

# 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 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：招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。

基金托管人招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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>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真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<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	37
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48

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	48
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	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	市场中性策略执行情况	49
7.13	投资组合报告附注	49
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>50</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	51
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>51</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>51</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	53
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>54</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	54
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	55
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>55</b>
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	安信阿尔法定开混合	
基金主代码	005280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,098,609.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
下属分级基金的交易代码	005280	009624
报告期末下属分级基金的份额总额	24,813,195.63 份	19,285,414.10 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用 Alpha 多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建 Alpha 股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	<p>本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。</p> <p>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。</p>

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	张姗
	联系电话	0755-82509999	400-61-95555
	电子邮箱	service@essencefund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008-088-088	400-61-95555
传真		0755-82799292	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		刘入领	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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)	
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
本期已实现收益	-39,718.29	-49,513.83
本期利润	389,938.67	175,308.63
加权平均基金份额本期利润	0.0133	0.0103
本期加权平均净值利润率	1.12%	0.88%
本期基金份额净值增长率	1.14%	0.84%

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	4,409,407.35	2,875,631.42
期末可供分配基金份额利润	0.1777	0.1491
期末基金资产净值	29,636,612.75	22,489,141.31
期末基金份额净值	1.1944	1.1661
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	19.44%	6.27%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信阿尔法定开混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.61%	0.19%	0.12%	0.00%	0.49%	0.19%
过去三个月	0.40%	0.20%	0.37%	0.00%	0.03%	0.20%
过去六个月	1.14%	0.24%	0.75%	0.01%	0.39%	0.23%
过去一年	0.02%	0.19%	1.50%	0.00%	-1.48%	0.19%
过去三年	-1.66%	0.19%	4.50%	0.00%	-6.16%	0.19%
自基金合同生效起至今	19.44%	0.20%	9.86%	0.00%	9.58%	0.20%

安信阿尔法定开混合 C

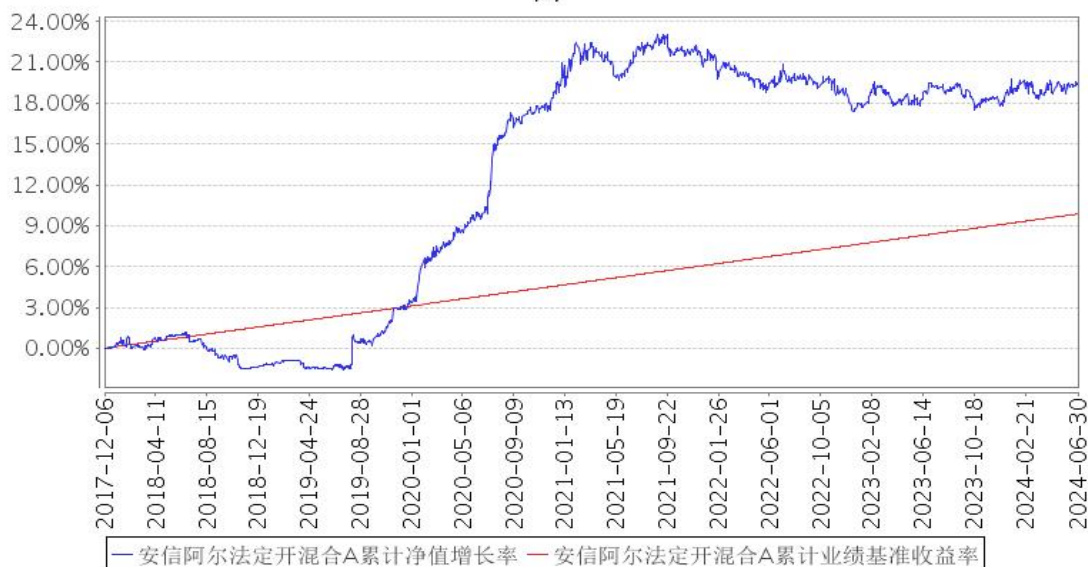
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	0.19%	0.12%	0.00%	0.44%	0.19%

过去三个月	0.24%	0.20%	0.37%	0.00%	-0.13%	0.20%
过去六个月	0.84%	0.24%	0.75%	0.01%	0.09%	0.23%
过去一年	-0.60%	0.19%	1.50%	0.00%	-2.10%	0.19%
过去三年	-3.42%	0.19%	4.50%	0.00%	-7.92%	0.19%
自基金合同生效起 至今	6.27%	0.22%	6.08%	0.00%	0.19%	0.22%

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

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

安信阿尔法定开混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





安信阿尔法定开混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 日。

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

3、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，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		
邱家庆	本基金的基金经理	2023 年 9 月 12 日	-	12 年	邱家庆先生，经济学硕士，历任安信基金管理有限责任公司特定资产管理部研究员，华润元大基金管理有限公司基金投资管理部基金经理助理，五矿证券有限公司总部资管量化投资部投资主办人、量化团队负责人，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理、量化投资部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信稳健阿尔法定期开放混合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

本基金主要采用对冲策略，构建完组合底仓后，运用股指期货对冲系统性风险。

2024 年一季度由于雪球大面积敲入、券商 DMA 交易等因素影响，股指期货基差出现大幅波动。产品按照交易计划在基差扩大过程中逐步降低对冲仓位，在基差回升过程中逐步增加对冲仓位。二季度，市场先上后下，市场风格也在大小盘、价值成长之间快速切换。我们坚持均衡投资策略，组合表现平稳。

对冲策略在基差方面经历了较大挑战，上半年股指贴水较大，为了控制回撤，我们进行了积极的基差管理操作，大幅降低了对冲仓位，事前降低了基差潜在扰动。虽然事后来看，组合的超额收益远高于基差损失，覆盖了对冲成本，产品取得了正收益，但从历史规律来看，基差管理策略是控制回撤的有效手段，我们会继续坚持这一策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信阿尔法定开混合 A 基金份额净值为 1.1944 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.14%；安信阿尔法定开混合 C 基金份额净值为 1.1661 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%；同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国降息预期趋于一致，海外流动性压力放缓，但是随着大选时间临近，政治不确定性将向全球传导。国内经济企稳恢复过程中的各种不确定性都可能放大 A 股波动，市场风格快速切换的概率增大，我们将继续延续均衡投资策略。

当前负基差处于比较高的位置，对冲策略处于中低仓位，我们会依据量化模型监控基差的波动，等待基差缩小后，择机增加对冲仓位。多头敞口方面，我们会依据市场强度进行动态变化。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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	3,488,617.54	3,441,409.60
结算备付金		7,921,140.76	3,627,429.02
存出保证金		3,033,795.40	4,699,208.62
交易性金融资产	6.4.7.2	29,047,092.82	42,985,450.56
其中：股票投资		27,009,464.18	40,977,737.37
基金投资		-	-
债券投资		2,037,628.64	2,007,713.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,600,000.00
应收清算款		8,801,450.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,292,096.71	57,353,497.80
<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		-	2,600,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,156.32	44,706.38
应付托管费		8,831.28	8,941.29
应付销售服务费		10,002.55	9,705.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	29,031.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	103,352.50	183,777.16
负债合计		166,342.65	2,876,161.16
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	44,098,609.73	46,490,870.52
未分配利润	6.4.7.8	8,027,144.33	7,986,466.12
净资产合计		52,125,754.06	54,477,336.64
负债和净资产总计		52,292,096.71	57,353,497.80

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 44,098,609.73 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额 24,813,195.63 份，基金份额净值 1.1944 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额 19,285,414.10 份，基金份额净值 1.1661 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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>		1,018,715.91	1,161,279.35
1. 利息收入		135,086.00	107,493.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,169.96	24,761.50
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		66,916.04	82,731.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		222,870.58	406,360.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-909,579.68	191,481.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	22,718.50	108,797.22
资产支持证券投资	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	676,952.29	-331,997.69
股利收益	6.4.7.15	432,779.47	438,079.07
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	654,479.42	646,857.83
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	6,279.91	567.92
<b>减：二、营业总支出</b>		453,468.61	424,571.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	272,321.63	258,105.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,464.33	64,526.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	59,211.79	42,746.49
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		8,244.82	34.32
8. 其他费用	6.4.7.19	59,226.04	59,158.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		565,247.30	736,707.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		565,247.30	736,707.65



号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		565,247.30	736,707.65

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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、上期期末净资产	46,490,870.52	-	7,986,466.12	54,477,336.64
二、本期期初净资产	46,490,870.52	-	7,986,466.12	54,477,336.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,392,260.79	-	40,678.21	-2,351,582.58
(一)、综合收益总额	-	-	565,247.30	565,247.30
(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)	-2,392,260.79	-	-524,569.09	-2,916,829.88
其中：1. 基金申购款	5,291,344.42	-	913,526.27	6,204,870.69
2. 基金赎回款	-7,683,605.21	-	-1,438,095.36	-9,121,700.57
(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	44,098,609.73	-	8,027,144.33	52,125,754.06
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	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01

二、本期期初净资产	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,395,096.67	-	843,983.78	2,239,080.45
(一)、综合收益总额	-	-	736,707.65	736,707.65
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,395,096.67	-	107,276.13	1,502,372.80
其中：1. 基金申购款	11,453,250.97	-	1,932,661.40	13,385,912.37
2. 基金赎回款	-10,058,154.30	-	-1,825,385.27	-11,883,539.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	44,986,653.73	-	8,373,650.73	53,360,304.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领	廖维坤	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2015 年 11 月 20 日下发的中国证监会证监许可[2015]2684 号文“关于准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，以定期开放方式运行，存续期限不定。本基金募集期间为 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 30 日，募集结束经安

永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字 60962175\_H11 号验资报告。经向中国证监会备案,《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,298,649.48 份,其中认购资金利息折合 143.77 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2020 年 5 月 28 日发布的《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》以及更新的《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,本基金自 2020 年 6 月 12 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、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、且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置代码,分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%。开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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	3,488,617.54
等于：本金	3,487,887.08
加：应计利息	730.46
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	3,488,617.54

##### 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	27,842,188.40	-	27,009,464.18	-832,724.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,004,999.98	23,595.14	2,037,628.64	9,033.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,004,999.98	23,595.14	2,037,628.64	9,033.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	29,847,188.38	23,595.14	29,047,092.82	-823,690.70	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-26,103,728.89	-	-	-
其中： 股指期货投资	-26,103,728.89	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-26,103,728.89	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	-4.00	-3,934,080.00	138,720.00
IC2409	IC2409	-8.00	-7,800,320.00	617,528.89
IF2407	IF2407	-5.00	-5,155,500.00	75,100.00
IF2409	IF2409	-8.00	-8,216,640.00	165,840.00
合计				997,188.89
减：可抵销期货 暂收款				997,188.89
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度

下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

(2) 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.1 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	49,126.46
其中：交易所市场	49,126.46
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	39,781.56
应付审计费	9,944.48
应付银行间账户维护费	4,500.00
合计	103,352.50

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	本期 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	29,261,125.03	29,261,125.03
本期申购	1,854,880.27	1,854,880.27
本期赎回（以“-”号填列）	-6,302,809.67	-6,302,809.67
本期末	24,813,195.63	24,813,195.63

安信阿尔法定开混合 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	17,229,745.49	17,229,745.49
本期申购	3,436,464.15	3,436,464.15
本期赎回（以“-”号填列）	-1,380,795.54	-1,380,795.54
本期末	19,285,414.10	19,285,414.10

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

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,219,316.26	72,871.37	5,292,187.63
本期期初	5,219,316.26	72,871.37	5,292,187.63
本期利润	-39,718.29	429,656.96	389,938.67
本期基金份额交易产生的变动数	-770,190.62	-88,518.56	-858,709.18
其中：基金申购款	336,083.30	13,863.12	349,946.42
基金赎回款	-1,106,273.92	-102,381.68	-1,208,655.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,409,407.35	414,009.77	4,823,417.12

安信阿尔法定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,640,364.31	53,914.18	2,694,278.49
本期期初	2,640,364.31	53,914.18	2,694,278.49
本期利润	-49,513.83	224,822.46	175,308.63
本期基金份额交易产生的变动数	284,780.94	49,359.15	334,140.09
其中：基金申购款	497,493.81	66,086.04	563,579.85
基金赎回款	-212,712.87	-16,726.89	-229,439.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,875,631.42	328,095.79	3,203,727.21

#### 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	7,895.10
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	60,104.64
其他	170.22
合计	68,169.96

#### 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	102,877,750.39
减：卖出股票成本总额	103,581,130.33
减：交易费用	206,199.74
买卖股票差价收入	-909,579.68

#### 6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	22,718.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	22,718.50

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	676,952.29

#### 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	432,779.47
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	432,779.47

#### 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	-950,349.47
股票投资	-954,552.38
债券投资	4,202.91
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,604,828.89
权证投资	-
期货投资	1,604,828.89
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	654,479.42

#### 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	6,279.91
合计	6,279.91

#### 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	9,944.48
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费用	500.00
银行间账户维护费	9,000.00
合计	59,226.04

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

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股票交易。

#### 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

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	272,321.63	258,105.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	55,495.64	79,319.81
应支付基金管理人的净管理费	216,825.99	178,785.99

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	54,464.33	64,526.49

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的费率计提。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		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	42,782.77	42,782.77
国投证券	-	383.97	383.97
合计	-	43,166.74	43,166.74
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		

	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	6,398.10	6,398.10
国投证券	-	383.00	383.00
合计	-	6,781.10	6,781.10

注：本基金销售服务费每日计算，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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固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固有资金投资本基金。

##### 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

安信阿尔法定开混合 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	13,755,760.07	31.19	12,037,989.74	25.89
------------------------------	---------------	-------	---------------	-------

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
招商银行	3,488,617.54	7,895.10	608,009.37	3,750.59

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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割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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2023 年 12 月 31 日：0.004%）。



#### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	6,238.50	2,034.83
未评级	2,031,390.14	2,005,678.36
合计	2,037,628.64	2,007,713.19

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。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	3,488,617.54	-	-	-	3,488,617.54
结算备付金	7,921,140.76	-	-	-	7,921,140.76
存出保证金	3,033,795.40	-	-	-	3,033,795.40
交易性金融资产	2,031,390.14	1,857.02	4,381.48	27,009,464.18	29,047,092.82
应收清算款	-	-	-	8,801,450.19	8,801,450.19
资产总计	16,474,943.84	1,857.02	4,381.48	35,810,914.37	52,292,096.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,156.32	44,156.32
应付托管费	-	-	-	8,831.28	8,831.28
应付销售服务费	-	-	-	10,002.55	10,002.55
其他负债	-	-	-	103,352.50	103,352.50
负债总计	-	-	-	166,342.65	166,342.65
利率敏感度缺口	16,474,943.84	1,857.02	4,381.48	35,644,571.72	52,125,754.06
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	3,441,409.60	-	-	-	3,441,409.60
结算备付金	3,627,429.02	-	-	-	3,627,429.02
存出保证金	4,699,208.62	-	-	-	4,699,208.62
交易性金融资产	2,005,678.36	-	2,034.83	40,977,737.37	42,985,450.56
买入返售金融资产	2,600,000.00	-	-	-	2,600,000.00

资产总计	16,373,725.60	-	2,034.83	40,977,737.37	57,353,497.80
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,706.38	44,706.38
应付托管费	-	-	-	8,941.29	8,941.29
应付清算款	-	-	-	2,600,000.00	2,600,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,705.25	9,705.25
应交税费	-	-	-	29,031.08	29,031.08
其他负债	-	-	-	183,777.16	183,777.16
负债总计	-	-	-	2,876,161.16	2,876,161.16
利率敏感度缺口	16,373,725.60	-	2,034.83	38,101,576.21	54,477,336.64

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		
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	2,572.93	4,869.58
2. 市场利率上升25个基点	-2,565.44	-4,845.93	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净

值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	27,009,464.18	51.82	40,977,737.37	75.22
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	27,009,464.18	51.82	40,977,737.37	75.22

#### 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%	1,237,311.30	1,740,046.77
2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,237,311.30	-1,740,046.77	

#### 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	27,015,702.68	40,979,772.20
第二层次	2,031,390.14	2,005,678.36
第三层次	-	-
合计	29,047,092.82	42,985,450.56

##### 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	27,009,464.18	51.65
	其中：股票	27,009,464.18	51.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,037,628.64	3.90
	其中：债券	2,037,628.64	3.90
	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	11,409,758.30	21.82
8	其他各项资产	11,835,245.59	22.63
9	合计	52,292,096.71	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	290,713.00	0.56
B	采矿业	1,581,172.00	3.03
C	制造业	17,121,440.84	32.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,104,507.00	2.12
E	建筑业	486,982.00	0.93
F	批发和零售业	339,907.48	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	406,318.00	0.78
H	住宿和餐饮业	44,460.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,350,254.76	2.59
J	金融业	2,818,667.10	5.41
K	房地产业	432,186.00	0.83
L	租赁和商务服务业	372,296.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	65,940.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	82,320.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	65,112.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	447,188.00	0.86
S	综合	-	-
	合计	27,009,464.18	51.82

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	300	440,217.00	0.84
2	000333	美的集团	5,700	367,650.00	0.71
3	300750	宁德时代	1,800	324,054.00	0.62
4	000858	五粮液	2,500	320,100.00	0.61
5	300760	迈瑞医疗	900	261,819.00	0.50
6	601318	中国平安	6,100	252,296.00	0.48
7	600887	伊利股份	8,800	227,392.00	0.44
8	002463	沪电股份	6,200	226,300.00	0.43
9	601058	赛轮轮胎	15,800	221,200.00	0.42
10	002078	太阳纸业	14,600	203,670.00	0.39
11	000568	泸州老窖	1,400	200,886.00	0.39
12	002371	北方华创	600	191,934.00	0.37
13	300308	中际旭创	1,380	190,274.40	0.37
14	600809	山西汾酒	900	189,792.00	0.36
15	002027	分众传媒	30,200	183,012.00	0.35
16	002028	思源电气	2,700	180,630.00	0.35
17	000975	山金国际	11,000	179,190.00	0.34
18	600660	福耀玻璃	3,700	177,230.00	0.34
19	601989	中国重工	35,400	174,522.00	0.33
20	601601	中国太保	6,100	169,946.00	0.33
21	002422	科伦药业	5,600	169,848.00	0.33
22	000786	北新建材	5,700	169,062.00	0.32
23	600938	中国海油	5,100	168,300.00	0.32
24	002001	新和成	8,300	159,360.00	0.31
25	601166	兴业银行	9,000	158,580.00	0.30
26	300502	新易盛	1,500	158,325.00	0.30
27	600845	宝信软件	4,900	156,457.00	0.30
28	603195	公牛集团	2,001	154,317.12	0.30
29	688169	石头科技	392	153,899.20	0.30
30	000423	东阿阿胶	2,400	150,240.00	0.29
31	601899	紫金矿业	8,500	149,345.00	0.29
32	002601	龙佰集团	8,000	148,560.00	0.29
33	603369	今世缘	3,200	147,840.00	0.28

34	002311	海大集团	3,100	145,855.00	0.28
35	600309	万华化学	1,800	145,548.00	0.28
36	600436	片仔癀	700	145,019.00	0.28
37	688111	金山办公	627	142,642.50	0.27
38	603806	福斯特	9,600	141,120.00	0.27
39	603993	洛阳钼业	16,500	140,250.00	0.27
40	000338	潍柴动力	8,600	139,664.00	0.27
41	000999	华润三九	3,280	139,662.40	0.27
42	002138	顺络电子	4,900	134,554.00	0.26
43	002595	豪迈科技	3,500	133,595.00	0.26
44	002648	卫星化学	7,400	133,052.00	0.26
45	600795	国电电力	22,100	132,379.00	0.25
46	601225	陕西煤业	5,000	128,850.00	0.25
47	601168	西部矿业	7,100	127,445.00	0.24
48	601668	中国建筑	23,900	126,909.00	0.24
49	000157	中联重科	16,500	126,720.00	0.24
50	002128	电投能源	5,900	124,490.00	0.24
51	601628	中国人寿	4,000	124,200.00	0.24
52	300274	阳光电源	2,000	124,060.00	0.24
53	600276	恒瑞医药	3,200	123,072.00	0.24
54	300498	温氏股份	6,200	122,884.00	0.24
55	002867	周大生	9,400	122,764.00	0.24
56	300979	华利集团	2,000	121,700.00	0.23
57	300251	光线传媒	14,400	121,104.00	0.23
58	600926	杭州银行	9,100	118,755.00	0.23
59	002916	深南电路	1,100	116,347.00	0.22
60	688036	传音控股	1,500	114,810.00	0.22
61	000651	格力电器	2,900	113,738.00	0.22
62	600398	海澜之家	11,900	109,956.00	0.21
63	605499	东鹏饮料	500	107,875.00	0.21
64	002517	恺英网络	11,200	106,960.00	0.21
65	600011	华能国际	11,100	106,782.00	0.20
66	601966	玲珑轮胎	5,800	106,546.00	0.20
67	600050	中国联通	22,400	105,280.00	0.20
68	600482	中国动力	5,400	105,192.00	0.20
69	600161	天坛生物	4,300	104,920.00	0.20
70	600066	宇通客车	4,000	103,200.00	0.20
71	300394	天孚通信	1,160	102,567.20	0.20
72	600150	中国船舶	2,500	101,775.00	0.20
73	601108	财通证券	15,100	99,811.00	0.19
74	600000	浦发银行	12,100	99,583.00	0.19
75	601717	郑煤机	6,700	99,160.00	0.19
76	600157	永泰能源	83,400	98,412.00	0.19



77	600566	济川药业	3,100	98,301.00	0.19
78	600873	梅花生物	9,700	97,194.00	0.19
79	002920	德赛西威	1,100	95,799.00	0.18
80	002032	苏泊尔	1,900	95,190.00	0.18
81	600919	江苏银行	12,800	95,104.00	0.18
82	601236	红塔证券	14,800	95,016.00	0.18
83	002532	天山铝业	11,700	94,887.00	0.18
84	601636	旗滨集团	14,600	94,170.00	0.18
85	002444	巨星科技	3,800	93,860.00	0.18
86	002152	广电运通	8,900	93,094.00	0.18
87	300001	特锐德	4,600	92,552.00	0.18
88	600900	长江电力	3,200	92,544.00	0.18
89	600970	中材国际	7,600	91,656.00	0.18
90	600989	宝丰能源	5,200	90,116.00	0.17
91	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.17
92	600582	天地科技	12,900	88,881.00	0.17
93	600188	兖矿能源	3,900	88,647.00	0.17
94	601633	长城汽车	3,500	88,550.00	0.17
95	600642	申能股份	10,000	88,300.00	0.17
96	601916	浙商银行	31,700	87,492.00	0.17
97	000977	浪潮信息	2,400	87,288.00	0.17
98	001979	招商蛇口	9,900	87,021.00	0.17
99	300699	光威复材	3,500	86,905.00	0.17
100	601928	凤凰传媒	7,900	86,584.00	0.17
101	002475	立讯精密	2,200	86,482.00	0.17
102	300724	捷佳伟创	1,600	86,416.00	0.17
103	601398	工商银行	15,100	86,070.00	0.17
104	600415	小商品城	11,400	84,588.00	0.16
105	000596	古井贡酒	400	84,428.00	0.16
106	600737	中粮糖业	8,800	84,392.00	0.16
107	000001	平安银行	8,300	84,245.00	0.16
108	600096	云天化	4,300	83,506.00	0.16
109	603568	伟明环保	4,000	82,320.00	0.16
110	600160	巨化股份	3,400	82,042.00	0.16
111	300383	光环新网	9,700	81,965.00	0.16
112	688208	道通科技	3,338	80,579.32	0.15
113	000563	陕国投 A	29,300	80,575.00	0.15
114	600760	中航沈飞	2,000	80,200.00	0.15
115	600406	国电南瑞	3,200	79,872.00	0.15
116	601233	桐昆股份	5,000	79,800.00	0.15
117	601838	成都银行	5,200	78,988.00	0.15
118	002223	鱼跃医疗	2,100	78,960.00	0.15
119	000883	湖北能源	13,100	78,731.00	0.15

120	600901	江苏金租	15,380	77,669.00	0.15
121	002415	海康威视	2,500	77,275.00	0.15
122	603786	科博达	1,200	76,980.00	0.15
123	600999	招商证券	5,500	76,505.00	0.15
124	002273	水晶光电	4,500	76,410.00	0.15
125	600529	山东药玻	3,000	76,020.00	0.15
126	603160	汇顶科技	1,100	75,625.00	0.15
127	603816	顾家家居	2,300	74,267.00	0.14
128	600547	山东黄金	2,700	73,926.00	0.14
129	000895	双汇发展	3,100	73,687.00	0.14
130	300408	三环集团	2,500	72,975.00	0.14
131	002074	国轩高科	3,800	72,770.00	0.14
132	600820	隧道股份	10,900	71,177.00	0.14
133	600031	三一重工	4,300	70,950.00	0.14
134	000683	远兴能源	10,200	70,482.00	0.14
135	000725	京东方 A	17,200	70,348.00	0.13
136	002739	万达电影	5,800	70,122.00	0.13
137	300782	卓胜微	900	69,966.00	0.13
138	000598	兴蓉环境	9,300	69,936.00	0.13
139	002714	牧原股份	1,600	69,760.00	0.13
140	601229	上海银行	9,600	69,696.00	0.13
141	002025	航天电器	1,500	69,570.00	0.13
142	601288	农业银行	15,900	69,324.00	0.13
143	000400	许继电气	2,000	68,820.00	0.13
144	002340	格林美	10,800	68,796.00	0.13
145	600062	华润双鹤	3,500	68,530.00	0.13
146	000997	新大陆	4,900	68,159.00	0.13
147	601600	中国铝业	8,900	67,907.00	0.13
148	601021	春秋航空	1,200	67,596.00	0.13
149	300144	宋城演艺	8,400	67,452.00	0.13
150	002608	江苏国信	8,700	67,425.00	0.13
151	601799	星宇股份	600	67,224.00	0.13
152	601390	中国中铁	10,300	67,156.00	0.13
153	000998	隆平高科	6,800	66,844.00	0.13
154	002353	杰瑞股份	1,900	66,652.00	0.13
155	300492	华图山鼎	700	65,940.00	0.13
156	000039	中集集团	7,100	65,746.00	0.13
157	688516	奥特维	1,531	64,011.11	0.12
158	000100	TCL 科技	14,800	63,936.00	0.12
159	600030	中信证券	3,500	63,805.00	0.12
160	600848	上海临港	7,000	63,770.00	0.12
161	601098	中南传媒	5,100	63,342.00	0.12
162	601128	常熟银行	8,330	63,058.10	0.12

163	000027	深圳能源	8,600	62,780.00	0.12
164	002384	东山精密	3,000	62,100.00	0.12
165	600862	中航高科	3,300	61,974.00	0.12
166	600426	华鲁恒升	2,300	61,272.00	0.12
167	300866	安克创新	860	61,240.60	0.12
168	300136	信维通信	3,100	60,698.00	0.12
169	002008	大族激光	2,900	60,320.00	0.12
170	002252	上海莱士	7,700	60,214.00	0.12
171	600663	陆家嘴	6,800	59,976.00	0.12
172	601231	环旭电子	3,700	59,385.00	0.11
173	000623	吉林敖东	4,400	58,960.00	0.11
174	600282	南钢股份	11,800	58,764.00	0.11
175	000063	中兴通讯	2,100	58,737.00	0.11
176	600048	保利发展	6,700	58,692.00	0.11
177	002558	巨人网络	6,200	58,528.00	0.11
178	601997	贵阳银行	11,100	58,497.00	0.11
179	002600	领益智造	8,200	58,384.00	0.11
180	600885	宏发股份	2,100	58,128.00	0.11
181	002373	千方科技	6,400	58,048.00	0.11
182	002465	海格通信	5,600	58,016.00	0.11
183	601615	明阳智能	6,100	57,584.00	0.11
184	002262	恩华药业	2,400	56,976.00	0.11
185	600690	海尔智家	2,000	56,760.00	0.11
186	600167	联美控股	10,700	55,747.00	0.11
187	601138	工业富联	2,000	54,800.00	0.11
188	600988	赤峰黄金	3,300	53,922.00	0.10
189	601077	渝农商行	10,700	53,714.00	0.10
190	601898	中煤能源	4,300	53,664.00	0.10
191	600346	恒力石化	3,800	53,010.00	0.10
192	600801	华新水泥	3,800	52,250.00	0.10
193	000830	鲁西化工	4,500	52,155.00	0.10
194	601958	金钼股份	5,000	52,050.00	0.10
195	600863	内蒙华电	11,100	51,504.00	0.10
196	300628	亿联网络	1,400	51,478.00	0.10
197	300433	蓝思科技	2,800	51,100.00	0.10
198	603379	三美股份	1,300	50,882.00	0.10
199	002508	老板电器	2,300	50,830.00	0.10
200	300253	卫宁健康	8,600	50,740.00	0.10
201	002142	宁波银行	2,300	50,738.00	0.10
202	603658	安图生物	1,100	50,677.00	0.10
203	688188	柏楚电子	274	50,566.70	0.10
204	688008	澜起科技	883	50,472.28	0.10
205	000581	威孚高科	3,100	50,468.00	0.10

206	002409	雅克科技	800	50,328.00	0.10
207	600004	白云机场	5,300	50,244.00	0.10
208	300487	蓝晓科技	1,200	50,112.00	0.10
209	002594	比亚迪	200	50,050.00	0.10
210	601888	中国中免	800	49,992.00	0.10
211	600872	中炬高新	2,200	49,918.00	0.10
212	600895	张江高科	2,700	49,896.00	0.10
213	600315	上海家化	2,800	49,784.00	0.10
214	600967	内蒙一机	6,900	49,680.00	0.10
215	002555	三七互娱	3,800	49,590.00	0.10
216	688819	天能股份	2,076	49,533.36	0.10
217	600038	中直股份	1,200	49,332.00	0.09
218	601669	中国电建	8,800	49,192.00	0.09
219	600399	抚顺特钢	8,700	48,981.00	0.09
219	601598	中国外运	8,700	48,981.00	0.09
220	002304	洋河股份	600	48,444.00	0.09
221	603883	老百姓	2,600	47,736.00	0.09
222	002847	盐津铺子	1,100	47,047.00	0.09
223	601611	中国核建	5,800	46,922.00	0.09
224	000402	金融街	19,900	46,765.00	0.09
225	601169	北京银行	8,000	46,720.00	0.09
226	600299	安迪苏	4,800	46,560.00	0.09
227	002185	华天科技	5,700	46,455.00	0.09
228	601939	建设银行	6,200	45,880.00	0.09
229	600741	华域汽车	2,800	45,864.00	0.09
230	601688	华泰证券	3,700	45,843.00	0.09
231	601872	招商轮船	5,400	45,630.00	0.09
232	000703	恒逸石化	6,400	45,376.00	0.09
233	002155	湖南黄金	2,500	45,250.00	0.09
234	300017	网宿科技	5,700	45,030.00	0.09
235	600028	中国石化	7,100	44,872.00	0.09
236	600023	浙能电力	6,300	44,793.00	0.09
237	002563	森马服饰	7,700	44,737.00	0.09
238	600019	宝钢股份	6,700	44,555.00	0.09
239	600258	首旅酒店	3,600	44,460.00	0.09
240	600600	青岛啤酒	600	43,662.00	0.08
241	688029	南微医学	709	43,646.04	0.08
242	603317	天味食品	3,800	43,358.00	0.08
243	000630	铜陵有色	11,900	42,959.00	0.08
244	300059	东方财富	4,000	42,240.00	0.08
245	688099	晶晨股份	708	41,998.56	0.08
246	600372	中航机载	3,500	41,895.00	0.08
247	002153	石基信息	7,300	41,829.00	0.08

248	002065	东华软件	9,200	41,584.00	0.08
249	601991	大唐发电	13,800	41,538.00	0.08
250	603826	坤彩科技	1,400	40,558.00	0.08
251	601919	中远海控	2,600	40,274.00	0.08
252	603939	益丰药房	1,640	40,262.00	0.08
253	603198	迎驾贡酒	700	40,250.00	0.08
254	300679	电连技术	1,000	40,230.00	0.08
255	601179	中国西电	5,000	40,200.00	0.08
256	002372	伟星新材	2,600	40,092.00	0.08
257	002653	海思科	1,300	39,910.00	0.08
258	300857	协创数据	700	39,900.00	0.08
259	600177	雅戈尔	5,600	39,872.00	0.08
260	002958	青农商行	14,800	39,664.00	0.08
261	000166	申万宏源	9,200	39,652.00	0.08
262	002064	华峰化学	5,500	39,435.00	0.08
263	600208	新湖中宝	24,900	39,342.00	0.08
264	601311	骆驼股份	4,900	39,298.00	0.08
265	601336	新华保险	1,300	39,039.00	0.07
266	600009	上海机场	1,200	38,700.00	0.07
267	600373	中文传媒	2,600	38,584.00	0.07
268	600699	均胜电子	2,600	38,532.00	0.07
269	600707	彩虹股份	5,600	38,136.00	0.07
270	002179	中航光电	1,000	38,050.00	0.07
271	600585	海螺水泥	1,600	37,744.00	0.07
272	000526	学大教育	600	36,960.00	0.07
273	000066	中国长城	4,200	36,750.00	0.07
274	000661	长春高新	400	36,708.00	0.07
275	600535	天士力	2,900	36,482.00	0.07
276	300496	中科创达	800	36,472.00	0.07
277	002991	甘源食品	600	36,390.00	0.07
278	002683	广东宏大	1,800	36,234.00	0.07
279	600016	民生银行	9,500	36,005.00	0.07
280	603893	瑞芯微	600	35,502.00	0.07
281	301015	百洋医药	1,500	35,295.00	0.07
282	000529	广弘控股	6,000	35,280.00	0.07
283	603589	口子窖	900	35,271.00	0.07
284	600867	通化东宝	4,200	35,154.00	0.07
285	000967	盈峰环境	8,300	35,109.00	0.07
286	300783	三只松鼠	1,600	34,992.00	0.07
287	600612	老凤祥	600	34,914.00	0.07
288	600765	中航重机	1,700	34,680.00	0.07
289	688002	睿创微纳	1,237	34,598.89	0.07
290	600998	九州通	7,021	34,262.48	0.07

291	603606	东方电缆	700	34,167.00	0.07
292	300009	安科生物	4,000	34,160.00	0.07
293	600170	上海建工	15,800	33,970.00	0.07
294	000636	风华高科	2,600	33,956.00	0.07
295	601990	南京证券	4,400	33,792.00	0.06
296	000519	中兵红箭	2,300	33,741.00	0.06
297	601988	中国银行	7,300	33,726.00	0.06
298	600183	生益科技	1,600	33,696.00	0.06
299	601328	交通银行	4,500	33,615.00	0.06
300	603605	珀莱雅	300	33,297.00	0.06
301	002946	新乳业	3,800	33,288.00	0.06
302	000617	中油资本	6,000	33,120.00	0.06
303	601985	中国核电	3,100	33,046.00	0.06
304	603486	科沃斯	700	33,026.00	0.06
305	300529	健帆生物	1,200	32,652.00	0.06
306	603650	彤程新材	1,100	32,505.00	0.06
307	603355	莱克电气	1,500	32,400.00	0.06
308	300357	我武生物	1,600	32,352.00	0.06
309	300705	九典制药	1,200	32,088.00	0.06
310	600588	用友网络	3,200	32,000.00	0.06
311	603228	景旺电子	1,000	31,800.00	0.06
312	002947	恒铭达	900	31,680.00	0.06
313	002007	华兰生物	2,000	31,580.00	0.06
314	600377	宁沪高速	2,500	31,500.00	0.06
315	002156	通富微电	1,400	31,346.00	0.06
316	600219	南山铝业	8,200	31,242.00	0.06
317	600598	北大荒	2,500	31,225.00	0.06
318	601088	中国神华	700	31,059.00	0.06
319	300124	汇川技术	600	30,780.00	0.06
320	001203	大中矿业	3,200	30,752.00	0.06
321	000887	中鼎股份	2,500	30,600.00	0.06
322	603156	养元饮品	1,400	29,778.00	0.06
323	600060	海信视像	1,200	29,688.00	0.06
324	600875	东方电气	1,600	29,520.00	0.06
324	601728	中国电信	4,800	29,520.00	0.06
325	600029	南方航空	5,000	29,450.00	0.06
326	600015	华夏银行	4,600	29,440.00	0.06
327	600352	浙江龙盛	3,400	29,206.00	0.06
328	601857	中国石油	2,800	28,896.00	0.06
329	002939	长城证券	4,300	28,810.00	0.06
330	000425	徐工机械	4,000	28,600.00	0.05
331	600702	舍得酒业	500	28,335.00	0.05
332	002607	中公教育	18,400	28,152.00	0.05

333	300795	米奥会展	1,600	28,048.00	0.05
334	002493	荣盛石化	2,900	28,014.00	0.05
335	002043	兔宝宝	2,700	27,999.00	0.05
336	603558	健盛集团	2,800	27,860.00	0.05
337	603393	新天然气	800	27,792.00	0.05
338	002625	光启技术	1,600	27,760.00	0.05
339	300776	帝尔激光	600	27,576.00	0.05
340	000089	深圳机场	4,300	27,477.00	0.05
341	002271	东方雨虹	2,200	27,148.00	0.05
342	601901	方正证券	3,500	27,055.00	0.05
343	600025	华能水电	2,500	26,950.00	0.05
344	600380	健康元	2,400	26,808.00	0.05
345	000069	华侨城 A	13,100	26,724.00	0.05
346	002430	杭氧股份	1,200	26,700.00	0.05
347	600959	江苏有线	10,100	26,664.00	0.05
348	300058	蓝色光标	4,900	26,656.00	0.05
349	603688	石英股份	900	26,649.00	0.05
350	000729	燕京啤酒	3,000	26,490.00	0.05
351	600115	中国东航	6,600	26,466.00	0.05
352	000155	川能动力	2,400	25,848.00	0.05
353	300207	欣旺达	1,700	25,789.00	0.05
354	600764	中国海防	1,300	25,519.00	0.05
355	688281	华秦科技	306	25,495.92	0.05
356	601577	长沙银行	3,100	25,358.00	0.05
357	601665	齐鲁银行	5,100	25,041.00	0.05
358	300450	先导智能	1,500	24,945.00	0.05
359	002195	岩山科技	9,900	24,849.00	0.05
360	603233	大参林	1,720	24,596.00	0.05
361	603338	浙江鼎力	400	24,168.00	0.05
362	003000	劲仔食品	2,000	24,100.00	0.05
363	600497	驰宏锌锗	4,500	24,030.00	0.05
364	603699	纽威股份	1,400	23,968.00	0.05
365	601216	君正集团	6,400	23,616.00	0.05
366	002019	亿帆医药	1,900	23,484.00	0.05
367	601865	福莱特	1,100	22,110.00	0.04
368	600941	中国移动	200	21,500.00	0.04

#### 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	962,565.00	1.77

2	300750	宁德时代	571,124.00	1.05
3	000333	美的集团	451,509.00	0.83
4	000858	五粮液	394,996.00	0.73
5	600900	长江电力	388,018.00	0.71
6	601318	中国平安	360,075.00	0.66
7	002463	沪电股份	358,951.00	0.66
8	688169	石头科技	349,945.22	0.64
9	002138	顺络电子	334,490.00	0.61
10	600938	中国海油	318,386.00	0.58
11	601058	赛轮轮胎	314,326.00	0.58
12	002078	太阳纸业	292,053.00	0.54
13	300502	新易盛	286,773.00	0.53
14	002028	思源电气	285,276.00	0.52
15	600030	中信证券	281,215.00	0.52
16	000975	山金国际	277,848.00	0.51
17	600887	伊利股份	276,439.00	0.51
18	600011	华能国际	270,359.00	0.50
19	002867	周大生	269,143.00	0.49
20	002475	立讯精密	266,008.00	0.49

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	600519	贵州茅台	1,147,593.00	2.11
2	601318	中国平安	999,996.00	1.84
3	600900	长江电力	968,411.00	1.78
4	600030	中信证券	556,027.00	1.02
5	601728	中国电信	541,422.00	0.99
6	300750	宁德时代	526,081.00	0.97
7	000333	美的集团	510,222.00	0.94
8	600309	万华化学	483,333.00	0.89
9	601166	兴业银行	479,310.00	0.88
10	600028	中国石化	445,486.00	0.82
11	601899	紫金矿业	443,947.00	0.81
12	601668	中国建筑	438,272.00	0.80
13	601088	中国神华	427,351.00	0.78
14	600690	海尔智家	427,314.00	0.78
15	600276	恒瑞医药	427,066.00	0.78
16	601857	中国石油	385,048.00	0.71
17	600031	三一重工	382,909.00	0.70



18	600406	国电南瑞	382,483.00	0.70
19	600050	中国联通	377,538.00	0.69
20	601816	京沪高铁	374,630.00	0.69

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	90,567,409.52
卖出股票收入（成交）总额	102,877,750.39

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	2,031,390.14	3.90
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）	6,238.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,037,628.64	3.91

### 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	019693	22 国债 28	20,000	2,031,390.14	3.90
2	113682	益丰转债	20	2,371.16	0.00
3	113683	伟 24 转债	10	2,010.32	0.00
4	118031	天 23 转债	20	1,857.02	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

现阶段本基金主要使用股指期货对冲市场系统性风险。基金经理根据对冲比率、期现市场相关性等因素，计算需要对冲的股指期货合约手数，并对风险敞口进行实时跟踪与动态调整。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 27,009,464.18 元，占基金资产净值的比例为 51.82%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 25,106,540.00 元，占基金资产净值的比例为 48.17%，空头合约市值占股票资产的比例为 92.95%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -232,627.39 元，公允价值变动损益为 650,276.51 元。

## 7.13 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名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。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,033,795.40

2	应收清算款	8,801,450.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,835,245.59

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118031	天 23 转债	1,857.02	0.00

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信阿尔法定开混合 A	1,115	22,253.99	253.62	0.00	24,812,942.01	100.00
安信阿尔法定开混合 C	343	56,225.70	15,479,553.64	80.27	3,805,860.46	19.73
合计	1,435	30,730.74	15,479,807.26	35.10	28,618,802.47	64.90

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	安信阿尔法定开混合 A	273,507.75	1.10

从业人员持有本基金	安信阿尔法定开混合 C	-	-
	合计	273,507.75	0.62

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	0
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	0~10
	安信阿尔法定开混合 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	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	10,298,649.48	-
本报告期期初基金份额总额	29,261,125.03	17,229,745.49
本报告期基金总申购份额	1,854,880.27	3,436,464.15
减：本报告期基金总赎回份额	6,302,809.67	1,380,795.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,813,195.63	19,285,414.10

## § 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

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
华泰证券	2	193,445,159.91	100.00	142,355.91	100.00	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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。

### 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 (%)
华泰证券	-	-	719,100,000.00	100.00	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 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	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日

	公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告		
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安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2024 年 3 月 5 日
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2024 年 6 月 11 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	20240101-2 0240630	12,037,989.74	1,717,770.33	-	13,755,760.07	31.19
----	---	-----------------------	---------------	--------------	---	---------------	-------

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稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人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