

# 安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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 .....	5
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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
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 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	51
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 .....	51

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	51
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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>53</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	54
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	54
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>54</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	57
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>58</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	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	58
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>58</b>
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	安信量化优选股票	
基金主代码	006346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 3 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	27,920,434.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	006346	006347
报告期末下属分级基金的份额总额	18,870,039.39 份	9,050,395.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。资产配置方面，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与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 负责人	姓名	孙晓奇	郭明
	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
本期已实现收益	501,729.12	-26,794.64
本期利润	-1,557,816.48	-574,824.84
加权平均基金份	-0.0917	-0.0620

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	-5.26%	-3.65%
本期基金份额净值增长率	-4.03%	-4.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	10,947,326.09	4,924,057.10
期末可供分配基金份额利润	0.5801	0.5441
期末基金资产净值	31,487,745.57	14,774,921.85
期末基金份额净值	1.6687	1.6325
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	66.87%	63.25%

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

安信量化优选股票 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	-5.55%	0.85%	-5.75%	0.81%	0.20%	0.04%
过去三个月	-5.66%	0.97%	-5.25%	0.97%	-0.41%	0.00%
过去六个月	-4.03%	1.21%	-6.96%	1.36%	2.93%	-0.15%

过去一年	-9.65%	1.00%	-14.21%	1.08%	4.56%	-0.08%
过去三年	-27.49%	1.12%	-21.60%	1.02%	-5.89%	0.10%
自基金合同生效起至今	66.87%	1.21%	8.30%	1.14%	58.57%	0.07%

安信量化优选股票 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	-5.59%	0.85%	-5.75%	0.81%	0.16%	0.04%
过去三个月	-5.76%	0.97%	-5.25%	0.97%	-0.51%	0.00%
过去六个月	-4.22%	1.21%	-6.96%	1.36%	2.74%	-0.15%
过去一年	-10.02%	1.00%	-14.21%	1.08%	4.19%	-0.08%
过去三年	-28.36%	1.12%	-21.60%	1.02%	-6.76%	0.10%
自基金合同生效起至今	63.25%	1.21%	8.30%	1.14%	54.95%	0.07%

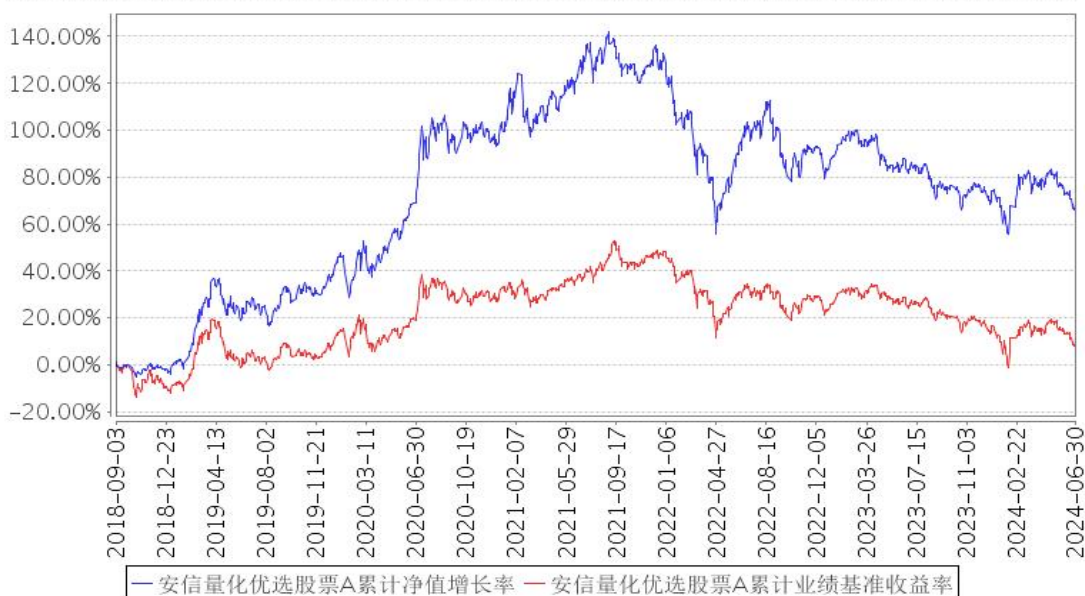
注：根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况；中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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 85%、15%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。

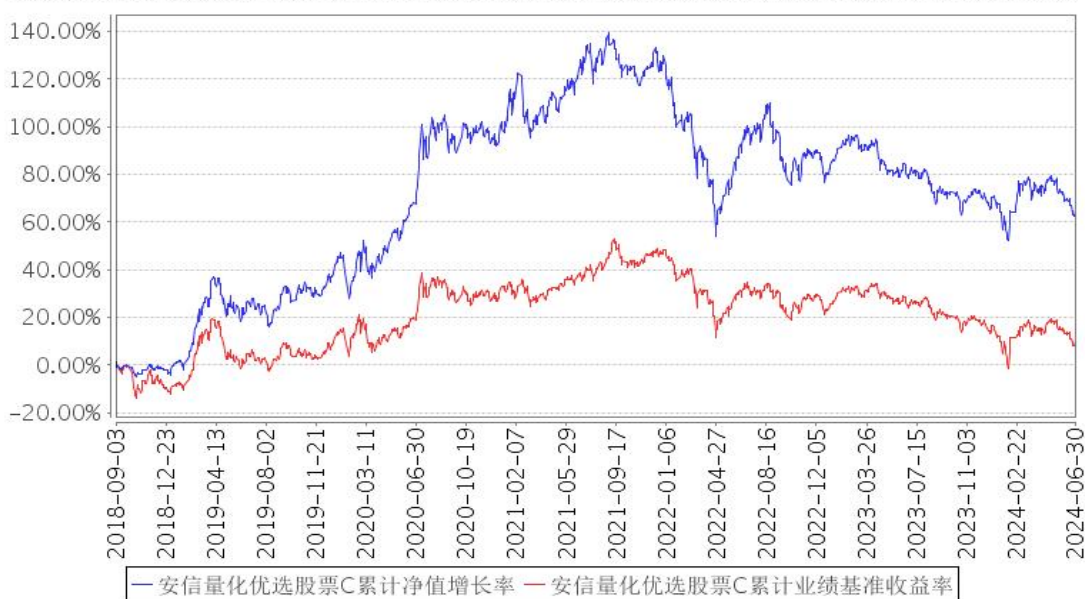


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信量化优选股票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



安信量化优选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2018 年 9 月 3 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 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、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 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		
朱舟扬	本基金的基金经理	2023 年 8 月 24 日	-	6 年	朱舟扬先生，哲学博士，曾任安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证 500 指数增强型证

					券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2024 年上半年，中国经济呈现出较为稳健的态势，政策层面保持了足够的定力，经济运行维持在温和复苏的轨道上。物价水平总体保持稳定，上半年国内生产总值（GDP）同比增长 5.0%，与市场先前的预期基本相符。在货币政策领域，整体环境依旧保持相对宽松。

然而，权益市场在这一时期经历了剧烈的波动。第一季度，股市迎来了近年来罕见的深 V 型

反弹。春节前，受多重因素影响，股市整体出现了较大的下跌，从风格角度分析，小盘股的跌幅远远超过了大盘股，红利型股票的表现相对较好。春节过后，股市触底并迅速反弹，小盘股的表现尤为突出。进入 3 月至 6 月，市场的波动性显著降低，宽基指数的表现呈现出大盘股优于小盘股，价值型股票优于成长型股票的风格特征。

本基金作为量化股票型基金，坚持宽基选股，淡化择时，通过数量化模型进行投资组合优化。主要投资目标是运用量化多因子模型，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、分析师预期，技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素构建相对基准有稳定超额收益的投资组合，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的。并根据开发的多指标体系灵活配置不同风格的量化选股策略。在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，力争实现基金财产的长期稳健增值。

#### 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优选股票 A 基金份额净值为 1.6687 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.03%；安信量化优选股票 C 基金份额净值为 1.6325 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.22%；同期业绩比较基准收益率为-6.96%。

#### 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 2024 年下半年，我国经济的增长潜力依旧庞大。为了充分激发这一潜力，我们必须致力于全面深化的改革，以应对内需放缓等挑战。房地产市场对经济整体运行的影响依然显著，尽管面临库存积压的问题，但我国拥有多样化的手段来应对和化解系统性风险。

此外，内循环的发展同样是一个不容忽视的焦点。通过促进消费，我们可以有效地提振经济活力，并推动形成积极的正向循环。在对外贸易方面，存在一些不确定性因素，需要我们密切关注。特别是下半年，美国的总统选举以及美联储可能的降息举措，都可能对我国的出口产生影响。

在下半年，我们将持续致力于优化和完善量化选股模型，以适应实际的宏观经济环境，并据此配置相应的量化投资策略。我们将特别关注那些具有高质量且估值合理的行业和公司，以期实现更为稳健的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 2 月 21 日至 2024 年 5 月 13 日。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2024 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：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,811,463.84	477,823.14
结算备付金		-	233,548.95
存出保证金		-	10,580.30
交易性金融资产	6.4.7.2	44,668,168.49	44,742,020.85
其中：股票投资		42,032,196.17	42,360,654.46
基金投资		-	-
债券投资		2,635,972.32	2,381,366.39
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		240.00	803.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		46,479,872.33	45,464,776.85
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	1,853.10
应付管理人报酬		47,219.67	46,215.48
应付托管费		7,869.94	7,702.60
应付销售服务费		4,996.51	5,890.35
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	157,118.79	186,399.92
负债合计		217,204.91	248,061.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	27,920,434.90	26,202,510.02
未分配利润	6.4.7.8	18,342,232.52	19,014,205.38
净资产合计		46,262,667.42	45,216,715.40
负债和净资产总计		46,479,872.33	45,464,776.85

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 27,920,434.90 份，其中安信量化优选股票 A 基金份额总额 18,870,039.39 份，基金份额净值 1.6687 元；安信量化优选股票 C 基金份额总额 9,050,395.51 份，基金份额净值 1.6325 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,749,699.73	496,801.87
1. 利息收入		6,176.54	6,130.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,176.54	5,992.05
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		-	138.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		801,931.27	-277,370.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	231,646.90	-655,007.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	20,938.71	41,558.98



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	-	-
股利收益	6.4.7.15	549,345.66	336,077.97
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	-2,607,575.80	726,268.69
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	49,768.26	41,773.33
<b>减：二、营业总支出</b>		382,941.59	485,929.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	272,014.22	348,098.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,335.64	58,016.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	31,898.39	29,952.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		311.11	1,577.90
其中：卖出回购金融资产支出		311.11	1,577.90
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	0.07
8. 其他费用	6.4.7.19	33,382.23	48,284.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,132,641.32	10,872.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,132,641.32	10,872.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-2,132,641.32	10,872.63

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	26,202,510.02	-	19,014,205.38	45,216,715.40

资产				
二、本期期初净资产	26,202,510.02	-	19,014,205.38	45,216,715.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,717,924.88	-	-671,972.86	1,045,952.02
(一)、综合收益总额	-	-	-2,132,641.32	-2,132,641.32
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,717,924.88	-	1,460,668.46	3,178,593.34
其中：1. 基金申购款	11,878,630.47	-	8,363,285.20	20,241,915.67
2. 基金赎回款	-10,160,705.59	-	-6,902,616.74	-17,063,322.33
(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	27,920,434.90	-	18,342,232.52	46,262,667.42
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,571,277.59	-	18,542,231.77	41,113,509.36
二、本期期初净资产	22,571,277.59	-	18,542,231.77	41,113,509.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,361,747.67	-	5,622,478.15	11,984,225.82
(一)、综合收益总额	-	-	10,872.63	10,872.63
(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)	6,361,747.67	-	5,611,605.52	11,973,353.19
其中：1. 基金申购款	16,654,839.76	-	15,162,376.26	31,817,216.02

2. 基金赎回款	-10,293,092.09	-	-9,550,770.74	-19,843,862.83
(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	28,933,025.26	-	24,164,709.92	53,097,735.18

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

安信量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2018 年 7 月 13 日下发的证监许可[2018]1119 号文关于“准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 8 月 28 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2018) 验字 60962175\_H12 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,026,300.59 份，其中认购资金利息折合 3.08 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》及《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》，安信量化优选股票型发起式证券投资基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，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《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、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它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述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：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

#### 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》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费附加，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费附加。

##### (3) 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。

#### （4）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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	407,190.34

等于：本金	407,153.91
加：应计利息	36.43
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	1,404,273.50
等于：本金	1,404,035.31
加：应计利息	238.19
减：坏账准备	-
合计	1,811,463.84

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,836,209.30	-	42,032,196.17	-2,804,013.13
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	33,122.32	2,635,972.32	3,780.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	33,122.32	2,635,972.32	3,780.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,435,279.30	33,122.32	44,668,168.49	-2,800,233.13

#### 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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	124,797.41
其中：交易所市场	124,797.41
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	24,863.02
应付审计费	7,458.36
合计	157,118.79

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信量化优选股票 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,150,031.20	16,150,031.20
本期申购	4,331,883.48	4,331,883.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,611,875.29	-1,611,875.29
本期末	18,870,039.39	18,870,039.39

##### 安信量化优选股票 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,052,478.82	10,052,478.82
本期申购	7,546,746.99	7,546,746.99
本期赎回（以“-”号填列）	-8,548,830.30	-8,548,830.30
本期末	9,050,395.51	9,050,395.51

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

##### 安信量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,791,374.96	3,140,753.30	11,932,128.26



本期期初	8,791,374.96	3,140,753.30	11,932,128.26
本期利润	501,729.12	-2,059,545.60	-1,557,816.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,654,222.01	589,172.39	2,243,394.40
其中：基金申购款	2,579,797.98	863,447.50	3,443,245.48
基金赎回款	-925,575.97	-274,275.11	-1,199,851.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,947,326.09	1,670,380.09	12,617,706.18

安信量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,150,700.91	1,931,376.21	7,082,077.12
本期期初	5,150,700.91	1,931,376.21	7,082,077.12
本期利润	-26,794.64	-548,030.20	-574,824.84
本期基金份额交易产生的变动数	-199,849.17	-582,876.77	-782,725.94
其中：基金申购款	3,621,899.97	1,298,139.75	4,920,039.72
基金赎回款	-3,821,749.14	-1,881,016.52	-5,702,765.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,924,057.10	800,469.24	5,724,526.34

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,718.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,737.54
结算备付金利息收入	1,659.08
其他	61.14
合计	6,176.54

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	216,156,322.20
减：卖出股票成本总额	215,490,586.27
减：交易费用	434,089.03
买卖股票差价收入	231,646.90

### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	21,759.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-820.52
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	20,938.71

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,896,061.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,862,203.10
减：应计利息总额	34,678.04
减：交易费用	0.44
买卖债券差价收入	-820.52

### 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

本基金于本期无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	549,345.66
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	549,345.66

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,607,575.80
股票投资	-2,611,879.99
债券投资	4,304.19
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	-2,607,575.80

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	49,768.26
合计	49,768.26

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	7,458.36
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,060.85
合计	33,382.23

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	433,930,330.17	100.00	42,622,611.30	7.76

#### 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 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	298,179.56	100.00	124,797.41	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国投证券	30,743.82	7.76	30,743.82	14.83

注：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。

### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	272,014.22
其中：应支付销售机构的客户维护 费	49,871.38	63,602.77
应支付基金管理人的净管理费	222,142.84	284,495.34

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 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	45,335.64

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 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 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		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	9,405.79	9,405.79
国投证券	-	21,539.04	21,539.04
合计	-	30,944.83	30,944.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	8,860.34	8,860.34
国投证券	-	20,014.07	20,014.07
合计	-	28,874.41	28,874.41

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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

安信量化优选股票 C

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	-	-	1,205,472.85	4.60

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	407,190.34	1,718.78	1,632,426.89	2,402.00
国投证券	1,404,273.50	2,737.54	-	-

注：本基金的活期银行存款由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（2024 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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 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约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

截至 2024 年 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（2023 年 12 月 31 日：0.0031%）。

##### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,635,972.32	1,564,834.25
合计	2,635,972.32	1,564,834.25

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,400.09
未评级	-	815,132.05
合计	-	816,532.14

- 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。货币资金、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 2024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	1,811,463.84	-	-	-	1,811,463.84
交易性金融资产	2,635,972.32	-	-	42,032,196.17	44,668,168.49
应收申购款	-	-	-	240.00	240.00
资产总计	4,447,436.16	-	-	42,032,436.17	46,479,872.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	47,219.67	47,219.67
应付托管费	-	-	-	7,869.94	7,869.94
应付销售服务费	-	-	-	4,996.51	4,996.51
其他负债	-	-	-	157,118.79	157,118.79
负债总计	-	-	-	217,204.91	217,204.91
利率敏感度缺口	4,447,436.16	-	-	41,815,231.26	46,262,667.42
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	477,823.14	-	-	-	477,823.14
结算备付金	233,548.95	-	-	-	233,548.95
存出保证金	10,580.30	-	-	-	10,580.30
交易性金融资产	2,379,966.30	-	1,400.09	42,360,654.46	44,742,020.85
应收申购款	-	-	-	803.61	803.61
资产总计	3,101,918.69	-	1,400.09	42,361,458.07	45,464,776.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,853.10	1,853.10
应付管理人报酬	-	-	-	46,215.48	46,215.48
应付托管费	-	-	-	7,702.60	7,702.60
应付销售服务费	-	-	-	5,890.35	5,890.35
其他负债	-	-	-	186,399.92	186,399.92
负债总计	-	-	-	248,061.45	248,061.45

利率敏感度缺口	3,101,918.69	-	1,400.09	42,113,396.62	45,216,715.40
---------	--------------	---	----------	---------------	---------------

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降25个基点	1,828.56	2,168.79
2. 市场利率上升25个基点	-1,824.09	-2,163.94	

#### 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。本基金股票投资占基金资产的比例为80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	42,032,196.17	90.86	42,360,654.46	93.68
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	42,032,196.17	90.86	42,360,654.46	93.68

#### 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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,887,831.90	1,548,291.74
2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,887,831.90	-1,548,291.74	

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

第一层次	42,032,196.17	42,360,654.46
第二层次	2,635,972.32	2,381,366.39
第三层次	-	-
合计	44,668,168.49	44,742,020.85

#### 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	42,032,196.17	90.43
	其中：股票	42,032,196.17	90.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,635,972.32	5.67
	其中：债券	2,635,972.32	5.67
	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	1,811,463.84	3.90
8	其他各项资产	240.00	0.00
9	合计	46,479,872.33	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	273,078.00	0.59
B	采矿业	3,152,286.00	6.81
C	制造业	28,537,727.30	61.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,022,768.00	4.37
E	建筑业	119,470.00	0.26
F	批发和零售业	1,186,718.72	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	829,789.20	1.79
H	住宿和餐饮业	104,975.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,152,075.50	4.65
J	金融业	1,978,661.20	4.28
K	房地产业	248,795.00	0.54
L	租赁和商务服务业	314,462.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	255,096.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	337,984.25	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,196.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	314,370.00	0.68
S	综合	183,744.00	0.40
	合计	42,032,196.17	90.86

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	21,000	766,500.00	1.66
2	000975	山金国际	44,600	726,534.00	1.57

3	600066	宇通客车	24,500	632,100.00	1.37
4	002028	思源电气	9,200	615,480.00	1.33
5	601058	赛轮轮胎	41,500	581,000.00	1.26
6	300394	天孚通信	6,520	576,498.40	1.25
7	600096	云天化	22,900	444,718.00	0.96
8	688169	石头科技	1,100	431,860.00	0.93
9	000423	东阿阿胶	6,700	419,420.00	0.91
10	002155	湖南黄金	23,000	416,300.00	0.90
11	000883	湖北能源	68,000	408,680.00	0.88
12	600873	梅花生物	38,000	380,760.00	0.82
13	600161	天坛生物	15,600	380,640.00	0.82
14	600988	赤峰黄金	22,600	369,284.00	0.80
15	601168	西部矿业	20,000	359,000.00	0.78
16	000400	许继电气	10,200	350,982.00	0.76
17	002517	恺英网络	33,800	322,790.00	0.70
18	300502	新易盛	3,000	316,650.00	0.68
19	000563	陕国投 A	114,000	313,500.00	0.68
20	601636	旗滨集团	48,100	310,245.00	0.67
21	688099	晶晨股份	5,200	308,464.00	0.67
22	601128	常熟银行	40,460	306,282.20	0.66
23	000933	神火股份	15,000	303,450.00	0.66
24	300724	捷佳伟创	5,400	291,654.00	0.63
25	002128	电投能源	13,800	291,180.00	0.63
26	002056	横店东磁	22,300	278,081.00	0.60
27	002273	水晶光电	16,200	275,076.00	0.59
28	002558	巨人网络	28,900	272,816.00	0.59
29	002608	江苏国信	34,600	268,150.00	0.58
30	688188	柏楚电子	1,436	265,013.80	0.57
31	002572	索菲亚	17,000	260,610.00	0.56
32	002078	太阳纸业	18,600	259,470.00	0.56
33	000739	普洛药业	18,500	251,045.00	0.54
34	688281	华秦科技	2,860	238,295.20	0.52
35	300001	特锐德	11,500	231,380.00	0.50
36	002223	鱼跃医疗	6,100	229,360.00	0.50
37	688276	百克生物	8,000	226,960.00	0.49
38	600765	中航重机	11,100	226,440.00	0.49
39	002422	科伦药业	7,200	218,376.00	0.47
40	603568	伟明环保	10,500	216,090.00	0.47
41	601717	郑煤机	14,600	216,080.00	0.47
42	002429	兆驰股份	44,700	215,007.00	0.46
43	600398	海澜之家	23,000	212,520.00	0.46
44	600839	四川长虹	46,900	210,581.00	0.46
45	603939	益丰药房	8,448	207,398.40	0.45



46	600985	淮北矿业	12,200	204,228.00	0.44
47	002195	岩山科技	80,900	203,059.00	0.44
48	603786	科博达	3,100	198,865.00	0.43
49	688778	厦钨新能	6,318	197,374.32	0.43
50	688516	奥特维	4,700	196,507.00	0.42
51	002340	格林美	30,200	192,374.00	0.42
52	600153	建发股份	21,400	191,102.00	0.41
53	002966	苏州银行	24,900	186,750.00	0.40
54	300761	立华股份	8,200	185,648.00	0.40
55	300679	电连技术	4,600	185,058.00	0.40
56	600673	东阳光	26,100	183,744.00	0.40
57	600157	永泰能源	154,700	182,546.00	0.39
58	002138	顺络电子	6,600	181,236.00	0.39
59	601139	深圳燃气	27,100	181,028.00	0.39
60	600521	华海药业	10,600	180,730.00	0.39
61	000887	中鼎股份	14,600	178,704.00	0.39
62	300866	安克创新	2,500	178,025.00	0.38
63	300146	汤臣倍健	13,100	177,505.00	0.38
64	688008	澜起科技	3,100	177,196.00	0.38
65	003006	百亚股份	7,400	175,380.00	0.38
66	002532	天山铝业	21,600	175,176.00	0.38
67	002928	华夏航空	27,400	173,716.00	0.38
68	300017	网宿科技	21,900	173,010.00	0.37
69	603871	嘉友国际	9,780	173,008.20	0.37
70	002053	云南能投	14,300	172,887.00	0.37
71	002756	永兴材料	4,800	171,744.00	0.37
72	300181	佐力药业	11,300	170,856.00	0.37
73	000683	远兴能源	24,700	170,677.00	0.37
74	688002	睿创微纳	6,100	170,617.00	0.37
75	000539	粤电力 A	33,300	169,164.00	0.37
76	000958	电投产融	45,500	166,530.00	0.36
77	603605	珀莱雅	1,500	166,485.00	0.36
78	603658	安图生物	3,600	165,852.00	0.36
79	688076	诺泰生物	2,105	164,779.40	0.36
80	002595	豪迈科技	4,300	164,131.00	0.35
81	605305	中际联合	6,340	163,508.60	0.35
82	600862	中航高科	8,700	163,386.00	0.35
83	300790	宇瞳光学	12,100	163,350.00	0.35
84	300357	我武生物	8,000	161,760.00	0.35
85	002008	大族激光	7,700	160,160.00	0.35
86	300673	佩蒂股份	12,200	160,064.00	0.35
87	300783	三只松鼠	7,300	159,651.00	0.35
88	002984	森麒麟	6,500	156,585.00	0.34

89	603558	健盛集团	15,700	156,215.00	0.34
90	600497	驰宏锌锗	29,200	155,928.00	0.34
91	603866	桃李面包	30,400	154,128.00	0.33
92	600529	山东药玻	6,000	152,040.00	0.33
93	601198	东兴证券	19,100	152,036.00	0.33
94	600549	厦门钨业	8,800	151,800.00	0.33
95	603338	浙江鼎力	2,500	151,050.00	0.33
96	300628	亿联网络	4,100	150,757.00	0.33
97	002831	裕同科技	5,800	148,422.00	0.32
98	605007	五洲特纸	11,700	147,771.00	0.32
99	002906	华阳集团	5,500	147,180.00	0.32
100	603606	东方电缆	3,000	146,430.00	0.32
101	300568	星源材质	17,800	145,960.00	0.32
102	300677	英科医疗	5,400	144,774.00	0.31
103	601990	南京证券	18,800	144,384.00	0.31
104	603160	汇顶科技	2,100	144,375.00	0.31
105	600737	中粮糖业	15,000	143,850.00	0.31
106	003000	劲仔食品	11,900	143,395.00	0.31
107	002958	青农商行	53,500	143,380.00	0.31
108	002152	广电运通	13,700	143,302.00	0.31
109	002601	龙佰集团	7,700	142,989.00	0.31
110	300012	华测检测	14,200	142,852.00	0.31
111	002600	领益智造	20,000	142,400.00	0.31
112	600566	济川药业	4,400	139,524.00	0.30
113	002738	中矿资源	5,200	139,360.00	0.30
114	603026	石大胜华	4,100	138,580.00	0.30
115	600655	豫园股份	26,900	138,535.00	0.30
116	603826	坤彩科技	4,780	138,476.60	0.30
117	600482	中国动力	7,100	138,308.00	0.30
118	603816	顾家家居	4,200	135,618.00	0.29
119	600486	扬农化工	2,400	135,480.00	0.29
120	603596	伯特利	3,480	135,372.00	0.29
121	002262	恩华药业	5,600	132,944.00	0.29
122	601577	长沙银行	15,800	129,244.00	0.28
123	601666	平煤股份	11,500	128,800.00	0.28
124	603650	彤程新材	4,300	127,065.00	0.27
125	300474	景嘉微	2,000	126,460.00	0.27
126	603688	石英股份	4,250	125,842.50	0.27
127	600298	安琪酵母	4,500	125,685.00	0.27
128	600299	安迪苏	12,900	125,130.00	0.27
129	600038	中直股份	3,000	123,330.00	0.27
130	601233	桐昆股份	7,700	122,892.00	0.27
131	300058	蓝色光标	21,900	119,136.00	0.26

132	002472	双环传动	5,400	118,908.00	0.26
133	601991	大唐发电	39,100	117,691.00	0.25
134	600535	天士力	9,300	116,994.00	0.25
135	000066	中国长城	13,300	116,375.00	0.25
136	600160	巨化股份	4,800	115,824.00	0.25
137	001203	大中矿业	12,000	115,320.00	0.25
138	300251	光线传媒	13,600	114,376.00	0.25
139	300037	新宙邦	4,000	114,240.00	0.25
140	002372	伟星新材	7,400	114,108.00	0.25
141	000591	太阳能	24,200	113,982.00	0.25
142	603233	大参林	7,900	112,970.00	0.24
143	000598	兴蓉环境	14,700	110,544.00	0.24
144	002653	海思科	3,600	110,520.00	0.24
145	002557	洽洽食品	3,900	109,941.00	0.24
146	600316	洪都航空	6,600	109,758.00	0.24
147	601000	唐山港	22,800	107,160.00	0.23
148	603883	老百姓	5,770	105,937.20	0.23
149	600258	首旅酒店	8,500	104,975.00	0.23
150	600004	白云机场	11,000	104,280.00	0.23
151	600863	内蒙华电	22,000	102,080.00	0.22
152	600925	苏能股份	19,600	98,980.00	0.21
153	601958	金钼股份	9,500	98,895.00	0.21
154	603927	中科软	5,400	97,686.00	0.21
155	002568	百润股份	5,800	97,614.00	0.21
156	601966	玲珑轮胎	5,300	97,361.00	0.21
157	300009	安科生物	11,300	96,502.00	0.21
158	688578	艾力斯	1,500	95,610.00	0.21
159	603228	景旺电子	3,000	95,400.00	0.21
160	002185	华天科技	11,700	95,355.00	0.21
161	301308	江波龙	1,000	94,740.00	0.20
162	002409	雅克科技	1,500	94,365.00	0.20
163	002019	亿帆医药	7,600	93,936.00	0.20
164	600563	法拉电子	1,200	91,416.00	0.20
165	600663	陆家嘴	10,300	90,846.00	0.20
166	002444	巨星科技	3,600	88,920.00	0.19
167	300487	蓝晓科技	2,100	87,696.00	0.19
168	600598	北大荒	7,000	87,430.00	0.19
169	603379	三美股份	2,200	86,108.00	0.19
170	002032	苏泊尔	1,700	85,170.00	0.18
171	688728	格科微	7,014	84,939.54	0.18
172	688180	君实生物	2,900	84,245.00	0.18
173	002508	老板电器	3,800	83,980.00	0.18
174	600928	西安银行	25,500	83,385.00	0.18

175	603156	养元饮品	3,900	82,953.00	0.18
176	603893	瑞芯微	1,400	82,838.00	0.18
177	600739	辽宁成大	9,800	82,026.00	0.18
178	300529	健帆生物	3,000	81,630.00	0.18
179	300558	贝达药业	2,500	81,375.00	0.18
180	600511	国药股份	2,600	80,054.00	0.17
181	000703	恒逸石化	11,200	79,408.00	0.17
182	000830	鲁西化工	6,800	78,812.00	0.17
183	600062	华润双鹤	4,000	78,320.00	0.17
184	000089	深圳机场	12,200	77,958.00	0.17
185	600901	江苏金租	15,400	77,770.00	0.17
186	603885	吉祥航空	6,900	75,831.00	0.16
187	601700	风范股份	17,200	75,508.00	0.16
188	688234	天岳先进	1,600	75,072.00	0.16
189	688220	翱捷科技	2,000	74,920.00	0.16
190	688520	神州细胞	1,900	74,765.00	0.16
191	600095	湘财股份	12,500	74,500.00	0.16
192	688331	荣昌生物	1,700	73,440.00	0.16
193	601127	赛力斯	800	72,896.00	0.16
194	688390	固德威	1,280	71,833.60	0.16
195	300207	欣旺达	4,700	71,299.00	0.15
196	000709	河钢股份	36,600	71,004.00	0.15
197	300397	天和防务	7,700	70,840.00	0.15
198	300916	朗特智能	2,800	70,504.00	0.15
199	300881	盛德鑫泰	2,700	69,363.00	0.15
200	000426	兴业银锡	5,100	69,258.00	0.15
201	603221	爱丽家居	7,800	69,186.00	0.15
202	605376	博迁新材	3,000	67,710.00	0.15
203	002244	滨江集团	9,300	67,518.00	0.15
204	300979	华利集团	1,100	66,935.00	0.14
205	300026	红日药业	21,800	66,490.00	0.14
206	600704	物产中大	15,200	65,968.00	0.14
207	300492	华图山鼎	700	65,940.00	0.14
208	688359	三孚新科	1,600	64,000.00	0.14
209	688819	天能股份	2,600	62,036.00	0.13
210	002865	钧达股份	1,600	61,408.00	0.13
211	688208	道通科技	2,500	60,350.00	0.13
212	688387	信科移动	11,900	59,976.00	0.13
213	000027	深圳能源	8,200	59,860.00	0.13
214	600977	中国电影	5,500	59,180.00	0.13
215	002203	海亮股份	7,300	58,254.00	0.13
216	601997	贵阳银行	11,000	57,970.00	0.13
217	600707	彩虹股份	8,500	57,885.00	0.13

218	601216	君正集团	15,500	57,195.00	0.12
219	600967	内蒙一机	7,900	56,880.00	0.12
220	300144	宋城演艺	7,000	56,210.00	0.12
221	002867	周大生	4,300	56,158.00	0.12
222	300776	帝尔激光	1,200	55,152.00	0.12
223	601231	环旭电子	3,400	54,570.00	0.12
224	688506	百利天恒	300	54,420.00	0.12
225	601928	凤凰传媒	4,900	53,704.00	0.12
226	601615	明阳智能	5,600	52,864.00	0.11
227	600517	国网英大	12,200	52,826.00	0.11
228	600499	科达制造	6,200	52,266.00	0.11
229	600143	金发科技	7,900	52,219.00	0.11
230	000050	深天马 A	7,000	50,960.00	0.11
231	600170	上海建工	23,600	50,740.00	0.11
232	600582	天地科技	7,300	50,297.00	0.11
233	600528	中铁工业	6,800	49,776.00	0.11
234	688375	国博电子	700	49,448.00	0.11
235	002215	诺普信	6,400	47,680.00	0.10
236	600126	杭钢股份	11,200	46,032.00	0.10
237	600377	宁沪高速	3,400	42,840.00	0.09
238	002563	森马服饰	6,900	40,089.00	0.09
239	601989	中国重工	8,100	39,933.00	0.09
240	000630	铜陵有色	11,000	39,710.00	0.09
241	600938	中国海油	1,200	39,600.00	0.09
242	300253	卫宁健康	6,100	35,990.00	0.08
243	601108	财通证券	5,300	35,033.00	0.08
244	600642	申能股份	3,900	34,437.00	0.07
245	000930	中粮科技	6,800	34,204.00	0.07
246	000878	云南铜业	2,700	33,642.00	0.07
247	688538	和辉光电	16,900	33,462.00	0.07
248	688029	南微医学	542	33,365.52	0.07
249	603056	德邦股份	2,500	32,750.00	0.07
250	600879	航天电子	4,200	32,634.00	0.07
251	688286	敏芯股份	683	32,510.80	0.07
252	000039	中集集团	3,500	32,410.00	0.07
253	000728	国元证券	5,200	31,512.00	0.07
254	600699	均胜电子	2,100	31,122.00	0.07
255	600998	九州通	6,324	30,861.12	0.07
256	300699	光威复材	1,200	29,796.00	0.06
257	002294	信立泰	1,100	29,293.00	0.06
258	300390	天华新能	1,700	29,206.00	0.06
259	300383	光环新网	3,400	28,730.00	0.06
260	301282	金禄电子	1,200	28,536.00	0.06

261	300748	金力永磁	2,200	28,512.00	0.06
262	605258	协和电子	900	28,224.00	0.06
263	000825	太钢不锈	8,300	28,054.00	0.06
264	000581	威孚高科	1,700	27,676.00	0.06
265	601061	中信金属	4,000	27,480.00	0.06
266	001872	招商港口	1,400	26,950.00	0.06
267	600959	江苏有线	10,200	26,928.00	0.06
268	000025	特力A	2,000	26,880.00	0.06
269	000623	吉林敖东	2,000	26,800.00	0.06
270	600315	上海家化	1,500	26,670.00	0.06
271	002065	东华软件	5,900	26,668.00	0.06
272	688601	力芯微	600	26,214.00	0.06
273	002857	三晖电气	1,900	26,201.00	0.06
274	001914	招商积余	2,600	26,052.00	0.06
275	600282	南钢股份	5,200	25,896.00	0.06
276	600895	张江高科	1,400	25,872.00	0.06
277	002533	金杯电工	2,600	25,870.00	0.06
278	002571	德力股份	5,300	25,811.00	0.06
279	300752	隆利科技	1,900	25,802.00	0.06
280	301338	凯格精机	800	25,704.00	0.06
281	600167	联美控股	4,900	25,529.00	0.06
282	002139	拓邦股份	2,400	25,488.00	0.06
283	600820	隧道股份	3,900	25,467.00	0.06
284	000977	浪潮信息	700	25,459.00	0.06
285	601633	长城汽车	1,000	25,300.00	0.05
286	300115	长盈精密	2,100	25,179.00	0.05
287	000063	中兴通讯	900	25,173.00	0.05
288	601601	中国太保	900	25,074.00	0.05
289	002534	西子洁能	2,500	25,025.00	0.05
290	002267	陕天然气	3,300	24,948.00	0.05
291	002655	共达电声	2,300	24,840.00	0.05
292	601318	中国平安	600	24,816.00	0.05
293	688061	灿瑞科技	900	24,732.00	0.05
294	688425	铁建重工	6,700	24,656.00	0.05
295	600380	健康元	2,200	24,574.00	0.05
296	603368	柳药集团	1,400	24,500.00	0.05
297	688352	颀中科技	2,144	24,463.04	0.05
298	600118	中国卫星	1,100	24,453.00	0.05
299	000758	中色股份	4,800	24,384.00	0.05
300	600056	中国医药	2,400	24,288.00	0.05
301	600623	华谊集团	4,200	24,276.00	0.05
302	688312	燕麦科技	1,000	24,250.00	0.05
303	300428	立中集团	1,300	24,167.00	0.05

304	300539	横河精密	3,000	24,150.00	0.05
305	300194	福安药业	6,400	23,936.00	0.05
306	000987	越秀资本	4,800	23,808.00	0.05
307	002788	鹭燕医药	3,000	23,640.00	0.05
308	600208	新湖中宝	14,800	23,384.00	0.05
309	300842	帝科股份	600	23,280.00	0.05
310	601311	骆驼股份	2,900	23,258.00	0.05
311	600887	伊利股份	900	23,256.00	0.05
312	600352	浙江龙盛	2,700	23,193.00	0.05
313	603212	赛伍技术	2,100	23,184.00	0.05
314	300102	乾照光电	3,600	23,112.00	0.05
315	002988	豪美新材	1,500	23,025.00	0.05
316	688036	传音控股	300	22,962.00	0.05
317	688181	八亿时空	1,209	22,910.55	0.05
318	002506	协鑫集成	11,700	22,698.00	0.05
319	603595	东尼电子	1,100	22,649.00	0.05
320	601106	中国一重	9,800	22,638.00	0.05
321	601568	北元集团	6,100	22,631.00	0.05
322	688141	杰华特	1,400	22,624.00	0.05
323	300004	南风股份	5,200	22,568.00	0.05
324	002926	华西证券	3,400	22,406.00	0.05
325	600711	盛屯矿业	6,100	22,387.00	0.05
326	688349	三一重能	900	22,356.00	0.05
327	300396	迪瑞医疗	1,100	22,341.00	0.05
328	000513	丽珠集团	600	22,326.00	0.05
329	002892	科力尔	2,320	22,272.00	0.05
330	688418	震有科技	1,300	22,269.00	0.05
331	000636	风华高科	1,700	22,202.00	0.05
332	300984	金沃股份	1,000	22,190.00	0.05
333	002202	金风科技	3,300	22,176.00	0.05
334	300978	东箭科技	2,400	22,152.00	0.05
335	600885	宏发股份	800	22,144.00	0.05
336	688170	德龙激光	1,005	22,130.10	0.05
337	002939	长城证券	3,300	22,110.00	0.05
338	603380	易德龙	1,100	22,088.00	0.05
339	000738	航发控制	1,100	22,077.00	0.05
340	002266	浙富控股	7,900	22,041.00	0.05
341	002380	科远智慧	1,200	21,960.00	0.05
341	300731	科创新源	1,500	21,960.00	0.05
342	688069	德林海	1,631	21,920.64	0.05
343	600909	华安证券	5,200	21,892.00	0.05
344	688021	奥福环保	2,373	21,831.60	0.05
345	600166	福田汽车	9,700	21,825.00	0.05

346	002123	梦网科技	3,100	21,793.00	0.05
347	600626	申达股份	9,000	21,780.00	0.05
348	688380	中微半导	1,300	21,736.00	0.05
349	688079	美迪凯	2,908	21,577.36	0.05
350	301011	华立科技	1,400	21,574.00	0.05
351	300518	新讯达	2,900	21,547.00	0.05
352	603929	亚翔集成	900	21,510.00	0.05
353	600941	中国移动	200	21,500.00	0.05
354	688328	深科达	1,508	21,458.84	0.05
355	300451	创业慧康	6,200	21,452.00	0.05
356	002369	卓翼科技	5,800	21,402.00	0.05
357	603098	森特股份	2,700	21,222.00	0.05
358	603158	腾龙股份	3,000	21,120.00	0.05
359	000596	古井贡酒	100	21,107.00	0.05
360	688768	容知日新	900	21,069.00	0.05
361	688045	必易微	700	21,049.00	0.05
362	300379	东方通	2,600	21,008.00	0.05
363	300868	杰美特	1,000	20,950.00	0.05
364	002797	第一创业	4,100	20,869.00	0.05
365	300472	新元科技	4,700	20,821.00	0.05
366	300533	冰川网络	1,500	20,820.00	0.05
367	002201	正威新材	4,400	20,812.00	0.04
368	002064	华峰化学	2,900	20,793.00	0.04
369	688291	金橙子	1,205	20,750.10	0.04
370	301193	家联科技	1,300	20,748.00	0.04
371	603803	瑞斯康达	2,900	20,590.00	0.04
372	688338	赛科希德	951	20,589.15	0.04
373	688619	罗普特	2,928	20,583.84	0.04
374	000892	欢瑞世纪	8,200	20,500.00	0.04
375	002174	游族网络	2,700	20,493.00	0.04
376	300299	富春股份	5,900	20,473.00	0.04
377	688475	萤石网络	600	20,466.00	0.04
378	002549	凯美特气	4,000	20,440.00	0.04
379	600956	新天绿能	2,500	20,425.00	0.04
380	603177	德创环保	2,900	20,387.00	0.04
381	688478	晶升股份	700	20,384.00	0.04
382	002697	红旗连锁	4,400	20,372.00	0.04
383	603629	利通电子	1,100	20,306.00	0.04
384	600960	渤海汽车	7,600	20,216.00	0.04
385	002607	中公教育	13,200	20,196.00	0.04
386	002529	海源复材	3,900	20,124.00	0.04
386	601399	国机重装	7,800	20,124.00	0.04
387	688680	海优新材	700	20,118.00	0.04



388	603617	君禾股份	3,400	20,060.00	0.04
389	000509	华塑控股	7,800	20,046.00	0.04
390	688156	路德环境	1,507	19,937.61	0.04
391	600008	首创环保	7,400	19,832.00	0.04
392	688448	磁谷科技	1,047	19,767.36	0.04
393	688307	中润光学	953	19,717.57	0.04
394	300791	仙乐健康	780	19,656.00	0.04
395	002291	遥望科技	4,500	19,350.00	0.04
396	000663	永安林业	4,600	19,274.00	0.04
397	603868	飞科电器	500	19,200.00	0.04
398	688622	禾信仪器	1,194	19,104.00	0.04
399	688253	英诺特	500	19,055.00	0.04
400	600871	石化油服	10,800	18,792.00	0.04
401	601965	中国汽研	1,100	18,579.00	0.04
402	000967	盈峰环境	4,300	18,189.00	0.04
403	603858	步长制药	1,200	18,180.00	0.04
404	300114	中航电测	400	18,100.00	0.04
405	300386	飞天诚信	1,700	17,697.00	0.04
406	300676	华大基因	500	17,505.00	0.04
407	601016	节能风电	5,800	17,342.00	0.04
408	001309	德明利	200	17,280.00	0.04
409	300266	兴源环境	14,800	17,168.00	0.04
410	000778	新兴铸管	4,500	15,660.00	0.03
411	601298	青岛港	1,600	15,296.00	0.03
412	601939	建设银行	2,000	14,800.00	0.03
413	601857	中国石油	1,300	13,416.00	0.03
414	000898	鞍钢股份	6,300	13,356.00	0.03
415	301360	荣旗科技	300	12,975.00	0.03
416	688699	明微电子	400	12,700.00	0.03
417	301255	通力科技	400	12,472.00	0.03
418	300241	瑞丰光电	3,000	12,300.00	0.03
419	688025	杰普特	300	12,117.00	0.03
420	600848	上海临港	1,300	11,843.00	0.03
421	600114	东睦股份	800	11,512.00	0.02
422	603015	弘讯科技	1,500	11,340.00	0.02
423	300331	苏大维格	700	11,256.00	0.02
424	600882	妙可蓝多	900	11,223.00	0.02
425	688484	南芯科技	300	11,130.00	0.02
426	601138	工业富联	400	10,960.00	0.02
427	000536	华映科技	5,400	10,908.00	0.02
428	300499	高澜股份	1,000	10,840.00	0.02
429	603269	海鸥股份	1,100	10,802.00	0.02
430	000153	丰原药业	2,000	10,760.00	0.02

431	300011	鼎汉技术	2,100	10,479.00	0.02
432	002858	力盛体育	1,000	10,400.00	0.02
433	003003	天元股份	1,300	10,361.00	0.02
434	000959	首钢股份	3,800	10,336.00	0.02
435	688046	药康生物	1,000	10,220.00	0.02
436	688118	普元信息	700	10,101.00	0.02
437	300203	聚光科技	1,000	10,090.00	0.02
438	002686	亿利达	2,400	10,056.00	0.02
439	688435	英方软件	400	9,984.00	0.02
440	002825	纳尔股份	1,600	9,968.00	0.02
441	002786	银宝山新	1,200	9,624.00	0.02
442	300158	振东制药	2,500	9,550.00	0.02
443	002178	延华智能	2,400	8,712.00	0.02
444	600053	九鼎投资	600	8,322.00	0.02
445	600784	鲁银投资	1,700	8,058.00	0.02
446	301219	腾远钴业	200	7,652.00	0.02
447	000333	美的集团	100	6,450.00	0.01
448	002313	日海智能	900	6,156.00	0.01
449	002423	中粮资本	800	5,992.00	0.01
450	002010	传化智联	1,100	4,224.00	0.01
451	603408	建霖家居	300	3,957.00	0.01
452	000897	津滨发展	1,600	3,280.00	0.01
453	601668	中国建筑	100	531.00	0.00
454	688526	科前生物	35	514.15	0.00
455	688088	虹软科技	16	461.76	0.00
456	688223	晶科能源	21	149.10	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	2,141,803.00	4.74
2	300394	天孚通信	1,492,130.00	3.30
3	300750	宁德时代	1,425,328.00	3.15
4	601058	赛轮轮胎	1,294,632.00	2.86
5	000975	山金国际	1,243,004.00	2.75
6	600066	宇通客车	1,221,127.00	2.70
7	601318	中国平安	1,200,217.00	2.65
8	002028	思源电气	1,178,370.00	2.61
9	002463	沪电股份	1,135,113.00	2.51
10	601168	西部矿业	1,124,835.00	2.49
11	600036	招商银行	1,028,082.00	2.27

12	688169	石头科技	973,680.84	2.15
13	600398	海澜之家	965,338.00	2.13
14	002078	太阳纸业	941,646.00	2.08
15	002517	恺英网络	935,315.00	2.07
16	600988	赤峰黄金	925,275.00	2.05
17	600161	天坛生物	917,531.00	2.03
18	601000	唐山港	866,377.00	1.92
19	600873	梅花生物	847,102.00	1.87
20	000933	神火股份	835,849.00	1.85

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,225,575.00	4.92
2	300750	宁德时代	1,483,026.00	3.28
3	601318	中国平安	1,270,884.00	2.81
4	600153	建发股份	1,145,348.00	2.53
5	600036	招商银行	1,104,342.00	2.44
6	601058	赛轮轮胎	1,018,542.00	2.25
7	300394	天孚通信	968,983.00	2.14
8	601000	唐山港	918,276.00	2.03
9	002463	沪电股份	870,427.00	1.93
10	601168	西部矿业	816,362.00	1.81
11	600985	淮北矿业	813,142.00	1.80
12	600863	内蒙华电	812,634.00	1.80
13	000933	神火股份	812,112.00	1.80
14	600398	海澜之家	796,120.00	1.76
15	601077	渝农商行	794,479.00	1.76
16	600282	南钢股份	775,759.00	1.72
17	000333	美的集团	775,272.00	1.71
18	600737	中粮糖业	763,948.00	1.69
19	600161	天坛生物	755,386.00	1.67
20	601666	平煤股份	753,291.00	1.67

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	217,774,007.97
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	216,156,322.20
--------------	----------------

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,635,972.32	5.70
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	2,635,972.32	5.70

### 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	019709	23 国债 16	15,000	1,523,422.60	3.29
2	019733	24 国债 02	10,000	1,010,730.68	2.18
3	019727	23 国债 24	1,000	101,819.04	0.22

### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

本基金将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思源电气（代码：002028 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. 思源电气股份有限公司

2023 年 11 月 10 日，思源电气股份有限公司因违反交通法规被中华人民共和国洋山港海事局罚款。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	240.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	240.00

### 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

本基金本报告期末前十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 (%)
安信量化优选股票 A	452	41,747.87	0.00	0.00	18,870,039.39	100.00
安信量化优选股票 C	3,165	2,859.52	0.00	0.00	9,050,395.51	100.00
合计	3,577	7,805.55	0.00	0.00	27,920,434.90	100.00

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	安信量化优选股票 A	142,279.36	0.75
	安信量化优选股票 C	-	-
	合计	142,279.36	0.51

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	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化优选股票 A	0~10
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日 (2018 年 9 月 3 日) 基金份额总额	10,000,297.54	26,003.05
本报告期期初基金份额总额	16,150,031.20	10,052,478.82
本报告期基金总申购份额	4,331,883.48	7,546,746.99
减：本报告期基金总赎回份额	1,611,875.29	8,548,830.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,870,039.39	9,050,395.51

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

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期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

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

#### 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 (%)	
国投证券	4	433,930,330.17	100.00	298,179.56	100.00	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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租用证券公司交易单元的选择标准和程序规定。基金管理人综合考虑券商的研究能力后，确定证券公司的选择，并与被选择的证券公司签订协议。本基金自 2024 年 3 月 18 日转换为券商结算模式，本报告期本基金选择国投证券作为证券经纪商。

### 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 (%)
国投证券	3,114,618.50	100.00	3,600,000.00	100.00	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
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提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日
2	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 19 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
6	安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	上海证券报	2024 年 3 月 15 日
7	安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	上海证券报	2024 年 3 月 19 日
8	安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议及招募说明书提示性公告	上海证券报	2024 年 3 月 19 日
9	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年年度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 28 日
11	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 19 日
12	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
13	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

本基金管理人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

2024 年 8 月 29 日