	春光科技	900	15,795.00	0.01
201	002401	中远海科	600	15,792.00	0.01
202	300182	捷成股份	2,500	15,775.00	0.01
203	300856	科思股份	200	15,754.00	0.01
204	688410	山外山	300	15,750.00	0.01
205	603605	珀莱雅	140	15,736.00	0.01
206	002984	森麒麟	500	15,730.00	0.01
207	603279	景津装备	500	15,680.00	0.01
207	688028	沃尔德	700	15,680.00	0.01
208	300507	苏奥传感	2,400	15,648.00	0.01
209	603920	世运电路	800	15,624.00	0.01
210	002540	亚太科技	2,700	15,606.00	0.01
211	603979	金诚信	500	15,550.00	0.01
212	603035	常熟汽饰	800	15,544.00	0.01

212	603100	川仪股份	400	15,544.00	0.01
213	301004	嘉益股份	400	15,520.00	0.01
214	603551	奥普家居	1,200	15,516.00	0.01
215	688420	美腾科技	400	15,492.00	0.01
216	688480	赛恩斯	500	15,480.00	0.01
217	002116	中国海诚	1,200	15,336.00	0.01
218	002270	华明装备	1,400	15,330.00	0.01
219	688033	天宜上佳	800	15,296.00	0.01
220	300349	金卡智能	1,100	15,268.00	0.01
221	002284	亚太股份	1,700	15,249.00	0.01
222	605300	佳禾食品	700	15,218.00	0.01
223	301296	新巨丰	900	15,192.00	0.01
224	002062	宏润建设	2,800	15,148.00	0.01
225	603556	海兴电力	600	15,144.00	0.01
226	301339	通行宝	600	15,078.00	0.01
227	601702	华峰铝业	1,100	15,048.00	0.01
228	002536	飞龙股份	1,000	15,000.00	0.01
229	300978	东箭科技	1,100	14,993.00	0.01
230	000552	甘肃能化	4,500	14,985.00	0.01
231	002563	森马服饰	2,400	14,928.00	0.01
232	603811	诚意药业	1,200	14,916.00	0.01
233	002997	瑞鹄模具	500	14,865.00	0.01
234	605186	健麾信息	300	14,850.00	0.01
235	002917	金奥博	1,200	14,832.00	0.01
236	301087	可孚医疗	300	14,790.00	0.01
237	002014	永新股份	1,700	14,756.00	0.01
238	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.01
239	002990	盛视科技	400	14,720.00	0.01
240	300510	金冠股份	2,100	14,658.00	0.01
241	688102	斯瑞新材	1,200	14,640.00	0.01
242	000913	钱江摩托	800	14,584.00	0.01
243	002276	万马股份	1,200	14,532.00	0.01
244	002376	新北洋	1,800	14,526.00	0.01
245	300791	仙乐健康	500	14,520.00	0.01
245	605167	利柏特	1,500	14,520.00	0.01
246	002275	桂林三金	800	14,408.00	0.01
247	002454	松芝股份	1,700	14,399.00	0.01
248	300532	今天国际	700	14,392.00	0.01
249	603307	扬州金泉	300	14,352.00	0.01
250	603098	森特股份	700	14,350.00	0.01
251	300360	炬华科技	800	14,304.00	0.01
252	300005	探路者	1,700	14,280.00	0.01
252	688609	九联科技	1,200	14,280.00	0.01

253	603628	清源股份	900	14,247.00	0.01
254	688076	诺泰生物	400	14,232.00	0.01
255	603515	欧普照明	700	14,210.00	0.01
256	000426	兴业银锡	1,600	14,208.00	0.01
257	603208	江山欧派	390	14,203.80	0.01
258	002832	比音勒芬	400	14,164.00	0.01
259	300622	博士眼镜	600	14,160.00	0.01
260	603093	南华期货	1,300	14,157.00	0.01
261	002033	丽江股份	1,300	14,144.00	0.01
262	002956	西麦食品	900	14,067.00	0.01
263	301266	宇邦新材	200	14,062.00	0.01
264	301011	华立科技	600	14,058.00	0.01
265	300853	申昊科技	400	14,040.00	0.01
266	002609	捷顺科技	1,200	13,992.00	0.01
267	002976	瑞玛精密	500	13,985.00	0.01
268	000403	派林生物	700	13,972.00	0.01
269	603690	至纯科技	400	13,936.00	0.01
270	002973	侨银股份	1,200	13,920.00	0.01
270	600861	北京人力	600	13,920.00	0.01
271	688192	迪哲医药	400	13,880.00	0.01
272	603998	方盛制药	1,100	13,871.00	0.01
273	300470	中密控股	300	13,866.00	0.01
274	301116	益客食品	900	13,860.00	0.01
274	600728	佳都科技	2,000	13,860.00	0.01
275	003006	百亚股份	800	13,824.00	0.01
276	300284	苏交科	2,300	13,800.00	0.01
277	002895	川恒股份	700	13,790.00	0.01
278	002858	力盛体育	600	13,764.00	0.01
279	600138	中青旅	1,100	13,761.00	0.01
280	002544	普天科技	600	13,740.00	0.01
281	601003	柳钢股份	3,400	13,736.00	0.01
282	002728	特一药业	900	13,725.00	0.01
283	300926	博俊科技	600	13,704.00	0.01
284	688041	海光信息	200	13,654.00	0.01
285	000688	国城矿业	900	13,653.00	0.01
286	603518	锦泓集团	1,200	13,620.00	0.01
287	300592	华凯易佰	500	13,610.00	0.01
288	300908	仲景食品	300	13,605.00	0.01
289	601528	瑞丰银行	2,800	13,580.00	0.01
290	301031	中熔电气	100	13,571.00	0.01
291	603222	济民医疗	1,300	13,559.00	0.01
292	000555	神州信息	1,100	13,530.00	0.01
293	000065	北方国际	900	13,518.00	0.01

294	300087	荃银高科	1,300	13,442.00	0.01
295	600817	宇通重工	1,200	13,428.00	0.01
296	688258	卓易信息	200	13,346.00	0.01
297	002582	好想你	1,700	13,277.00	0.01
298	300738	奥飞数据	1,300	13,260.00	0.01
298	603912	佳力图	1,300	13,260.00	0.01
299	301045	天禄科技	500	13,240.00	0.01
300	300881	盛德鑫泰	400	13,180.00	0.01
301	000032	深桑达 A	400	13,160.00	0.01
302	600212	绿能慧充	1,400	13,132.00	0.01
303	603018	华设集团	1,500	13,125.00	0.01
304	603396	金辰股份	200	13,120.00	0.01
305	003032	传智教育	900	13,113.00	0.01
306	300587	天铁股份	1,700	13,090.00	0.01
307	300845	捷安高科	600	13,038.00	0.01
308	603136	天目湖	500	12,900.00	0.01
309	002045	国光电器	800	12,848.00	0.01
310	600054	黄山旅游	1,000	12,800.00	0.01
311	002970	锐明技术	400	12,596.00	0.01
312	301103	何氏眼科	300	12,588.00	0.01
313	300863	卡倍亿	200	12,582.00	0.01
314	002558	巨人网络	700	12,551.00	0.01
315	688322	奥比中光	300	12,516.00	0.01
316	002878	元隆雅图	700	12,418.00	0.01
317	300166	东方国信	1,100	12,364.00	0.01
318	300830	金现代	1,300	12,350.00	0.01
319	688488	艾迪药业	1,000	12,320.00	0.01
320	603711	香飘飘	600	12,318.00	0.01
321	301269	华大九天	100	12,284.00	0.01
322	688337	普源精电	200	12,052.00	0.01
323	600129	太极集团	200	11,898.00	0.01
324	300491	通合科技	400	11,480.00	0.01
325	301322	绿通科技	200	11,230.00	0.01
326	003020	立方制药	300	11,103.00	0.01
327	600415	小商品城	1,300	11,089.00	0.01
328	300833	浩洋股份	100	10,943.00	0.01
329	300779	惠城环保	200	10,658.00	0.01
330	301052	果麦文化	200	9,864.00	0.01
331	688472	阿特斯	550	9,372.00	0.01
332	002439	启明星辰	300	8,928.00	0.01
333	300813	泰林生物	300	8,571.00	0.01
334	603927	中科软	200	7,712.00	0.01
335	603218	日月股份	400	7,596.00	0.01

336	000997	新大陆	400	7,560.00	0.01
337	603939	益丰药房	200	7,400.00	0.01
338	002244	滨江集团	800	7,056.00	0.00
339	688576	西山科技	52	6,261.32	0.00
340	688458	美芯晟	57	5,173.32	0.00
341	688443	智翔金泰	174	5,131.26	0.00
342	688535	华海诚科	99	5,071.77	0.00
343	002508	老板电器	200	5,058.00	0.00
344	688593	新相微	326	4,756.34	0.00
345	688631	莱斯信息	130	3,883.10	0.00
346	601928	凤凰传媒	300	3,420.00	0.00
347	688512	慧智微	173	3,314.68	0.00
348	601133	柏诚股份	148	1,814.48	0.00
349	601089	福元医药	100	1,630.00	0.00
350	600004	白云机场	100	1,434.00	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	300750	宁德时代	10,396,071.20	8.44
2	600519	贵州茅台	8,430,478.40	6.85
3	601318	中国平安	8,311,313.49	6.75
4	002475	立讯精密	5,614,376.00	4.56
5	688599	天合光能	5,035,027.62	4.09
6	002129	TCL 中环	4,427,867.00	3.60
7	000333	美的集团	4,409,735.00	3.58
8	600438	通威股份	4,237,374.24	3.44
9	000425	徐工机械	4,187,655.00	3.40
10	000858	五粮液	4,013,548.00	3.26
11	002142	宁波银行	3,997,803.00	3.25
12	000651	格力电器	3,944,163.00	3.20
13	002841	视源股份	3,880,064.00	3.15
14	603369	今世缘	3,817,705.00	3.10
15	601006	大秦铁路	3,801,361.00	3.09
16	002714	牧原股份	3,728,462.00	3.03
17	000895	双汇发展	3,708,680.00	3.01
18	600660	福耀玻璃	3,702,454.00	3.01
19	000733	振华科技	3,681,519.00	2.99
20	000338	潍柴动力	3,678,854.00	2.99
21	000063	中兴通讯	3,674,525.00	2.98
22	002236	大华股份	3,663,742.00	2.98

23	601668	中国建筑	3,639,563.00	2.96
24	000002	万科 A	3,628,809.00	2.95
25	601601	中国太保	3,625,065.00	2.94
26	002459	晶澳科技	3,567,738.40	2.90
27	600600	青岛啤酒	3,559,298.00	2.89
28	600809	山西汾酒	3,467,693.00	2.82
29	600919	江苏银行	3,384,943.00	2.75
30	601658	邮储银行	3,381,252.00	2.75
31	600803	新奥股份	3,351,523.00	2.72
32	300122	智飞生物	3,316,911.00	2.69
33	601888	中国中免	3,307,020.00	2.69
34	600999	招商证券	3,296,708.60	2.68
35	002460	赣锋锂业	3,273,789.40	2.66
36	601818	光大银行	3,262,888.00	2.65
37	601985	中国核电	3,253,741.00	2.64
38	600845	宝信软件	3,236,723.80	2.63
39	300274	阳光电源	3,210,795.00	2.61
40	002594	比亚迪	3,182,757.00	2.59
41	002600	领益智造	3,160,175.00	2.57
42	600690	海尔智家	3,157,133.00	2.56
43	600926	杭州银行	3,151,991.00	2.56
44	002179	中航光电	3,128,662.80	2.54
45	601939	建设银行	3,124,160.00	2.54
46	002304	洋河股份	3,066,114.00	2.49
47	600674	川投能源	3,046,503.00	2.47
48	000725	京东方 A	3,033,265.00	2.46
49	601766	中国中车	3,016,593.90	2.45
50	300498	温氏股份	3,013,360.00	2.45
51	600795	国电电力	2,962,173.00	2.41
52	600309	万华化学	2,958,260.00	2.40
53	603882	金域医学	2,957,630.00	2.40
54	300999	金龙鱼	2,923,284.00	2.37
55	300760	迈瑞医疗	2,892,875.00	2.35
56	601117	中国化学	2,887,894.00	2.35
57	601211	国泰君安	2,886,625.00	2.34
58	600048	保利发展	2,858,226.00	2.32
59	601319	中国人保	2,852,675.49	2.32
60	002938	鹏鼎控股	2,793,932.00	2.27
61	300207	欣旺达	2,785,508.00	2.26
62	002049	紫光国微	2,782,591.00	2.26
63	600036	招商银行	2,772,233.00	2.25
64	600016	民生银行	2,751,722.00	2.24
65	600760	中航沈飞	2,751,552.60	2.24

66	601857	中国石油	2,750,281.00	2.23
67	601838	成都银行	2,747,435.00	2.23
68	300316	晶盛机电	2,713,437.00	2.20
69	601877	正泰电器	2,696,915.99	2.19
70	600383	金地集团	2,683,043.00	2.18
71	002466	天齐锂业	2,674,544.56	2.17
72	002311	海大集团	2,638,169.00	2.14
73	600089	特变电工	2,634,677.00	2.14
74	000596	古井贡酒	2,630,043.00	2.14
75	001979	招商蛇口	2,622,681.00	2.13
76	002032	苏泊尔	2,616,125.00	2.13
77	600887	伊利股份	2,598,960.00	2.11
78	000001	平安银行	2,594,200.00	2.11
79	600741	华域汽车	2,588,399.00	2.10
80	600941	中国移动	2,574,982.00	2.09
81	600019	宝钢股份	2,572,575.00	2.09
82	002736	国信证券	2,544,862.93	2.07
83	000938	紫光股份	2,496,518.00	2.03
84	002709	天赐材料	2,490,731.00	2.02
85	601138	工业富联	2,462,966.00	2.00

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	300750	宁德时代	11,676,010.20	9.48
2	600519	贵州茅台	9,405,372.92	7.64
3	601318	中国平安	6,159,753.00	5.00
4	002475	立讯精密	6,105,601.00	4.96
5	000425	徐工机械	4,853,380.00	3.94
6	002594	比亚迪	4,491,596.00	3.65
7	600809	山西汾酒	4,478,199.36	3.64
8	600036	招商银行	4,200,113.00	3.41
9	600795	国电电力	4,184,884.00	3.40
10	000568	泸州老窖	3,973,700.21	3.23
11	002714	牧原股份	3,973,491.00	3.23
12	000858	五粮液	3,931,183.00	3.19
13	601838	成都银行	3,869,534.00	3.14
14	600660	福耀玻璃	3,783,456.00	3.07
15	002841	视源股份	3,767,809.00	3.06
16	000063	中兴通讯	3,725,070.00	3.03

17	600926	杭州银行	3,674,641.00	2.99
18	600438	通威股份	3,661,640.00	2.97
19	600674	川投能源	3,658,377.00	2.97
20	688981	中芯国际	3,612,339.58	2.93
21	600383	金地集团	3,609,929.00	2.93
22	002304	洋河股份	3,603,445.44	2.93
23	000651	格力电器	3,529,578.00	2.87
24	601766	中国中车	3,509,306.40	2.85
25	002142	宁波银行	3,504,278.70	2.85
26	601601	中国太保	3,463,936.00	2.81
27	300498	温氏股份	3,405,067.00	2.77
28	601166	兴业银行	3,397,602.00	2.76
29	300760	迈瑞医疗	3,387,291.00	2.75
30	603185	弘元绿能	3,363,540.40	2.73
31	601888	中国中免	3,358,604.00	2.73
32	600048	保利发展	3,295,576.00	2.68
33	600276	恒瑞医药	3,250,144.80	2.64
34	600999	招商证券	3,226,061.00	2.62
35	601988	中国银行	3,210,150.00	2.61
36	601818	光大银行	3,206,182.00	2.60
37	000725	京东方 A	3,179,355.00	2.58
38	600887	伊利股份	3,138,071.00	2.55
39	601138	工业富联	3,091,173.00	2.51
40	603019	中科曙光	3,086,603.00	2.51
41	000002	万 科 A	3,049,189.00	2.48
42	601658	邮储银行	3,043,768.00	2.47
43	600741	华域汽车	3,021,757.00	2.45
44	002460	赣锋锂业	3,013,613.00	2.45
45	603882	金域医学	2,945,957.00	2.39
46	601009	南京银行	2,934,351.00	2.38
47	600919	江苏银行	2,930,701.00	2.38
48	002129	TCL 中环	2,900,955.00	2.36
49	002371	北方华创	2,867,463.00	2.33
50	601186	中国铁建	2,846,531.00	2.31
51	600309	万华化学	2,830,132.00	2.30
52	001979	招商蛇口	2,826,744.00	2.30
53	600690	海尔智家	2,826,592.00	2.30
54	002311	海大集团	2,807,467.00	2.28
55	300274	阳光电源	2,801,023.00	2.28
56	002352	顺丰控股	2,747,248.00	2.23
57	601117	中国化学	2,732,645.92	2.22
58	002459	晶澳科技	2,724,989.00	2.21
59	000895	双汇发展	2,707,845.00	2.20

60	600760	中航沈飞	2,703,899.00	2.20
61	000333	美的集团	2,685,169.50	2.18
62	600600	青岛啤酒	2,683,678.00	2.18
63	601088	中国神华	2,659,814.00	2.16
64	600028	中国石化	2,650,300.00	2.15
65	002938	鹏鼎控股	2,643,305.00	2.15
66	300207	欣旺达	2,636,004.00	2.14
67	002179	中航光电	2,610,457.94	2.12
68	002466	天齐锂业	2,577,603.00	2.09
69	603986	兆易创新	2,563,934.04	2.08
70	600837	海通证券	2,561,143.00	2.08
71	688599	天合光能	2,555,470.88	2.08
72	601100	恒立液压	2,547,220.00	2.07
73	002032	苏泊尔	2,527,836.00	2.05
74	601669	中国电建	2,525,277.00	2.05
75	601390	中国中铁	2,512,844.00	2.04
76	300450	先导智能	2,502,675.00	2.03
77	600176	中国巨石	2,493,476.86	2.03
78	601668	中国建筑	2,493,268.00	2.03
79	600019	宝钢股份	2,484,857.00	2.02
80	600030	中信证券	2,472,188.00	2.01

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	670,462,242.96
卖出股票收入（成交）总额	655,692,987.96

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	6,572,751.92	4.59
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）	61,864.41	0.04

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,634,616.33	4.63

## 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	019688	22 国债 23	65,000	6,572,751.92	4.59
2	118031	天 23 转债	550	61,864.41	0.04

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，以控制并调整投资组合风险、提高投资的资金效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

## 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除中国平安（代码：601318 SH）、大秦铁路（代码：601006 SH）、招商银行（代码：600036 SH）、宁德时代（代码：300750 SZ）外其他证券的发行主体未有

被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 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。

2. 大秦铁路股份有限公司

2022 年 7 月-11 月，大秦铁路股份有限公司因未依法履行职责多次被西安铁路监督管理局罚款、通知整改。

3. 招商银行股份有限公司

2022 年 11 月 4 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2022 年 12 月 30 日，招商银行股份有限公司因违反反洗钱法、违规经营被中国人民银行警告、罚款、没收违法所得。

2023 年 1 月 18 日，招商银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则被中国银行间市场交易商协会警告。

4. 宁德时代新能源科技股份有限公司

2023 年 2 月 25 日，宁德时代新能源科技股份有限公司因提供虚假资料证明文件被中国市场监督管理总局宁德市分局列入经营异常名录。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	613,303.80
2	应收清算款	1,567.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,676.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	711,547.95

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信量化沪深 300 增强 A	6,360	4,460.09	1,384.62	0.00	28,364,781.46	100.00
安信量化沪深 300 增强 C	4,974	14,345.44	34,204,158.00	47.94	37,150,072.44	52.06
合计	11,164	8,932.32	34,205,542.62	34.30	65,514,853.90	65.70

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	安信量化沪深 300 增强 A	94,408.16	0.33
	安信量化沪深 300 增强 C	60,164.03	0.08

	合计	154,572.19	0.16
--	----	------------	------

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	安信量化沪深 300 增强 A	0~10
	安信量化沪深 300 增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化沪深 300 增强 A	0~10
	安信量化沪深 300 增强 C	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 7 日）基金份额总额	586,304.23	60,774,551.77
本报告期期初基金份额总额	28,176,581.11	57,581,401.15
本报告期基金总申购份额	6,194,418.63	19,501,285.03
减：本报告期基金总赎回份额	6,004,833.66	5,728,455.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,366,166.08	71,354,230.44

## § 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

本基金的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未受到相关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 (%)	
广发证券	2	529,547,168.09	39.96	381,961.08	39.96	-
开源证券	1	367,215,770.69	27.71	264,873.03	27.71	-
申万宏源	2	245,123,717.32	18.50	176,808.25	18.50	-
华泰证券	1	183,457,370.42	13.84	132,328.25	13.84	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)
广发证券	701,071.00	9.75	19,700,000.00	10.34	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	6,486,155.00	90.25	61,100,000.00	32.06	-	-
华泰证券	-	-	109,800,000.00	57.61	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下	中国证券报、证券日报、	2023-03-30

	基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报、上海证券报	
3	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
4	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
5	安信基金管理有限责任公司关于调整适用养老金客户费率优惠的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2023-05-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230209;20230301-20230630	20,918,313.98	-	-	20,918,313.98	20.98

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件；

- 2、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 29 日