

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
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	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
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	62
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
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
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	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
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	708,728,911.35 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	213,400,705.39 份	495,328,205.96 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。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。

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 姓名	王卫峰	郭明

负责人	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	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	廖林

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	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 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	9,635,910.17	18,370,654.70
本期利润	15,674,378.42	32,189,622.12
加权平均基金份额本期利润	0.1420	0.1898
本期加权平均净值利润率	8.62%	11.70%
本期基金份额净值增长率	8.40%	8.29%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利润	93,241,987.46	200,819,957.60
期末可供分配基金份额利润	0.4369	0.4054
期末基金资产净值	368,094,089.69	837,096,905.69
期末基金份额净值	1.7249	1.6900
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	63.36%	61.35%

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	4.51%	0.63%	2.25%	0.52%	2.26%	0.11%
过去三个月	5.91%	1.23%	1.17%	0.99%	4.74%	0.24%
过去六个月	8.40%	1.13%	0.10%	0.92%	8.30%	0.21%
过去一年	27.30%	1.32%	12.53%	1.25%	14.77%	0.07%
过去三年	3.62%	1.05%	-10.64%	0.99%	14.26%	0.06%
自基金转型起至今	63.36%	1.15%	7.38%	1.07%	55.98%	0.08%

安信量化沪深 300 增强 C

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

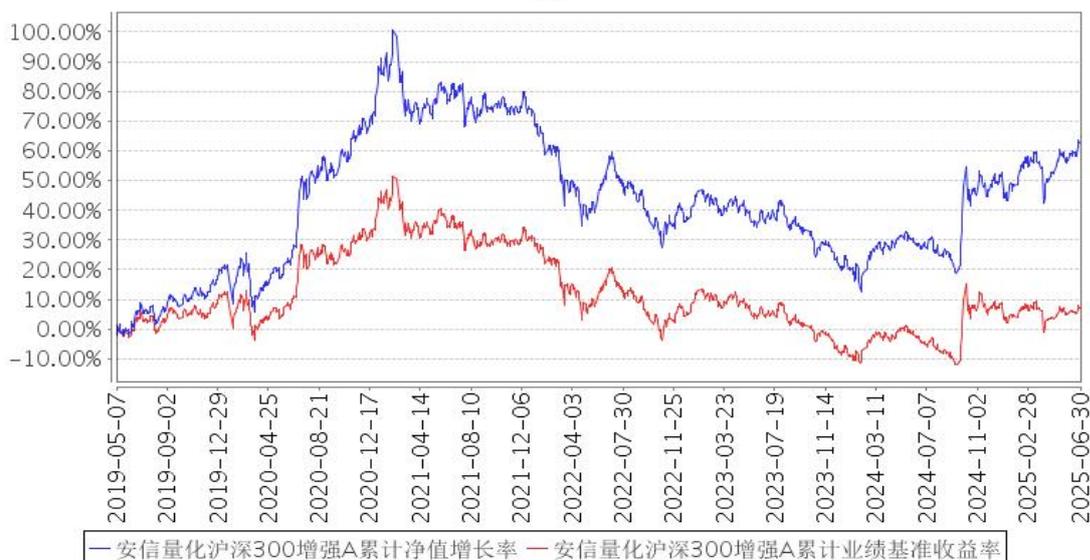
	率①	准差②		④		
过去一个月	4.50%	0.62%	2.25%	0.52%	2.25%	0.10%
过去三个月	5.85%	1.23%	1.17%	0.99%	4.68%	0.24%
过去六个月	8.29%	1.13%	0.10%	0.92%	8.19%	0.21%
过去一年	27.05%	1.32%	12.53%	1.25%	14.52%	0.07%
过去三年	3.00%	1.05%	-10.64%	0.99%	13.64%	0.06%
自基金转型起至今	61.35%	1.15%	7.38%	1.07%	53.97%	0.08%

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。

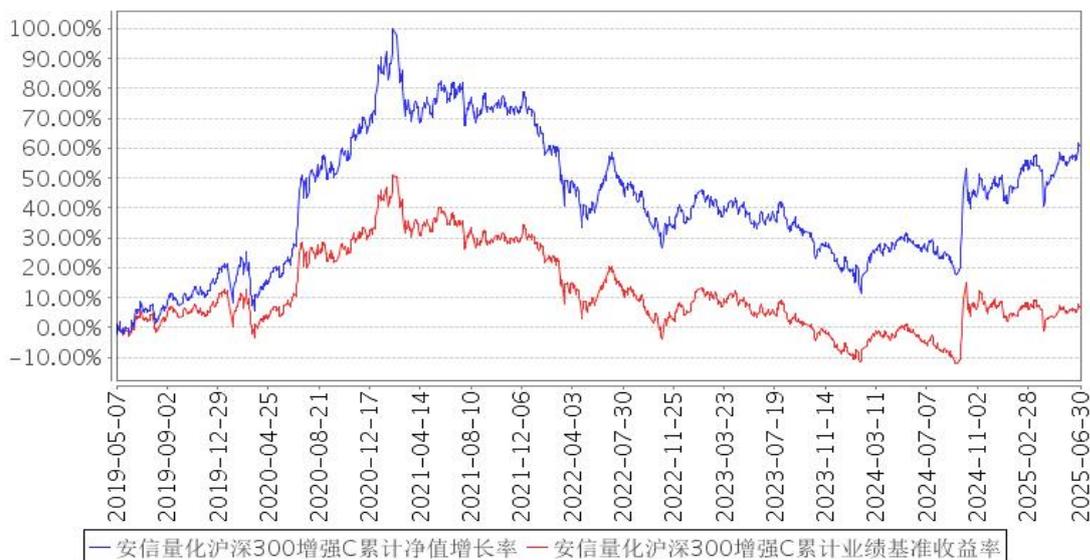
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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，国投证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 99 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）、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券

投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金、安信远见稳进一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金、安信医药创新股票型发起式证券投资基金、安信周期优选股票型发起式证券投资基金、安信均衡增长混合型证券投资基金、安信中证 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、安信锦顺利率债债券型证券投资基金、安信优选价值混合型证券投资基金、安信价值共赢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		
施荣盛	本基金的基金经理，量化投资部总经理助理	2023 年 8 月 24 日	-	12 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理、基金经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理助理。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金、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 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

从量化投资风格因子层面看，2025 年上半年，贝塔、市值、流动性、动量等因子表现较好，价值、盈利等因子表现不佳。从行业层面看，银行、有色金属、国防军工、通信、汽车等行业表现较好，房地产、煤炭、环保、建筑装饰、社会服务等行业表现不佳。

2025 年上半年，国际层面，美国主导的“对等关税”政策持续发力，钢铁、汽车、半导体等关键行业贸易摩擦显著升级，拖累全球贸易增长。金融市场层面，美联储降息前景受制于顽固通胀数据摇摆不定，市场对“滞胀”风险的忧虑显著加深。叠加复杂严峻的地缘政治局势反复扰动，全球供应链稳定性持续承压，国际市场复杂性提升。国内层面，经济展现较强韧性与政策实效，面对复杂严峻的外部环境，中国经济在上半年延续了回升向好的基本态势，宏观政策协同效应显现。以科技自主化、新消费崛起、高端制造业突围为标志的内生动力，构成了上半年国内经济的亮点。尽管外部贸易壁垒持续抑制出口增速，且整体经济预期依然偏弱，但积极的政策托底效果显现。

本基金作为指数增强型基金，坚持宽基选股，淡化择时，以数量化分析为基础，多维度选股，

行业分散，覆盖 A 股多板块优质股票。本基金主要采用以“大数据+AI 算法”为基础的量化投资方法，基于对股票市场和上市公司相关数据进行深度挖掘，通过决策树、神经网络等机器学习和深度学习模型预测个股收益率，再采用组合优化和风险管理模型控制本基金和基准的跟踪误差和最大回撤。力争在控制跟踪误差的基础上，获取超越基准的收益。

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 1.7249 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.40%；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.6900 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.29%；同期业绩比较基准收益率为 0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，中国经济有望延续稳中向好态势，政策端或将继续发力扩内需、促转型，但需警惕外部环境的不确定性，尤其是贸易摩擦及地缘政治对供应链的潜在扰动。预计下半年证券市场或延续结构性震荡上行走势，风格上科技成长与高股息资产仍是主线，需把握“政策+产业趋势”双轮驱动，在科技自主化与消费升级中挖掘结构性机会，同时以高股息资产平衡风险。此外，市场风格切换显著加快，要求投资者必须保持高度灵活性，精准捕捉产业链条中的结构性机会。

量化投资的风格因子层面，2025 年下半年核心矛盾是经济磨底期的防御需求与产业跃迁期的进攻机遇之间的平衡，应注重防御与成长均衡，同时警惕拥挤风险，核心机会聚焦于质量、波动率，以及成长等因子，并关注小市值因子的拥挤风险与政策扰动影响。

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 2025 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	164,519,733.33	6,185,813.77
结算备付金		7,758,432.01	520,346.08
存出保证金		200,026.99	22,479.48
交易性金融资产	6.4.7.2	1,193,376,393.28	99,694,244.91
其中：股票投资		1,137,899,069.61	99,694,244.91
基金投资		-	-
债券投资		55,477,323.67	-
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	-	-
应收清算款		-	738,484.82
应收股利		-	-
应收申购款		10,509,460.88	817,954.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,376,364,046.49	107,979,323.51
负债和净资产			
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		13,000,000.00	-
应付清算款		144,904,420.32	1,085,057.42
应付赎回款		11,803,661.20	151,946.68
应付管理人报酬		647,886.78	69,334.54
应付托管费		80,985.86	8,666.83
应付销售服务费		109,903.70	9,455.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	626,193.25	206,621.32
负债合计		171,173,051.11	1,531,082.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	708,728,911.35	67,613,574.10
未分配利润	6.4.7.8	496,462,084.03	38,834,667.26
净资产合计		1,205,190,995.38	106,448,241.36
负债和净资产总计		1,376,364,046.49	107,979,323.51

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 708,728,911.35 份，其中安信量化沪深 300 增强 A 基金份额总额 213,400,705.39 份，基金份额净值 1.7249 元；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额总额 495,328,205.96 份，基金份额净值 1.6900 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		50,292,166.85	3,179,636.41
1. 利息收入		42,771.16	13,998.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,771.16	13,998.45
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		29,988,446.71	-2,067,727.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	19,939,626.48	-2,869,732.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	140,328.92	22,814.89
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	192,391.14	-
股利收益	6.4.7.15	9,716,100.17	779,189.21
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	19,857,435.67	5,228,777.80
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	403,513.31	4,588.13
减：二、营业总支出		2,428,166.31	664,917.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,775,104.39	367,581.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	221,887.99	45,947.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	267,118.04	54,802.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		48,974.85	4,817.11
其中：卖出回购金融资产支出		48,974.85	4,817.11
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		774.24	-
8. 其他费用	6.4.7.19	114,306.80	191,767.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		47,864,000.54	2,514,719.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		47,864,000.54	2,514,719.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		47,864,000.54	2,514,719.30

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	67,613,574.10	-	38,834,667.26	106,448,241.36
二、本期期初净资产	67,613,574.10	-	38,834,667.26	106,448,241.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	641,115,337.25	-	457,627,416.77	1,098,742,754.02
(一)、综合收益	-	-	47,864,000.54	47,864,000.54

总额				
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	641,115,337.25	-	409,763,416.23	1,050,878,753.48
其中:1.基金申购款	768,744,435.84	-	490,163,209.93	1,258,907,645.77
2.基金赎回款	-127,629,098.59	-	-80,399,793.70	-208,028,892.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	708,728,911.35	-	496,462,084.03	1,205,190,995.38
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	100,854,893.76	-	30,132,592.05	130,987,485.81
二、本期期初净资产	100,854,893.76	-	30,132,592.05	130,987,485.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-42,554,459.72	-	-10,205,749.45	-52,760,209.17
(一)、综合收益总额	-	-	2,514,719.30	2,514,719.30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-42,554,459.72	-	-12,720,468.75	-55,274,928.47
其中:1.基金申购款	4,725,954.27	-	1,437,286.96	6,163,241.23
2.基金赎回款	-47,280,413.99	-	-14,157,755.71	-61,438,169.70
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	58,300,434.04	-	19,926,842.60	78,227,276.64

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：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>苗杨</u>
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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况。

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) 增值税及附加

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

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

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

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

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

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

(2) 企业所得税

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

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

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
活期存款	164,519,733.33
等于：本金	164,516,307.36
加：应计利息	3,425.97
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	164,519,733.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,115,274,973.23	-	1,137,899,069.61	22,624,096.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	55,017,310.00	454,133.67	55,477,323.67	5,880.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	55,017,310.00	454,133.67	55,477,323.67	5,880.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,170,292,283.23	454,133.67	1,193,376,393.28	22,629,976.38	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本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

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	797.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	555,971.89
其中：交易所市场	555,971.89
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	9,916.99
合计	626,193.25

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,394,415.22	30,394,415.22
本期申购	204,966,675.26	204,966,675.26
本期赎回（以“-”号填列）	-21,960,385.09	-21,960,385.09
本期末	213,400,705.39	213,400,705.39

安信量化沪深 300 增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,219,158.88	37,219,158.88
本期申购	563,777,760.58	563,777,760.58
本期赎回（以“-”号填列）	-105,668,713.50	-105,668,713.50
本期末	495,328,205.96	495,328,205.96

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

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	10,098,801.45	7,872,245.30	17,971,046.75
本期期初	10,098,801.45	7,872,245.30	17,971,046.75
本期利润	9,635,910.17	6,038,468.25	15,674,378.42
本期基金份额交易产生的变动数	73,507,275.84	47,540,683.29	121,047,959.13
其中：基金申购款	82,290,942.38	52,919,947.11	135,210,889.49
基金赎回款	-8,783,666.54	-5,379,263.82	-14,162,930.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,241,987.46	61,451,396.84	154,693,384.30

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	11,328,055.46	9,535,565.05	20,863,620.51
本期期初	11,328,055.46	9,535,565.05	20,863,620.51
本期利润	18,370,654.70	13,818,967.42	32,189,622.12
本期基金份额交易产生的变动数	171,121,247.44	117,594,209.66	288,715,457.10
其中：基金申购款	211,250,563.70	143,701,756.74	354,952,320.44
基金赎回款	-40,129,316.26	-26,107,547.08	-66,236,863.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,819,957.60	140,948,742.13	341,768,699.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,722.33
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	10,718.73
其他	3,330.10
合计	42,771.16

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,372,413,834.89
减：卖出股票成本总额	1,350,816,033.07
减：交易费用	1,658,175.34
买卖股票差价收入	19,939,626.48

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	144,834.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,505.12
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	140,328.92

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,166,498.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,030,766.90
减：应计利息总额	140,235.78
减：交易费用	1.12
买卖债券差价收入	-4,505.12

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	192,391.14

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,716,100.17
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	9,716,100.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,857,435.67
股票投资	19,851,555.67
债券投资	5,880.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	19,857,435.67

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	402,535.60
基金转换费收入	977.71
合计	403,513.31

6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	993.20
指数使用费	43,889.24
合计	114,306.80

6.4.7.20 分部报告

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

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
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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（%）
国投证券	-	-	30,720,877.82	3.53

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国投证券	22,607.82	3.49	22,607.82	8.86

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协商约定，并扣除由交易所或登记结算公司收取的相关费用后的净额列示。

(2) 被动股票型基金佣金协议的服务范围仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务，其他类型基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的研究服务及证券交易服务。

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,775,104.39
其中：应支付销售机构的客户维护 费	350,152.62	98,060.14
应支付基金管理人的净管理费	1,424,951.77	269,521.64

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
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	221,887.99	45,947.66

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	128,779.77	128,779.77
国投证券	-	73.26	73.26
合计	-	128,853.03	128,853.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	29,921.58	29,921.58
国投证券	-	54.33	54.33
合计	-	29,975.91	29,975.91

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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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均未投资本基金。

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	164,519,733.33	28,722.33	4,534,983.47

注：本基金的活期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

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025年3月	6个月	新股锁定	20.60	35.08	53	1,091.80	1,859.24	-

		4 日								
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

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

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 13,000,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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同责任，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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2024 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	47,135,407.36	-
合计	47,135,407.36	-

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-

AAA 以下	-	-
未评级	8,341,916.31	-
合计	8,341,916.31	-

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。

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。利率敏感性金融工具的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	164,519,733.33	-	-	-	164,519,733.33
结算备付金	7,758,432.01	-	-	-	7,758,432.01
存出保证金	200,026.99	-	-	-	200,026.99
交易性金融资产	55,477,323.67	-	-	1,137,899,069.61	1,193,376,393.28
应收申购款	-	-	-	10,509,460.88	10,509,460.88
资产总计	227,955,516.00	-	-	1,148,408,530.49	1,376,364,046.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,803,661.20	11,803,661.20
应付管理人报酬	-	-	-	647,886.78	647,886.78
应付托管费	-	-	-	80,985.86	80,985.86
应付清算款	-	-	-	144,904,420.32	144,904,420.32
卖出回购金融资产款	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	109,903.70	109,903.70
其他负债	-	-	-	626,193.25	626,193.25
负债总计	13,000,000.00	-	-	158,173,051.11	171,173,051.11
利率敏感度缺口	214,955,516.00	-	-	-990,235,479.38	1,205,190,995.38
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,185,813.77	-	-	-	6,185,813.77
结算备付金	520,346.08	-	-	-	520,346.08
存出保证金	22,479.48	-	-	-	22,479.48
交易性金融资产	-	-	-	99,694,244.91	99,694,244.91
应收申购款	-	-	-	817,954.45	817,954.45
应收清算款	-	-	-	738,484.82	738,484.82
资产总计	6,728,639.33	-	-	101,250,684.18	107,979,323.51
负债					

应付赎回款	-	-	-	151,946.68	151,946.68
应付管理人报酬	-	-	-	69,334.54	69,334.54
应付托管费	-	-	-	8,666.83	8,666.83
应付清算款	-	-	-	1,085,057.42	1,085,057.42
应付销售服务费	-	-	-	9,455.36	9,455.36
其他负债	-	-	-	206,621.32	206,621.32
负债总计	-	-	-	1,531,082.15	1,531,082.15
利率敏感度缺口	6,728,639.33	-	-	99,719,602.03	106,448,241.36

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）	
分析		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
1. 市场利率下降25个基点	60,872.80	-	
2. 市场利率上升25个基点	-60,688.54	-	

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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	1,137,899,069.61	94.42	99,694,244.91	93.66
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	1,137,899,069.61	94.42	99,694,244.91	93.66

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	56,120,513.77	4,366,496.25
2. 沪深 300 指数下降 5%	-56,120,513.77	-4,366,496.25	

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,137,804,486.81	99,692,022.64
第二层次	55,477,323.67	-
第三层次	94,582.80	2,222.27
合计	1,193,376,393.28	99,694,244.91

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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	1,137,899,069.61	82.67
	其中：股票	1,137,899,069.61	82.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,477,323.67	4.03
	其中：债券	55,477,323.67	4.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	172,278,165.34	12.52
8	其他各项资产	10,709,487.87	0.78
9	合计	1,376,364,046.49	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	-	-
B	采矿业	50,852,640.00	4.22
C	制造业	476,947,269.58	39.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,345,231.00	1.69
E	建筑业	37,891,058.00	3.14
F	批发和零售业	6,845,100.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	25,561,401.00	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,373,708.90	5.51
J	金融业	311,311,290.00	25.83
K	房地产业	2,059,196.00	0.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	22,256,504.00	1.85
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	8,875,776.00	0.74
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,029,319,174.48	85.41

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	93,958,681.63	7.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,966,111.00	0.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	531,275.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,324,934.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,782,067.00	0.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,826.50	0.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	108,579,895.13	9.01

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	35,500	50,037,960.00	4.15
2	300750	宁德时代	159,140	40,138,290.80	3.33
3	601166	兴业银行	1,074,800	25,085,832.00	2.08
4	000333	美的集团	346,900	25,046,180.00	2.08
5	601899	紫金矿业	1,185,500	23,117,250.00	1.92
6	601318	中国平安	411,600	22,835,568.00	1.89
7	600036	招商银行	454,700	20,893,465.00	1.73
8	601288	农业银行	2,885,600	16,967,328.00	1.41
9	601211	国泰海通	871,700	16,701,772.00	1.39
10	600000	浦发银行	1,140,900	15,835,692.00	1.31
11	601328	交通银行	1,946,800	15,574,400.00	1.29
12	603259	药明康德	222,500	15,474,875.00	1.28
13	600887	伊利股份	548,100	15,281,028.00	1.27
14	600900	长江电力	494,300	14,898,202.00	1.24
15	000725	京东方 A	3,431,200	13,690,488.00	1.14
16	601728	中国电信	1,578,200	12,231,050.00	1.01
17	601169	北京银行	1,780,700	12,162,181.00	1.01
18	601668	中国建筑	2,092,200	12,071,994.00	1.00
19	002230	科大讯飞	246,100	11,783,268.00	0.98
20	000001	平安银行	973,400	11,748,938.00	0.97
21	000063	中兴通讯	350,700	11,394,243.00	0.95
22	601816	京沪高铁	1,972,500	11,341,875.00	0.94
23	688981	中芯国际	128,556	11,334,782.52	0.94
24	688008	澜起科技	133,147	10,918,054.00	0.91
25	601818	光大银行	2,610,200	10,832,330.00	0.90
26	601857	中国石油	1,253,800	10,719,990.00	0.89
27	600690	海尔智家	431,700	10,697,526.00	0.89
28	601688	华泰证券	595,500	10,605,855.00	0.88
29	000858	五粮液	86,700	10,308,630.00	0.86
30	600050	中国联通	1,919,100	10,247,994.00	0.85
31	000338	潍柴动力	663,500	10,204,630.00	0.85
32	601766	中国中车	1,433,700	10,093,248.00	0.84
33	000100	TCL 科技	2,330,000	10,088,900.00	0.84
34	601601	中国太保	261,200	9,797,612.00	0.81
35	601988	中国银行	1,702,100	9,565,802.00	0.79
36	688256	寒武纪	15,799	9,503,098.50	0.79
37	600104	上汽集团	586,700	9,416,535.00	0.78
38	601916	浙商银行	2,740,500	9,290,295.00	0.77

39	000425	徐工机械	1,173,200	9,115,764.00	0.76
40	300015	爱尔眼科	711,200	8,875,776.00	0.74
41	300014	亿纬锂能	193,000	8,841,330.00	0.73
42	600999	招商证券	496,600	8,735,194.00	0.72
43	600547	山东黄金	273,300	8,726,469.00	0.72
44	601989	中国重工	1,864,800	8,652,672.00	0.72
45	688111	金山办公	30,508	8,543,765.40	0.71
46	600406	国电南瑞	379,000	8,493,390.00	0.70
47	000977	浪潮信息	165,300	8,410,464.00	0.70
48	600111	北方稀土	335,900	8,363,910.00	0.69
49	600585	海螺水泥	388,400	8,338,948.00	0.69
50	000938	紫光股份	345,400	8,286,146.00	0.69
51	603799	华友钴业	220,000	8,144,400.00	0.68
52	000166	申万宏源	1,609,000	8,077,180.00	0.67
53	601939	建设银行	849,300	8,017,392.00	0.67
54	600160	巨化股份	278,800	7,995,984.00	0.66
55	600919	江苏银行	656,500	7,838,610.00	0.65
56	600183	生益科技	251,700	7,588,755.00	0.63
57	601658	邮储银行	1,364,900	7,466,003.00	0.62
58	600115	中国东航	1,848,200	7,448,246.00	0.62
59	603296	华勤技术	91,900	7,414,492.00	0.62
60	601901	方正证券	930,600	7,361,046.00	0.61
61	300433	蓝思科技	328,600	7,327,780.00	0.61
62	600176	中国巨石	634,200	7,229,880.00	0.60
63	601878	浙商证券	659,700	7,197,327.00	0.60
64	600482	中国动力	309,500	7,140,165.00	0.59
65	600460	士兰微	287,500	7,135,750.00	0.59
66	600039	四川路桥	711,200	7,040,880.00	0.58
67	002236	大华股份	437,900	6,953,852.00	0.58
68	002709	天赐材料	382,000	6,921,840.00	0.57
69	601319	中国人保	793,900	6,914,869.00	0.57
70	300759	康龙化成	276,350	6,781,629.00	0.56
71	000963	华东医药	166,500	6,719,940.00	0.56
72	000538	云南白药	118,500	6,611,115.00	0.55
73	600019	宝钢股份	991,000	6,530,690.00	0.54
74	300274	阳光电源	91,600	6,207,732.00	0.52
75	002142	宁波银行	226,700	6,202,512.00	0.51
76	000651	格力电器	134,600	6,046,232.00	0.50
77	601669	中国电建	1,239,500	6,036,365.00	0.50
78	300999	金龙鱼	200,700	5,926,671.00	0.49
79	002648	卫星化学	321,300	5,568,129.00	0.46
80	002493	荣盛石化	654,600	5,420,088.00	0.45
81	002594	比亚迪	15,900	5,277,369.00	0.44

82	601998	中信银行	616,000	5,236,000.00	0.43
83	300059	东方财富	221,100	5,114,043.00	0.42
84	002736	国信证券	429,000	4,942,080.00	0.41
85	601868	中国能建	2,166,100	4,830,403.00	0.40
86	603993	洛阳钼业	553,700	4,662,154.00	0.39
87	601138	工业富联	217,600	4,652,288.00	0.39
88	002352	顺丰控股	92,000	4,485,920.00	0.37
89	601838	成都银行	222,100	4,464,210.00	0.37
90	000807	云铝股份	273,300	4,367,334.00	0.36
91	601186	中国铁建	545,200	4,367,052.00	0.36
92	002241	歌尔股份	182,800	4,262,896.00	0.35
93	601995	中金公司	120,400	4,257,344.00	0.35
94	300442	润泽科技	82,800	4,101,084.00	0.34
95	600584	长电科技	116,800	3,934,992.00	0.33
96	002460	赣锋锂业	109,800	3,707,946.00	0.31
97	600489	中金黄金	247,900	3,626,777.00	0.30
98	600016	民生银行	762,300	3,620,925.00	0.30
99	002600	领益智造	408,400	3,508,156.00	0.29
100	600030	中信证券	126,600	3,496,692.00	0.29
101	600196	复星医药	123,800	3,106,142.00	0.26
102	601066	中信建投	128,700	3,095,235.00	0.26
103	600025	华能水电	320,700	3,062,685.00	0.25
104	000157	中联重科	418,500	3,025,755.00	0.25
105	000895	双汇发展	123,800	3,021,958.00	0.25
106	002311	海大集团	47,900	2,806,461.00	0.23
107	601117	中国化学	350,200	2,686,034.00	0.22
108	688126	沪硅产业	133,894	2,506,495.68	0.21
109	600029	南方航空	371,800	2,193,620.00	0.18
110	300124	汇川技术	33,100	2,137,267.00	0.18
111	600276	恒瑞医药	40,500	2,101,950.00	0.17
112	001979	招商蛇口	234,800	2,059,196.00	0.17
113	688009	中国通号	364,042	1,871,175.88	0.16
114	600795	国电电力	352,100	1,704,164.00	0.14
115	603288	海天味业	41,000	1,595,310.00	0.13
116	603501	豪威集团	12,200	1,557,330.00	0.13
117	688187	时代电气	34,406	1,467,415.90	0.12
118	600332	白云山	53,100	1,399,716.00	0.12
119	600926	杭州银行	81,900	1,377,558.00	0.11
120	000708	中信特钢	102,900	1,210,104.00	0.10
121	600941	中国移动	10,100	1,136,755.00	0.09
122	600875	东方电气	64,500	1,079,730.00	0.09
123	601390	中国中铁	153,000	858,330.00	0.07
124	000301	东方盛虹	102,700	855,491.00	0.07

125	601689	拓普集团	16,600	784,350.00	0.07
126	688223	晶科能源	138,320	717,880.80	0.06
127	600674	川投能源	39,500	633,580.00	0.05
128	600219	南山铝业	112,400	430,492.00	0.04
129	301236	软通动力	6,100	333,304.00	0.03
130	601600	中国铝业	47,100	331,584.00	0.03
131	601877	正泰电器	13,300	301,511.00	0.03
132	601607	上海医药	7,000	125,160.00	0.01
133	601006	大秦铁路	13,900	91,740.00	0.01
134	601633	长城汽车	2,500	53,700.00	0.00
135	600741	华域汽车	2,900	51,185.00	0.00
136	601985	中国核电	5,000	46,600.00	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	002625	光启技术	147,300	5,889,054.00	0.49
2	600703	三安光电	464,500	5,769,090.00	0.48
3	002206	海利得	1,126,400	5,755,904.00	0.48
4	300850	新强联	159,500	5,713,290.00	0.47
5	000893	亚钾国际	188,900	5,693,446.00	0.47
6	600166	福田汽车	2,095,200	5,677,992.00	0.47
7	600578	京能电力	1,240,000	5,567,600.00	0.46
8	603379	三美股份	113,400	5,456,808.00	0.45
9	600063	皖维高新	1,142,800	5,234,024.00	0.43
10	603173	福斯达	140,300	4,987,665.00	0.41
11	688636	智明达	146,268	4,942,395.72	0.41
12	301387	光大同创	119,800	4,660,220.00	0.39
13	688257	新锐股份	268,945	3,940,044.25	0.33
14	300708	聚灿光电	289,000	3,468,000.00	0.29
15	603218	日月股份	260,800	3,309,552.00	0.27
16	300232	洲明科技	350,700	2,539,068.00	0.21
17	603270	金帝股份	98,500	2,530,465.00	0.21
18	301397	溯联股份	63,900	2,248,002.00	0.19
19	300450	先导智能	87,400	2,171,890.00	0.18
20	688328	深科达	73,085	1,655,375.25	0.14
21	603138	海量数据	103,500	1,492,470.00	0.12
22	600221	海航控股	1,064,400	1,426,296.00	0.12
23	300098	高新兴	273,700	1,423,240.00	0.12
24	688611	杭州柯林	43,588	1,422,276.44	0.12
25	300762	上海瀚讯	59,400	1,344,222.00	0.11
26	002057	中钢天源	121,800	1,131,522.00	0.09
27	601991	大唐发电	347,300	1,100,941.00	0.09

28	688585	上纬新材	116,899	909,474.22	0.08
29	600350	山东高速	84,300	898,638.00	0.07
30	600728	佳都科技	156,500	852,925.00	0.07
31	603612	索通发展	42,900	788,502.00	0.07
32	603038	华立股份	50,600	739,772.00	0.06
33	688681	科汇股份	48,467	678,538.00	0.06
34	300883	龙利得	97,900	608,938.00	0.05
35	000030	富奥股份	96,700	569,563.00	0.05
36	300017	网宿科技	49,700	532,784.00	0.04
37	601113	华鼎股份	134,500	531,275.00	0.04
38	300496	中科创达	8,400	480,648.00	0.04
39	688373	盟科药业	74,951	469,942.77	0.04
40	002461	珠江啤酒	41,200	465,148.00	0.04
41	601003	柳钢股份	131,400	462,528.00	0.04
42	002885	京泉华	30,100	425,915.00	0.04
43	600298	安琪酵母	11,600	407,972.00	0.03
44	002350	北京科锐	58,100	398,566.00	0.03
45	601311	骆驼股份	41,900	378,357.00	0.03
46	688677	海泰新光	7,916	308,803.16	0.03
47	300335	迪森股份	54,500	297,570.00	0.02
48	002363	隆基机械	28,400	216,124.00	0.02
49	300206	理邦仪器	14,900	179,098.00	0.01
50	300573	兴齐眼药	2,000	103,580.00	0.01
51	603966	法兰泰克	10,800	100,224.00	0.01
52	002102	能特科技	31,200	98,592.00	0.01
53	301662	宏工科技	229	20,898.02	0.00
54	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
55	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
56	605589	圣泉集团	400	11,100.00	0.00
57	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
58	603701	德宏股份	400	6,992.00	0.00
59	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
60	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
61	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
62	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
63	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
64	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
65	300329	海伦钢琴	500	3,790.00	0.00
66	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
67	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
68	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
69	603271	永杰新材	53	1,859.24	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	52,346,176.00	49.18
2	300750	宁德时代	40,817,549.60	38.34
3	600036	招商银行	30,838,786.00	28.97
4	000333	美的集团	29,334,273.00	27.56
5	601166	兴业银行	26,755,469.00	25.13
6	601899	紫金矿业	25,394,811.00	23.86
7	601318	中国平安	24,565,714.00	23.08
8	601857	中国石油	22,407,055.00	21.05
9	601288	农业银行	20,536,708.00	19.29
10	601211	国泰海通	20,059,511.56	18.84
11	688256	寒武纪	18,720,700.87	17.59
12	688981	中芯国际	18,599,843.76	17.47
13	601328	交通银行	18,129,523.00	17.03
14	600030	中信证券	17,952,022.00	16.86
15	601988	中国银行	17,819,520.00	16.74
16	601728	中国电信	17,784,174.00	16.71
17	000725	京东方 A	17,658,515.00	16.59
18	300059	东方财富	17,529,647.32	16.47
19	600000	浦发银行	16,663,428.00	15.65
20	600887	伊利股份	16,199,873.00	15.22
21	603259	药明康德	16,111,520.15	15.14
22	601601	中国太保	15,435,730.00	14.50
23	601766	中国中车	15,088,314.68	14.17
24	601816	京沪高铁	14,897,823.00	14.00
25	000858	五粮液	14,896,563.01	13.99
26	600900	长江电力	14,509,939.00	13.63
27	600050	中国联通	13,759,657.00	12.93
28	000001	平安银行	13,742,385.00	12.91
29	600690	海尔智家	13,613,986.00	12.79
30	601658	邮储银行	13,569,753.00	12.75
31	300014	亿纬锂能	13,257,549.00	12.45
32	002230	科大讯飞	13,237,338.00	12.44
33	601688	华泰证券	13,040,981.00	12.25
34	600016	民生银行	12,995,093.00	12.21
35	601169	北京银行	12,463,492.00	11.71
36	688008	澜起科技	12,394,223.06	11.64
37	000651	格力电器	12,232,347.00	11.49
38	002352	顺丰控股	11,918,891.00	11.20

39	000063	中兴通讯	11,752,841.00	11.04
40	300015	爱尔眼科	11,740,564.00	11.03
41	600104	上汽集团	11,735,357.00	11.02
42	002475	立讯精密	11,688,176.00	10.98
43	601818	光大银行	11,589,626.00	10.89
44	601668	中国建筑	11,457,857.00	10.76
45	000100	TCL 科技	11,372,804.00	10.68
46	603799	华友钴业	10,863,156.00	10.21
47	000425	徐工机械	10,763,574.00	10.11
48	600115	中国东航	10,739,849.00	10.09
49	000338	潍柴动力	10,730,222.00	10.08
50	601916	浙商银行	10,704,935.00	10.06
51	600111	北方稀土	10,557,997.00	9.92
52	601788	光大证券	10,417,807.00	9.79
53	600160	巨化股份	10,374,835.86	9.75
54	600585	海螺水泥	10,272,621.00	9.65
55	002594	比亚迪	10,225,887.00	9.61
56	002050	三花智控	9,891,064.00	9.29
57	300433	蓝思科技	9,871,554.00	9.27
58	000938	紫光股份	9,725,522.00	9.14
59	688111	金山办公	9,704,236.11	9.12
60	600999	招商证券	9,533,965.00	8.96
61	000977	浪潮信息	9,289,413.00	8.73
62	601989	中国重工	9,204,388.00	8.65
63	600919	江苏银行	9,189,703.00	8.63
64	601360	三六零	9,179,912.00	8.62
65	601838	成都银行	9,177,495.00	8.62
66	688126	沪硅产业	9,173,175.76	8.62
67	601939	建设银行	8,994,623.00	8.45
68	600460	士兰微	8,956,707.00	8.41
69	000538	云南白药	8,933,840.80	8.39
70	300098	高新兴	8,873,081.00	8.34
71	601998	中信银行	8,811,407.00	8.28
72	002648	卫星化学	8,754,275.00	8.22
73	600547	山东黄金	8,630,392.20	8.11
74	600196	复星医药	8,592,221.00	8.07
75	600406	国电南瑞	8,570,393.00	8.05
76	600019	宝钢股份	8,567,032.00	8.05
77	002709	天赐材料	8,499,087.00	7.98
78	000166	申万宏源	8,486,935.00	7.97
79	300274	阳光电源	8,405,839.00	7.90
80	688599	天合光能	8,331,337.98	7.83
81	000625	长安汽车	8,297,355.00	7.79

82	600490	鹏欣资源	8,295,953.00	7.79
83	300033	同花顺	8,227,504.00	7.73
84	601088	中国神华	8,203,928.00	7.71
85	002493	荣盛石化	8,167,869.00	7.67
86	002460	赣锋锂业	8,027,039.00	7.54
87	002241	歌尔股份	8,024,083.00	7.54
88	002129	TCL 中环	8,009,795.00	7.52
89	002236	大华股份	7,972,625.00	7.49
90	601995	中金公司	7,919,173.00	7.44
91	601878	浙商证券	7,843,585.00	7.37
92	600482	中国动力	7,742,579.00	7.27
93	600176	中国巨石	7,695,727.00	7.23
94	600063	皖维高新	7,647,847.00	7.18
95	601877	正泰电器	7,638,197.00	7.18
96	300759	康龙化成	7,624,610.50	7.16
97	603019	中科曙光	7,582,503.00	7.12
98	601868	中国能建	7,480,332.00	7.03
99	600010	包钢股份	7,471,358.00	7.02
100	601669	中国电建	7,457,417.00	7.01
101	600438	通威股份	7,373,489.00	6.93
102	600703	三安光电	7,349,382.00	6.90
103	000630	铜陵有色	7,315,057.00	6.87
104	601901	方正证券	7,311,615.00	6.87
105	601390	中国中铁	7,307,845.00	6.87
106	601319	中国人保	7,289,754.00	6.85
107	300442	润泽科技	7,228,195.00	6.79
108	300450	先导智能	7,127,151.00	6.70
109	300999	金龙鱼	7,103,933.36	6.67
110	002142	宁波银行	7,035,713.00	6.61
111	600918	中泰证券	6,946,423.00	6.53
112	000963	华东医药	6,940,062.00	6.52
113	603296	华勤技术	6,931,524.00	6.51
114	300232	洲明科技	6,805,045.00	6.39
115	002466	天齐锂业	6,737,298.00	6.33
116	600183	生益科技	6,721,965.00	6.31
117	600039	四川路桥	6,712,185.80	6.31
118	002736	国信证券	6,685,946.00	6.28
119	600219	南山铝业	6,637,251.00	6.24
120	300308	中际旭创	6,526,125.00	6.13
121	000568	泸州老窖	6,340,321.00	5.96
122	601238	广汽集团	6,299,596.00	5.92
123	601138	工业富联	6,268,012.00	5.89
124	600926	杭州银行	6,172,059.00	5.80

125	688033	天宜新材	6,066,232.10	5.70
126	600166	福田汽车	5,868,543.00	5.51
127	600584	长电科技	5,865,866.00	5.51
128	000893	亚钾国际	5,856,241.00	5.50
129	601377	兴业证券	5,851,594.00	5.50
130	301387	光大同创	5,827,841.00	5.47
131	688636	智明达	5,754,524.63	5.41
132	002625	光启技术	5,739,689.00	5.39
133	600745	闻泰科技	5,731,005.00	5.38
134	002206	海利得	5,724,224.00	5.38
135	000895	双汇发展	5,711,581.00	5.37
136	600578	京能电力	5,590,443.00	5.25
137	300548	长芯博创	5,587,282.00	5.25
138	000617	中油资本	5,580,045.00	5.24
139	601186	中国铁建	5,540,423.00	5.20
140	603379	三美股份	5,528,939.00	5.19
141	002555	三七互娱	5,523,113.00	5.19
142	300418	昆仑万维	5,522,029.00	5.19
143	002350	北京科锐	5,470,489.00	5.14
144	603993	洛阳钼业	5,410,965.00	5.08
145	300850	新强联	5,364,708.00	5.04
146	601117	中国化学	5,279,047.00	4.96
147	002463	沪电股份	5,245,224.00	4.93
148	601633	长城汽车	5,240,505.00	4.92
149	000807	云铝股份	5,204,153.00	4.89
150	002483	润邦股份	5,077,316.00	4.77
151	000776	广发证券	5,044,839.00	4.74
152	603288	海天味业	5,033,566.20	4.73
153	301128	强瑞技术	5,005,747.60	4.70
154	601066	中信建投	4,980,569.00	4.68
155	603173	福斯达	4,971,929.00	4.67
156	002812	恩捷股份	4,957,840.00	4.66
157	600276	恒瑞医药	4,952,074.00	4.65
158	300731	科创新源	4,916,887.00	4.62
159	000301	东方盛虹	4,906,293.00	4.61
160	601689	拓普集团	4,874,359.00	4.58
161	688591	泰凌微	4,847,983.85	4.55
162	600150	中国船舶	4,804,043.00	4.51
163	000786	北新建材	4,801,703.00	4.51
164	002916	深南电路	4,789,126.00	4.50
165	000157	中联重科	4,640,934.00	4.36
166	603106	恒银科技	4,594,463.00	4.32
167	002007	华兰生物	4,577,881.00	4.30

168	301526	国际复材	4,549,157.00	4.27
169	600028	中国石化	4,516,640.00	4.24
170	601059	信达证券	4,493,244.00	4.22
171	301397	溯联股份	4,475,573.00	4.20
172	600015	华夏银行	4,471,824.00	4.20
173	600963	岳阳林纸	4,418,151.00	4.15
174	601006	大秦铁路	4,405,524.00	4.14
175	603986	兆易创新	4,403,506.00	4.14
176	002311	海大集团	4,371,752.00	4.11
177	600489	中金黄金	4,304,094.00	4.04
178	300252	金信诺	4,218,134.00	3.96
179	600795	国电电力	4,121,434.00	3.87
180	300122	智飞生物	4,071,908.00	3.83
181	300162	雷曼光电	4,025,580.00	3.78
182	000030	富奥股份	3,996,679.00	3.75
183	300394	天孚通信	3,966,194.00	3.73
184	300347	泰格医药	3,964,192.00	3.72
185	300762	上海瀚讯	3,931,045.00	3.69
186	601919	中远海控	3,929,586.00	3.69
187	600066	宇通客车	3,921,245.00	3.68
188	688257	新锐股份	3,918,611.91	3.68
189	600866	星湖科技	3,913,561.00	3.68
190	600023	浙能电力	3,897,578.00	3.66
191	300798	锦鸡股份	3,885,774.00	3.65
192	603270	金帝股份	3,839,679.00	3.61
193	601009	南京银行	3,826,972.00	3.60
194	600588	用友网络	3,823,410.00	3.59
195	003037	三和管桩	3,800,538.00	3.57
196	600025	华能水电	3,789,022.00	3.56
197	601127	赛力斯	3,770,030.00	3.54
198	300414	中光防雷	3,769,776.00	3.54
199	601236	红塔证券	3,745,629.00	3.52
200	688244	永信至诚	3,731,448.81	3.51
201	001896	豫能控股	3,683,037.00	3.46
202	002285	世联行	3,601,725.00	3.38
203	300366	创意信息	3,589,313.00	3.37
204	002028	思源电气	3,513,376.00	3.30
205	002600	领益智造	3,512,471.00	3.30
206	002074	国轩高科	3,483,585.00	3.27
207	301379	天山电子	3,438,631.69	3.23
208	300708	聚灿光电	3,438,441.00	3.23
209	603218	日月股份	3,436,387.00	3.23
210	300284	苏交科	3,411,164.00	3.20

211	601888	中国中免	3,373,414.00	3.17
212	601225	陕西煤业	3,370,587.00	3.17
213	001316	润贝航科	3,304,872.00	3.10
214	002449	国星光电	3,291,607.00	3.09
215	688009	中国通号	3,273,173.32	3.07
216	300913	兆龙互连	3,264,386.00	3.07
217	003027	同兴科技	3,258,071.00	3.06
218	300769	德方纳米	3,248,099.00	3.05
219	600515	海南机场	3,222,101.01	3.03
220	300766	每日互动	3,214,961.00	3.02
221	002057	中钢天源	3,210,904.00	3.02
222	003033	征和工业	3,206,157.00	3.01
223	001979	招商蛇口	3,132,440.00	2.94
224	300782	卓胜微	3,108,332.00	2.92
225	000099	中信海直	3,099,119.00	2.91
226	300053	航宇微	3,064,649.00	2.88
227	688186	广大特材	3,059,674.64	2.87
228	300027	华谊兄弟	3,041,145.00	2.86
229	300083	创世纪	3,030,564.00	2.85
230	301488	豪恩汽电	3,005,058.00	2.82
231	300124	汇川技术	2,995,703.00	2.81
232	002459	晶澳科技	2,956,940.00	2.78
233	002512	达华智能	2,950,655.00	2.77
234	300563	神宇股份	2,946,349.00	2.77
235	600958	东方证券	2,927,207.00	2.75
236	300107	建新股份	2,916,939.00	2.74
237	300760	迈瑞医疗	2,876,155.00	2.70
238	000868	安凯客车	2,856,370.00	2.68
239	002001	新和成	2,847,193.00	2.67
240	300873	海晨股份	2,846,802.00	2.67
241	688676	金盘科技	2,837,205.34	2.67
242	002271	东方雨虹	2,835,128.00	2.66
243	300369	绿盟科技	2,825,497.00	2.65
244	601519	大智慧	2,781,397.00	2.61
245	600941	中国移动	2,745,090.00	2.58
246	002374	中锐股份	2,739,407.00	2.57
247	688205	德科立	2,728,282.99	2.56
248	688320	禾川科技	2,695,710.45	2.53
249	600860	京城股份	2,687,518.00	2.52
250	002297	博云新材	2,666,864.00	2.51
251	600415	小商品城	2,657,724.00	2.50
252	600031	三一重工	2,652,891.00	2.49
253	688611	杭州柯林	2,613,350.39	2.46

254	300502	新易盛	2,602,263.00	2.44
255	300177	中海达	2,597,980.00	2.44
256	600905	三峡能源	2,586,328.00	2.43
257	601929	吉视传媒	2,586,306.00	2.43
258	601608	中信重工	2,569,458.00	2.41
259	300192	科德教育	2,566,850.00	2.41
260	601881	中国银河	2,562,073.00	2.41
261	601698	中国卫通	2,558,545.00	2.40
262	300352	北信源	2,537,061.00	2.38
263	300292	吴通控股	2,531,962.00	2.38
264	600674	川投能源	2,530,279.00	2.38
265	601618	中国中冶	2,517,159.00	2.36
266	600570	恒生电子	2,509,389.00	2.36
267	300291	百纳千成	2,507,829.00	2.36
268	688496	清越科技	2,488,232.99	2.34
269	300628	亿联网络	2,469,413.00	2.32
270	002479	富春环保	2,443,457.00	2.30
271	688082	盛美上海	2,418,274.73	2.27
272	603499	翔港科技	2,400,561.00	2.26
273	300018	中元股份	2,396,087.00	2.25
274	300271	华宇软件	2,388,459.00	2.24
275	600105	永鼎股份	2,357,494.00	2.21
276	002626	金达威	2,331,865.00	2.19
277	300386	飞天诚信	2,326,788.00	2.19
278	600875	东方电气	2,301,279.00	2.16
279	301372	科净源	2,298,830.00	2.16
280	688173	希荻微	2,278,548.87	2.14
281	600029	南方航空	2,275,148.00	2.14
282	688766	普冉股份	2,272,806.51	2.14
283	688518	联赢激光	2,269,461.22	2.13
284	300068	南都电源	2,269,193.00	2.13
285	300071	福石控股	2,266,506.00	2.13
286	002422	科伦药业	2,241,745.00	2.11
287	300609	汇纳科技	2,224,886.00	2.09
288	600322	津投城开	2,202,801.00	2.07
289	603501	豪威集团	2,195,120.00	2.06
290	603657	春光科技	2,187,490.00	2.05
291	601012	隆基绿能	2,176,151.00	2.04
292	688201	信安世纪	2,175,076.09	2.04
293	601003	柳钢股份	2,170,292.00	2.04
294	000975	山金国际	2,166,274.00	2.04
295	688238	和元生物	2,165,627.45	2.03
296	603186	华正新材	2,145,861.00	2.02

297	300279	和晶科技	2,139,079.00	2.01
298	300193	佳士科技	2,135,110.00	2.01
299	003001	中岩大地	2,132,131.00	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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	15,135,181.00	14.22
2	600030	中信证券	14,907,042.00	14.00
3	002475	立讯精密	13,574,792.00	12.75
4	300059	东方财富	12,999,816.00	12.21
5	601857	中国石油	12,512,092.00	11.75
6	601788	光大证券	10,988,292.00	10.32
7	002050	三花智控	10,237,304.00	9.62
8	600016	民生银行	9,821,742.00	9.23
9	601088	中国神华	9,617,529.00	9.03
10	601988	中国银行	9,189,340.00	8.63
11	002352	顺丰控股	8,878,986.00	8.34
12	601360	三六零	8,672,050.00	8.15
13	000625	长安汽车	8,654,601.00	8.13
14	688256	寒武纪	8,625,052.19	8.10
15	688599	天合光能	8,135,695.04	7.64
16	601601	中国太保	8,094,507.00	7.60
17	601877	正泰电器	7,967,491.00	7.48
18	300098	高新兴	7,928,812.00	7.45
19	600490	鹏欣资源	7,853,757.00	7.38
20	603019	中科曙光	7,805,364.00	7.33
21	002129	TCL 中环	7,630,229.00	7.17
22	002463	沪电股份	7,541,233.00	7.08
23	300033	同花顺	7,525,389.00	7.07
24	600438	通威股份	7,500,768.00	7.05
25	000630	铜陵有色	7,462,757.00	7.01
26	000651	格力电器	7,449,107.00	7.00
27	600918	中泰证券	7,380,775.00	6.93
28	300308	中际旭创	7,362,661.00	6.92
29	600010	宝钢股份	7,257,872.00	6.82
30	688981	中芯国际	7,234,701.97	6.80
31	601390	中国中铁	7,022,335.00	6.60
32	002466	天齐锂业	6,973,203.00	6.55
33	600219	南山铝业	6,932,999.00	6.51

34	601658	邮储银行	6,918,436.00	6.50
35	688126	沪硅产业	6,723,288.50	6.32
36	601728	中国电信	6,703,607.00	6.30
37	688033	天宜新材	6,107,339.20	5.74
38	300548	长芯博创	6,085,802.00	5.72
39	000568	泸州老窖	6,081,623.00	5.71
40	300450	先导智能	6,080,715.00	5.71
41	300418	昆仑万维	6,025,723.00	5.66
42	000776	广发证券	6,004,788.00	5.64
43	601238	广汽集团	5,967,093.00	5.61
44	601377	兴业证券	5,926,445.00	5.57
45	600926	杭州银行	5,913,442.00	5.56
46	601838	成都银行	5,908,818.00	5.55
47	601318	中国平安	5,843,690.00	5.49
48	000617	中油资本	5,810,580.00	5.46
49	000333	美的集团	5,806,947.00	5.46
50	300731	科创新源	5,748,128.00	5.40
51	002555	三七互娱	5,725,792.00	5.38
52	600196	复星医药	5,620,055.00	5.28
53	601766	中国中车	5,440,778.00	5.11
54	000725	京东方 A	5,330,748.00	5.01
55	600745	闻泰科技	5,309,664.00	4.99
56	600028	中国石化	5,259,631.00	4.94
57	600150	中国船舶	5,235,890.00	4.92
58	601633	长城汽车	5,207,110.00	4.89
59	601899	紫金矿业	5,187,947.00	4.87
60	002350	北京科锐	5,136,768.00	4.83
61	002916	深南电路	5,098,933.50	4.79
62	601288	农业银行	5,053,881.00	4.75
63	002483	润邦股份	5,028,759.00	4.72
64	002812	恩捷股份	5,019,555.00	4.72
65	688591	泰凌微	4,988,381.51	4.69
66	301128	强瑞技术	4,980,929.40	4.68
67	601816	京沪高铁	4,949,606.00	4.65
68	601919	中远海控	4,926,567.00	4.63
69	002460	赣锋锂业	4,903,048.00	4.61
70	603986	兆易创新	4,867,540.00	4.57
71	300014	亿纬锂能	4,826,343.00	4.53
72	002594	比亚迪	4,818,592.00	4.53
73	000786	北新建材	4,771,596.00	4.48
74	601009	南京银行	4,755,069.00	4.47
75	601328	交通银行	4,695,342.00	4.41
76	601211	国泰海通	4,690,970.66	4.41

77	601059	信达证券	4,669,833.00	4.39
78	600015	华夏银行	4,639,869.00	4.36
79	603106	恒银科技	4,619,319.00	4.34
80	002007	华兰生物	4,603,050.00	4.32
81	601006	大秦铁路	4,565,386.00	4.29
82	600066	宇通客车	4,564,898.00	4.29
83	301526	国际复材	4,541,740.00	4.27
84	300232	洲明科技	4,474,048.00	4.20
85	300252	金信诺	4,459,669.00	4.19
86	600963	岳阳林纸	4,396,272.00	4.13
87	300414	中光防雷	4,381,929.00	4.12
88	600023	浙能电力	4,370,407.00	4.11
89	002241	歌尔股份	4,334,590.00	4.07
90	300394	天孚通信	4,294,715.00	4.03
91	601689	拓普集团	4,230,299.00	3.97
92	601225	陕西煤业	4,223,495.00	3.97
93	301379	天山电子	4,192,251.35	3.94
94	300798	锦鸡股份	4,164,060.00	3.91
95	600050	中国联通	4,134,680.00	3.88
96	688244	永信至诚	4,130,601.72	3.88
97	300347	泰格医药	4,123,488.00	3.87
98	601236	红塔证券	4,043,237.60	3.80
99	300162	雷曼光电	4,031,897.00	3.79
100	601995	中金公司	4,012,406.00	3.77
101	601127	赛力斯	4,007,862.00	3.77
102	601166	兴业银行	4,003,926.00	3.76
103	002648	卫星化学	3,904,810.00	3.67
104	601998	中信银行	3,884,031.00	3.65
105	600588	用友网络	3,876,107.00	3.64
106	000858	五粮液	3,866,057.00	3.63
107	003037	三和管桩	3,865,596.00	3.63
108	300750	宁德时代	3,815,480.00	3.58
109	001896	豫能控股	3,788,276.22	3.56
110	300913	兆龙互连	3,691,550.00	3.47
111	002001	新和成	3,639,913.20	3.42
112	000301	东方盛虹	3,628,711.00	3.41
113	300284	苏交科	3,616,608.00	3.40
114	600115	中国东航	3,604,598.00	3.39
115	300122	智飞生物	3,596,780.00	3.38
116	002028	思源电气	3,575,434.00	3.36
117	001316	润贝航科	3,566,500.00	3.35
118	600690	海尔智家	3,543,007.00	3.33
119	600866	星湖科技	3,533,183.00	3.32

120	300769	德方纳米	3,494,177.40	3.28
121	002074	国轩高科	3,474,401.00	3.26
122	002285	世联行	3,471,917.41	3.26
123	601881	中国银河	3,456,119.74	3.25
124	300782	卓胜微	3,446,905.00	3.24
125	003027	同兴科技	3,446,025.00	3.24
126	002449	国星光电	3,436,674.00	3.23
127	601688	华泰证券	3,422,807.00	3.22
128	603799	华友钴业	3,421,040.00	3.21
129	300053	航宇微	3,366,750.00	3.16
130	000030	富奥股份	3,347,535.00	3.14
131	600919	江苏银行	3,347,035.00	3.14
132	601888	中国中免	3,334,398.00	3.13
133	600795	国电电力	3,331,278.00	3.13
134	688205	德科立	3,328,034.04	3.13
135	301488	豪恩汽电	3,313,719.00	3.11
136	300563	神宇股份	3,239,568.00	3.04
137	600958	东方证券	3,230,428.00	3.03
138	000099	中信海直	3,221,891.00	3.03
139	000895	双汇发展	3,193,716.00	3.00
140	600276	恒瑞医药	3,174,706.00	2.98
141	603288	海天味业	3,171,804.00	2.98
142	600515	海南机场	3,158,192.00	2.97
143	688186	广大特材	3,154,432.83	2.96
144	601868	中国能建	3,146,934.00	2.96
145	688320	禾川科技	3,115,320.71	2.93
146	300083	创世纪	3,106,957.99	2.92
147	600519	贵州茅台	3,054,695.00	2.87
148	300442	润泽科技	3,051,167.00	2.87
149	601117	中国化学	3,043,030.00	2.86
150	003033	征和工业	3,017,260.00	2.83
151	300366	创意信息	2,975,964.00	2.80
152	300107	建新股份	2,934,075.00	2.76
153	300766	每日互动	2,932,247.00	2.75
154	300502	新易盛	2,910,629.00	2.73
155	300027	华谊兄弟	2,888,019.00	2.71
156	300760	迈瑞医疗	2,878,810.00	2.70
157	600660	福耀玻璃	2,875,373.00	2.70
158	300762	上海瀚讯	2,867,048.00	2.69
159	002297	博云新材	2,865,763.00	2.69
160	603499	翔港科技	2,865,621.44	2.69
161	000538	云南白药	2,859,377.00	2.69
162	601519	大智慧	2,847,686.00	2.68

163	601916	浙商银行	2,832,593.00	2.66
164	002459	晶澳科技	2,828,702.00	2.66
165	300433	蓝思科技	2,820,041.00	2.65
166	300628	亿联网络	2,814,175.00	2.64
167	300873	海晨股份	2,813,589.00	2.64
168	600860	京城股份	2,800,202.00	2.63
169	300177	中海达	2,768,956.60	2.60
170	688676	金盘科技	2,748,955.47	2.58
171	002626	金达威	2,719,545.00	2.55
172	300352	北信源	2,712,525.00	2.55
173	601618	中国中冶	2,710,308.00	2.55
174	600019	宝钢股份	2,689,324.00	2.53
175	600160	巨化股份	2,682,709.00	2.52
176	300274	阳光电源	2,674,378.00	2.51
177	600000	浦发银行	2,671,308.00	2.51
178	600031	三一重工	2,663,475.00	2.50
179	000001	平安银行	2,656,879.00	2.50
180	300192	科德教育	2,656,672.00	2.50
181	002512	达华智能	2,622,316.00	2.46
182	601608	中信重工	2,600,422.00	2.44
183	600063	皖维高新	2,596,935.00	2.44
184	002271	东方雨虹	2,588,962.00	2.43
185	600415	小商品城	2,576,101.00	2.42
186	300271	华宇软件	2,575,128.00	2.42
187	600941	中国移动	2,572,412.00	2.42
188	300369	绿盟科技	2,567,563.00	2.41
189	002493	荣盛石化	2,545,724.00	2.39
190	300015	爱尔眼科	2,545,458.00	2.39
191	600905	三峡能源	2,525,480.00	2.37
192	000975	山金国际	2,519,400.00	2.37
193	600111	北方稀土	2,518,631.00	2.37
194	300291	百纳千成	2,511,660.00	2.36
195	688518	联赢激光	2,508,639.06	2.36
196	000408	藏格矿业	2,507,917.00	2.36
197	301397	溯联股份	2,506,702.00	2.35
198	002479	富春环保	2,486,849.00	2.34
199	300071	福石控股	2,480,824.00	2.33
200	300386	飞天诚信	2,473,235.00	2.32
201	600105	永鼎股份	2,472,730.00	2.32
202	000868	安凯客车	2,440,041.00	2.29
203	600570	恒生电子	2,437,897.00	2.29
204	300193	佳士科技	2,434,697.00	2.29
205	300068	南都电源	2,415,977.00	2.27

206	003001	中岩大地	2,410,930.00	2.26
207	600585	海螺水泥	2,410,133.00	2.26
208	301372	科净源	2,390,625.00	2.25
209	603259	药明康德	2,388,879.00	2.24
210	601012	隆基绿能	2,375,195.00	2.23
211	688766	普冉股份	2,365,129.06	2.22
212	002374	中锐股份	2,358,812.00	2.22
213	601138	工业富联	2,341,657.00	2.20
214	688082	盛美上海	2,336,191.49	2.19
215	688173	希荻微	2,328,779.21	2.19
216	002736	国信证券	2,325,434.00	2.18
217	601698	中国卫通	2,316,821.00	2.18
218	688238	和元生物	2,308,329.47	2.17
219	300077	国民技术	2,296,134.00	2.16
220	002422	科伦药业	2,290,236.00	2.15
221	300046	台基股份	2,283,354.00	2.15
222	600938	中国海油	2,272,087.00	2.13
223	688472	阿特斯	2,267,682.44	2.13
224	300460	惠伦晶体	2,252,805.00	2.12
225	601818	光大银行	2,251,690.00	2.12
226	601939	建设银行	2,251,345.00	2.11
227	688041	海光信息	2,247,028.71	2.11
228	601929	吉视传媒	2,221,417.00	2.09
229	300609	汇纳科技	2,206,908.00	2.07
230	300018	中元股份	2,202,433.00	2.07
231	002057	中钢天源	2,191,087.00	2.06
232	603657	春光科技	2,158,693.00	2.03
233	688496	清越科技	2,146,476.08	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,369,169,302.10
卖出股票收入（成交）总额	1,372,413,834.89

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	55,477,323.67	4.60

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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,477,323.67	4.60

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	019749	24 国债 15	130,000	13,165,174.79	1.09
2	102298	国债 2508	81,000	8,125,030.11	0.67
3	019773	25 国债 08	73,000	7,322,558.00	0.61
4	019766	25 国债 01	70,000	7,030,851.78	0.58
5	019758	24 国债 21	64,000	6,457,428.16	0.54

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兴业银行（代码：601166 SH）、招商银行（代码：600036 SH）、农业银行（代码：601288 SH）、国泰海通（代码：601211 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 兴业银行股份有限公司

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

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

2025 年 1 月 27 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2. 招商银行股份有限公司

2025 年 6 月 5 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被深圳市交通运输局罚款。

3. 中国农业银行股份有限公司

2025 年 1 月 27 日，中国农业银行股份有限公司因违反反洗钱法、违规经营、违规占压财政存款或资金被中国人民银行警告、罚款、没收违法所得。

4. 国泰海通证券股份有限公司

2024 年 10 月 11 日，国泰海通证券股份有限公司因未依法履行职责被全国中小企业股份转让系统有限责任公司要求提交书面承诺。

2025 年 5 月 23 日，国泰海通证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所通报批评。

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	200,026.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,509,460.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,709,487.87

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	12,215	17,470.38	143,583,845.27	67.28	69,816,860.12	32.72
安信量化	74,089	6,685.58	388,594,542.06	78.45	106,733,663.90	21.55

沪深 300 增强 C						
合计	85,891	8,251.49	532,178,387.33	75.09	176,550,524.02	24.91

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	435,841.52	0.20
	安信量化沪深 300 增强 C	135,149.17	0.03
	合计	570,990.69	0.08

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	安信量化沪深 300 增强 A	10~50
	安信量化沪深 300 增强 C	0
	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
	合计	0~10

§ 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	30,394,415.22	37,219,158.88
本报告期基金总申购份额	204,966,675.26	563,777,760.58

减：本报告期基金总 赎回份额	21,960,385.09	105,668,713.50
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	213,400,705.39	495,328,205.96

§ 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

本报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第八次会议审议通过，自 2025 年 3 月 31 日起公司督察长由孙晓奇先生变更为王卫峰先生。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	792,373,356.14	21.19	155,301.37	21.19	-
华创证券	2	762,019,874.77	20.38	149,356.95	20.38	-
开源证券	1	538,006,751.11	14.39	105,447.74	14.39	-
华泰证券	1	485,002,985.46	12.97	95,060.47	12.97	-
国金证券	1	403,105,999.04	10.78	79,008.90	10.78	-
信达证券	2	366,692,217.17	9.81	71,870.75	9.81	-
中信证券	2	233,032,031.22	6.23	45,674.25	6.23	-
中泰证券	2	102,286,269.40	2.74	20,048.78	2.74	-
申万宏源	2	56,374,464.10	1.51	11,049.43	1.51	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

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

本报告期内，国泰君安吸收合并海通证券，券商名称统一更名为“国泰海通”。

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	10,127,114.93	15.31	18,000,000.00	2.59	-	-
华创证券	26,510,375.00	40.08	223,545,000.00	32.15	-	-
开源证券	2,299,495.00	3.48	-	-	-	-
华泰证券	9,799,050.00	14.81	176,899,000.00	25.44	-	-
国金证券	3,711,433.00	5.61	118,646,000.00	17.06	-	-
信达证券	-	-	37,000,000.00	5.32	-	-
中信证券	6,802,598.00	10.28	70,210,000.00	10.10	-	-

中泰证券	-	-	21,500,000.00	3.09	-	-
申万宏源	6,900,076.00	10.43	29,500,000.00	4.24	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

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 95 只基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2025 年 1 月 20 日
2	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券时报、中国证券报	2025 年 3 月 20 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 95 只基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025 年 3 月 28 日
4	安信基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025 年 4 月 2 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下 2 只基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报、中国证券报	2025 年 4 月 15 日
6	安信基金管理有限责任公司关于增加基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025 年 4 月 29 日
7	安信基金管理有限责任公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025 年 5 月 28 日
8	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台暂停服务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025 年 6 月 19 日

§ 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	20250227-20250324	-	60,045,798.34	-	60,045,798.34	8.47

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

本基金管理人和基金托管人的住所。

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

2025 年 8 月 28 日