

# 安信中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）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遵规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	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遵规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....	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 .....	15
6.3 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 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 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	安信中证 A500 指数增强	
基金主代码	023501	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,253,678.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信中证 A500 指数增强 A	安信中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023501	023502
报告期末下属分级基金的份额总额	41,382,145.72 份	36,871,532.47 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对标的指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。指数化被动投资策略以成份股在标的指数中的权重为基础，通过控制股票组合中各股票相对其在标的指数中权重的偏离，实现对跟踪误差的控制，进行指数化投资。量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评价股票超额收益预期、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。在债券投资方面，将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。此外，本基金还将采用衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名 王卫峰	林盛
	联系电话 0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱 service@essencefund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话	4008-088-088	95568
传真	0755-82799292	010-57093382
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 2 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 2 号
邮政编码	518026	100031
法定代表人	刘入领	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	安信中证 A500 指数增强 A	安信中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	1,076,039.48	801,795.83
本期利润	1,579,178.19	1,123,638.09
加权平均基金份额本期利润	0.0269	0.0176
本期加权平均净值利润率	2.70%	1.77%
本期基金份额净值增长率	2.92%	2.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	847,366.74	726,651.95

期末可供分配基金份额利润	0.0205	0.0197
期末基金资产净值	42,590,950.87	37,919,781.79
期末基金份额净值	1.0292	1.0284
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.92%	2.84%

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。

4、本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

## 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

安信中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.22%	0.67%	2.68%	0.57%	2.54%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.92%	0.64%	4.25%	0.59%	-1.33%	0.05%

安信中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.19%	0.67%	2.68%	0.57%	2.51%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.84%	0.64%	4.25%	0.59%	-1.41%	0.05%

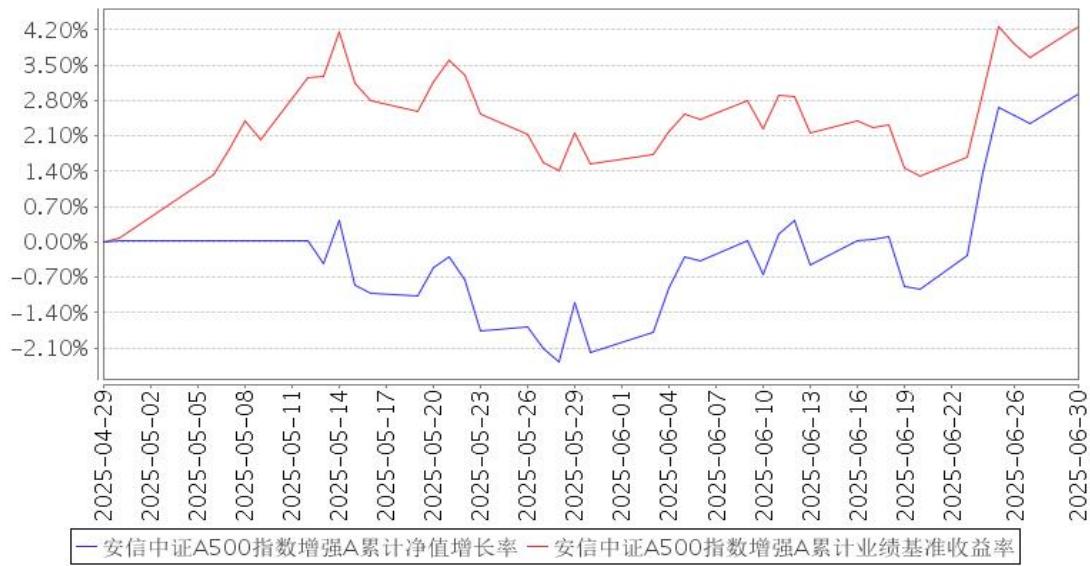
注：根据《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率  $\times$  95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$  5%。中证 A500 指数是由中证指数有限公司编制，采用行业均衡选样方法，从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样

本，反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金为跟踪中证 A500 指数的指数增强型证券投资基金，在投资中将不低于非现金基金资产的 80% 投资于标的指数成份股及备选成份股，因此选取中证 A500 指数收益率作为业绩比较基准，能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

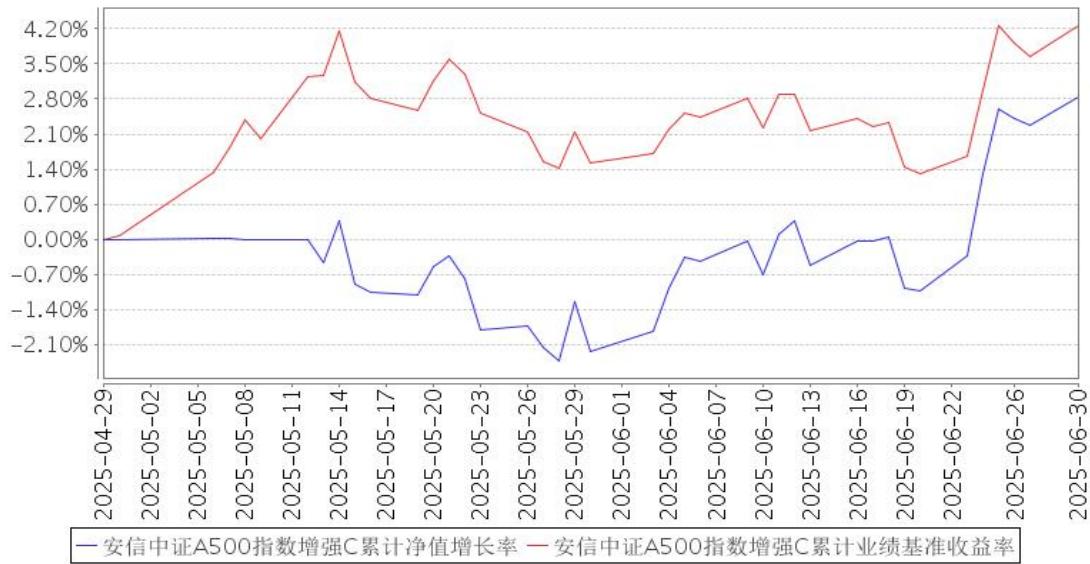
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信中证 A500 指数增强 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信中证 A500 指数增强 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，截至本报告末本基金合同生效未满一年。

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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 99 只开放式基金，具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券

型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金、安信远见稳进一年持有期混合型证券投资基金、安信 180 天持有期债券型证券投资基金、安信医药创新股票型发起式证券投资基金、安信周期优选股票型发起式证券投资基金、安信均衡增长混合型证券投资基金、安信中证 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、安信锦顺利率债债券型证券投资基金、安信优选价值混合型证券投资基金、安信价值共赢混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施荣盛	本基金的 基金 经 理，量化 投资部总 经理助理	2025 年 4 月 29 日	-	12 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理、基金经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理助理。现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 A500 指数增强型证券投资基金、安信上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

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

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

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

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

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0292 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.92%；安信中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0284 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.84%；同期业绩比较基准收益率为 4.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

外，市场风格切换显著加快，要求投资者必须保持高度灵活性，精准捕捉产业链条中的结构性机会。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、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：安信中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6. 4. 7. 1	22,244,017.72
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	76,178,879.48
其中：股票投资		76,178,879.48
基金投资		—
债券投资		—
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		177, 532. 04
递延所得税资产		-
其他资产	6. 4. 7. 5	-
资产总计		98, 600, 429. 24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 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		17, 978, 626. 86
应付管理人报酬		63, 008. 85
应付托管费		7, 876. 09
应付销售服务费		13, 480. 20
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	26, 704. 58
负债合计		18, 089, 696. 58
<b>净资产:</b>		
实收基金	6. 4. 7. 7	78, 253, 678. 19
未分配利润	6. 4. 7. 8	2, 257, 054. 47
净资产合计		80, 510, 732. 66
负债和净资产总计		98, 600, 429. 24

注: 1. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日, 基金份额总额 78, 253, 678. 19 份, 其中安信中证 A500 指数增强 A 基金份额总额 41, 382, 145. 72 份, 基金份额净值 1. 0292 元; 安信中证 A500 指数增强 C 基金份额总额 36, 871, 532. 47 份, 基金份额净值 1. 0284 元。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 04 月 29 日, 无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：安信中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,968,316.80
1. 利息收入		136,378.27
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 9	136,378.27
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,006,859.56
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 10	1,113,555.28
基金投资收益		—
债券投资收益	6. 4. 7. 11	—
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	893,304.28
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	824,980.97
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	98.00
<b>减：二、营业总支出</b>		265,500.52
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	171,375.85
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	21,421.98
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	45,818.88
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. 其他费用	6. 4. 7. 19	26,883.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,702,816.28
<b>减：所得税费用</b>		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,702,816.28
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		—
<b>六、综合收益总额</b>		2,702,816.28

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	283,840,545.13	-	-	283,840,545.13
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-205,586,866.94	-	2,257,054.47	-203,329,812.47
(一)、综合收益总额	-	-	2,702,816.28	2,702,816.28
(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)	-205,586,866.94	-	-445,761.81	-206,032,628.75
其中：1. 基金申购款	5,936,867.84	-	-17,044.83	5,919,823.01
2. 基金赎回款	-211,523,734.78	-	-428,716.98	-211,952,451.76
(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	78,253,678.19	-	2,257,054.47	80,510,732.66

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

安信中证 A500 指数增强型证券投资基金(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”)证监许可[2025]264 号《关于准予安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基

金注册的批复》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《安信中证 A500 指数增强型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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 283,786,431.97 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 283,840,545.13 份，其中认购资金利息折合 54,113.16 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 A500 指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同），其他非标的指数成份股(包含主板、科创板、创业板及其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、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、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具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相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。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。基金的投资组合比例为：本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权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、应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率  $\times$  95% + 银行活期存款利率(税后)  $\times$  5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 4 月 29 日(基金合同生效日)起至 2025 年 6 月 30 日止期间的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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

## 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金

融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	8,329,321.92

等于：本金	8,329,107.42
加：应计利息	214.50
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	13,914,695.80
等于：本金	13,913,869.79
加：应计利息	826.01
减：坏账准备	-
合计	22,244,017.72

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金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 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	75,353,898.51	-	76,178,879.48	824,980.97
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	75,353,898.51	-	76,178,879.48	824,980.97

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	20,405.07
其他	1,198.40
应付审计费	5,101.11
合计	26,704.58

注：本基金采用券商结算模式，其他负债的其他项目为提前到账未除权的股票现金红利、提前到账未除息的场内债券派息及提前到账的场内债券兑付款项等。

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信中证 A500 指数增强 A

项目	本期	
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	账面金额
基金合同生效日	75,860,895.03	75,860,895.03
本期申购	3,705,317.54	3,705,317.54
本期赎回（以“-”号填列）	-38,184,066.85	-38,184,066.85
本期末	41,382,145.72	41,382,145.72

安信中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	账面金额
基金合同生效日	207,979,650.10	207,979,650.10
本期申购	2,231,550.30	2,231,550.30
本期赎回（以“-”号填列）	-173,339,667.93	-173,339,667.93
本期末	36,871,532.47	36,871,532.47

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

## 安信中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	1,076,039.48	503,138.71	1,579,178.19
本期基金份额交易产生的变动数	-228,672.74	-141,700.30	-370,373.04
其中：基金申购款	19,006.76	-37,105.35	-18,098.59
基金赎回款	-247,679.50	-104,594.95	-352,274.45
本期已分配利润	—	—	—
本期末	847,366.74	361,438.41	1,208,805.15

## 安信中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	801,795.83	321,842.26	1,123,638.09
本期基金份额交易产生的变动数	-75,143.88	-244.89	-75,388.77
其中：基金申购款	11,392.90	-10,339.14	1,053.76
基金赎回款	-86,536.78	10,094.25	-76,442.53
本期已分配利润	—	—	—
本期末	726,651.95	321,597.37	1,048,249.32

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	126,041.92
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	10,336.35
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	136,378.27

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	115,718,978.66
减：卖出股票成本总额	114,468,119.98
减：交易费用	137,303.40
买卖股票差价收入	1,113,555.28

### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

### 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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	893,304.28
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	893,304.28

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	824,980.97
股票投资	824,980.97
债券投资	-
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	824,980.97

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	98.00
合计	98.00

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	5,101.11
信息披露费	20,405.07
证券出借违约金	-
银行汇划费用	977.63
其他	400.00
合计	26,883.81

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	171,375.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,735.78
应支付基金管理人的净管理费	89,640.07

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

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	21,421.98

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 的各关联方名称	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信中证 A500 指数增强 A	安信中证 A500 指数增强 C	合计
国投证券	-	4,774.27	4,774.27
民生银行	-	36,066.63	36,066.63
合计	-	40,840.90	40,840.90

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：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	8,329,321.92	126,041.92

注：本基金的活期银行存款由基金托管人民生银行保管，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

本基金于本期无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人民生银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具的公允价值均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,244,017.72	-	-	-	22,244,017.72
交易性金融资产	-	-	-	76,178,879.48	76,178,879.48

应收申购款	-	-	-	177,532.04	177,532.04
资产总计	22,244,017.72	-	-	76,356,411.52	98,600,429.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,978,626.86	17,978,626.86
应付管理人报酬	-	-	-	63,008.85	63,008.85
应付托管费	-	-	-	7,876.09	7,876.09
应付销售服务费	-	-	-	13,480.20	13,480.20
其他负债	-	-	-	26,704.58	26,704.58
负债总计	-	-	-	18,089,696.58	18,089,696.58
利率敏感度缺口	22,244,017.72	-	-	58,266,714.94	80,510,732.66

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	76,178,879.48	94.62
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	76,178,879.48	94.62

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2025 年 6 月 30 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	3,879,149.19
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,879,149.19

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	76,178,879.48
第二层次	—

第三层次	-
合计	76,178,879.48

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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重要事项。

## § 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	76,178,879.48	77.26
	其中：股票	76,178,879.48	77.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	22,244,017.72	22.56

8	其他各项资产	177,532.04	0.18
9	合计	98,600,429.24	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,223,306.00	4.00
C	制造业	36,422,351.41	45.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,236,600.00	1.54
E	建筑业	2,555,839.00	3.17
F	批发和零售业	791,026.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	2,329,907.00	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,046,240.45	7.51
J	金融业	12,298,692.00	15.28
K	房地产业	410,475.00	0.51
L	租赁和商务服务业	25,550.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,008,463.00	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	93,324.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	569,088.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	308,610.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	67,319,471.86	83.62

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,918,321.20	8.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	490,758.00	0.61
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	397,088.00	0.49
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	690,154.42	0.86
J	金融业	363,086.00	0.45
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	8,859,407.62	11.00

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,300	3,241,896.00	4.03
2	300750	宁德时代	10,180	2,567,599.60	3.19
3	601318	中国平安	35,000	1,941,800.00	2.41
4	000333	美的集团	22,500	1,624,500.00	2.02
5	601899	紫金矿业	73,200	1,427,400.00	1.77
6	601166	兴业银行	58,100	1,356,054.00	1.68
7	601398	工商银行	164,700	1,250,073.00	1.55
8	600036	招商银行	24,500	1,125,775.00	1.40
9	600900	长江电力	35,200	1,060,928.00	1.32
10	600887	伊利股份	36,100	1,006,468.00	1.25
11	603259	药明康德	13,900	966,745.00	1.20
12	601288	农业银行	158,800	933,744.00	1.16
13	601328	交通银行	116,600	932,800.00	1.16

14	000725	京东方 A	215,500	859,845.00	1.07
15	600000	浦发银行	60,700	842,516.00	1.05
16	601728	中国电信	104,400	809,100.00	1.00
17	688256	寒武纪	1,328	798,792.00	0.99
18	601601	中国太保	21,000	787,710.00	0.98
19	002230	科大讯飞	16,200	775,656.00	0.96
20	688981	中芯国际	8,713	768,225.21	0.95
21	601668	中国建筑	131,600	759,332.00	0.94
22	000063	中兴通讯	23,300	757,017.00	0.94
23	600919	江苏银行	61,600	735,504.00	0.91
24	601857	中国石油	83,000	709,650.00	0.88
25	688008	澜起科技	8,453	693,146.00	0.86
26	600690	海尔智家	27,400	678,972.00	0.84
27	600406	国电南瑞	30,100	674,541.00	0.84
28	600050	中国联通	122,200	652,548.00	0.81
29	000338	潍柴动力	42,200	649,036.00	0.81
30	000100	TCL 科技	148,300	642,139.00	0.80
31	600104	上汽集团	39,200	629,160.00	0.78
32	688111	金山办公	2,129	596,226.45	0.74
33	002625	光启技术	14,700	587,706.00	0.73
34	000425	徐工机械	75,100	583,527.00	0.72
35	601766	中国中车	81,100	570,944.00	0.71
36	002352	顺丰控股	11,700	570,492.00	0.71
37	300015	爱尔眼科	45,600	569,088.00	0.71
38	600547	山东黄金	17,800	568,354.00	0.71
39	000977	浪潮信息	11,000	559,680.00	0.70
40	300014	亿纬锂能	12,200	558,882.00	0.69
41	601989	中国重工	119,700	555,408.00	0.69
42	603799	华友钴业	15,000	555,300.00	0.69
43	603501	豪威集团	4,300	548,895.00	0.68
44	000538	云南白药	9,700	541,163.00	0.67
45	600585	海螺水泥	24,800	532,456.00	0.66
46	600489	中金黄金	35,400	517,902.00	0.64
47	600160	巨化股份	18,000	516,240.00	0.64
48	002460	赣锋锂业	14,700	496,419.00	0.62
49	600183	生益科技	16,400	494,460.00	0.61
50	601186	中国铁建	61,700	494,217.00	0.61
51	000963	华东医药	12,200	492,392.00	0.61
52	600115	中国东航	119,700	482,391.00	0.60
53	600029	南方航空	81,400	480,260.00	0.60
54	601658	邮储银行	87,300	477,531.00	0.59
55	000651	格力电器	10,600	476,152.00	0.59
56	600176	中国巨石	41,400	471,960.00	0.59

57	300017	网宿科技	43,700	468,464.00	0.58
58	300054	鼎龙股份	15,900	456,012.00	0.57
59	000807	云铝股份	28,500	455,430.00	0.57
60	300037	新宙邦	12,900	454,080.00	0.56
61	002414	高德红外	44,300	454,075.00	0.56
62	601319	中国人保	52,000	452,920.00	0.56
63	600482	中国动力	19,500	449,865.00	0.56
64	300496	中科创达	7,800	446,316.00	0.55
65	002532	天山铝业	53,100	441,261.00	0.55
66	000001	平安银行	36,400	439,348.00	0.55
67	300207	欣旺达	21,900	439,314.00	0.55
68	605589	圣泉集团	15,700	435,675.00	0.54
69	600498	烽火通信	20,400	429,012.00	0.53
70	300088	长信科技	71,900	428,524.00	0.53
71	000009	中国宝安	48,000	426,240.00	0.53
72	002245	蔚蓝锂芯	33,200	425,956.00	0.53
73	600166	福田汽车	154,700	419,237.00	0.52
74	600039	四川路桥	41,900	414,810.00	0.52
75	600499	科达制造	42,000	411,600.00	0.51
76	002244	滨江集团	42,100	410,475.00	0.51
77	300573	兴齐眼药	7,740	400,854.60	0.50
78	601866	中远海发	161,700	399,399.00	0.50
79	603885	吉祥航空	29,500	397,365.00	0.49
80	000938	紫光股份	16,400	393,436.00	0.49
81	600143	金发科技	37,800	389,718.00	0.48
82	301236	软通动力	6,800	371,552.00	0.46
83	600460	士兰微	14,800	367,336.00	0.46
84	603659	璞泰来	19,500	366,210.00	0.45
85	601669	中国电建	71,300	347,231.00	0.43
86	000932	华菱钢铁	77,400	340,560.00	0.42
87	002353	杰瑞股份	9,000	315,000.00	0.39
88	600019	宝钢股份	47,200	311,048.00	0.39
89	002156	通富微电	12,100	310,002.00	0.39
90	002739	万达电影	27,000	308,610.00	0.38
91	002236	大华股份	19,200	304,896.00	0.38
92	603087	甘李药业	5,500	301,290.00	0.37
93	600998	九州通	58,100	298,634.00	0.37
94	601117	中国化学	36,700	281,489.00	0.35
95	002594	比亚迪	800	265,528.00	0.33
96	300450	先导智能	10,400	258,440.00	0.32
97	002008	大族激光	10,600	258,322.00	0.32
98	600352	浙江龙盛	25,200	256,032.00	0.32
99	300059	东方财富	10,500	242,865.00	0.30

100	000887	中鼎股份	12,800	225,152.00	0.28
101	002340	格林美	33,500	212,725.00	0.26
102	601988	中国银行	37,400	210,188.00	0.26
103	002493	荣盛石化	24,400	202,032.00	0.25
104	002475	立讯精密	5,600	194,264.00	0.24
105	300124	汇川技术	2,900	187,253.00	0.23
106	300433	蓝思科技	8,100	180,630.00	0.22
107	000858	五 粮 液	1,500	178,350.00	0.22
108	002517	恺英网络	9,000	173,790.00	0.22
109	600795	国电电力	33,600	162,624.00	0.20
110	300476	胜宏科技	1,200	161,256.00	0.20
111	000157	中联重科	21,700	156,891.00	0.19
112	300699	光威复材	4,800	152,016.00	0.19
113	600111	北方稀土	5,800	144,420.00	0.18
114	600030	中信证券	5,200	143,624.00	0.18
115	601868	中国能建	62,200	138,706.00	0.17
116	002558	巨人网络	5,400	127,170.00	0.16
117	002648	卫星化学	7,000	121,310.00	0.15
118	600584	长电科技	3,600	121,284.00	0.15
119	600196	复星医药	4,800	120,432.00	0.15
120	601390	中国中铁	21,400	120,054.00	0.15
121	688126	沪硅产业	6,273	117,430.56	0.15
122	600219	南山铝业	30,000	114,900.00	0.14
123	002497	雅化集团	9,600	109,440.00	0.14
124	600392	盛和资源	7,900	104,043.00	0.13
125	688009	中国通号	20,196	103,807.44	0.13
126	300383	光环新网	6,700	95,810.00	0.12
127	300003	乐普医疗	6,900	95,082.00	0.12
128	002266	浙富控股	30,300	93,324.00	0.12
129	600276	恒瑞医药	1,700	88,230.00	0.11
130	600699	均胜电子	4,300	74,992.00	0.09
131	600332	白云山	2,600	68,536.00	0.09
132	000999	华润三九	2,100	65,688.00	0.08
133	002407	多氟多	5,100	62,169.00	0.08
134	601600	中国铝业	8,400	59,136.00	0.07
135	600941	中国移动	500	56,275.00	0.07
136	002738	中矿资源	1,600	51,456.00	0.06
137	000408	藏格矿业	1,200	51,204.00	0.06
138	300274	阳光电源	700	47,439.00	0.06
139	300759	康龙化成	1,700	41,718.00	0.05
140	000988	华工科技	800	37,608.00	0.05
141	600066	宇通客车	1,400	34,804.00	0.04
142	002027	分众传媒	3,500	25,550.00	0.03

143	300001	特锐德	900	21,573.00	0.03
144	000623	吉林敖东	900	15,255.00	0.02
145	601216	君正集团	2,600	14,352.00	0.02
146	601985	中国核电	1,400	13,048.00	0.02
147	002603	以岭药业	900	12,690.00	0.02
148	601633	长城汽车	400	8,592.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688636	智明达	11,432	386,287.28	0.48
2	600703	三安光电	30,800	382,536.00	0.48
3	600578	京能电力	84,400	378,956.00	0.47
4	000893	亚钾国际	12,500	376,750.00	0.47
5	300850	新强联	10,500	376,110.00	0.47
6	603173	福斯达	10,500	373,275.00	0.46
7	301387	光大同创	9,300	361,770.00	0.45
8	300232	洲明科技	49,900	361,276.00	0.45
9	002206	海利得	63,600	324,996.00	0.40
10	603218	日月股份	24,600	312,174.00	0.39
11	603379	三美股份	6,400	307,968.00	0.38
12	600063	皖维高新	67,200	307,776.00	0.38
13	688257	新锐股份	20,466	299,826.90	0.37
14	688252	天德钰	12,078	294,461.64	0.37
15	002600	领益智造	31,600	271,444.00	0.34
16	600252	中恒集团	99,400	251,482.00	0.31
17	300708	聚灿光电	19,900	238,800.00	0.30
18	603267	鸿远电子	4,700	236,269.00	0.29
19	000030	富奥股份	35,100	206,739.00	0.26
20	600221	海航控股	153,400	205,556.00	0.26
21	600490	鹏欣资源	42,700	187,453.00	0.23
22	300098	高新兴	35,900	186,680.00	0.23
23	601818	光大银行	44,400	184,260.00	0.23
24	600350	山东高速	16,500	175,890.00	0.22
25	688328	深科达	6,407	145,118.55	0.18
26	002057	中钢天源	13,000	120,770.00	0.15
27	603138	海量数据	7,200	103,824.00	0.13
28	688611	杭州柯林	2,905	94,790.15	0.12
29	300999	金龙鱼	3,200	94,496.00	0.12
30	600236	桂冠电力	15,000	94,050.00	0.12
31	002363	隆基机械	12,300	93,603.00	0.12
32	601901	方正证券	11,800	93,338.00	0.12
33	600685	中船防务	3,300	89,727.00	0.11

34	301397	溯联股份	2,500	87,950.00	0.11
35	301526	国际复材	23,500	85,540.00	0.11
36	601688	华泰证券	4,800	85,488.00	0.11
37	688373	盟科药业	13,226	82,927.02	0.10
38	688681	科汇股份	4,742	66,388.00	0.08
39	603966	法兰泰克	4,900	45,472.00	0.06
40	603270	金帝股份	1,700	43,673.00	0.05
41	002102	能特科技	13,200	41,712.00	0.05
42	603312	西典新能	1,000	36,670.00	0.05
43	300206	理邦仪器	2,800	33,656.00	0.04
44	688508	芯朋微	542	30,254.44	0.04
45	600728	佳都科技	5,300	28,885.00	0.04
46	601003	柳钢股份	8,000	28,160.00	0.03
47	688088	虹软科技	566	27,309.50	0.03
48	300883	龙利得	4,300	26,746.00	0.03
49	300762	上海瀚讯	1,100	24,893.00	0.03
50	002885	京泉华	1,700	24,055.00	0.03
51	688244	永信至诚	712	18,739.84	0.02
52	601991	大唐发电	5,600	17,752.00	0.02
53	688766	普冉股份	254	16,052.80	0.02
54	601298	青岛港	1,800	15,642.00	0.02
55	002782	可立克	1,200	15,576.00	0.02
56	002461	珠江啤酒	1,300	14,677.00	0.02
57	688607	康众医疗	774	14,512.50	0.02
58	000404	长虹华意	1,600	11,360.00	0.01
59	600298	安琪酵母	300	10,551.00	0.01
60	300329	海伦钢琴	300	2,274.00	0.00
61	000952	广济药业	300	1,854.00	0.00
62	603701	德宏股份	100	1,748.00	0.00
63	600320	振华重工	100	437.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	6,081,428.00	7.55
2	600519	贵州茅台	4,053,088.00	5.03
3	000333	美的集团	3,211,518.00	3.99
4	600036	招商银行	2,737,797.00	3.40
5	601318	中国平安	2,236,195.00	2.78
6	601899	紫金矿业	1,732,307.00	2.15
7	601166	兴业银行	1,717,526.00	2.13

8	300059	东方财富	1,678,146.00	2.08
9	300476	胜宏科技	1,557,687.00	1.93
10	000858	五 粮 液	1,492,400.02	1.85
11	601398	工商银行	1,487,996.42	1.85
12	000725	京东方 A	1,460,914.00	1.81
13	600887	伊利股份	1,387,897.00	1.72
14	002352	顺丰控股	1,377,096.00	1.71
15	601288	农业银行	1,329,783.00	1.65
16	688256	寒武纪	1,249,890.47	1.55
17	002241	歌尔股份	1,236,138.00	1.54
18	601328	交通银行	1,227,794.00	1.53
19	601988	中国银行	1,198,123.00	1.49
20	600900	长江电力	1,156,561.00	1.44

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,442,561.00	4.28
2	600036	招商银行	1,745,196.00	2.17
3	300476	胜宏科技	1,675,490.00	2.08
4	300059	东方财富	1,486,581.00	1.85
5	000333	美的集团	1,481,794.00	1.84
6	000858	五 粮 液	1,234,725.00	1.53
7	002241	歌尔股份	1,216,158.00	1.51
8	601988	中国银行	949,209.00	1.18
9	600030	中信证券	933,941.00	1.16
10	600699	均胜电子	867,733.00	1.08
11	002352	顺丰控股	856,467.12	1.06
12	300308	中际旭创	821,579.00	1.02
13	000625	长安汽车	796,015.00	0.99
14	002594	比亚迪	754,902.00	0.94
15	002384	东山精密	727,646.00	0.90
16	002463	沪电股份	721,050.00	0.90
17	300251	光线传媒	711,296.00	0.88
18	300418	昆仑万维	685,502.00	0.85
19	002050	三花智控	668,919.00	0.83
20	300033	同花顺	656,053.00	0.81

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	189,822,018.49
卖出股票收入（成交）总额	115,718,978.66

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

### 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

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。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。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除兴业银行（代码：601166 SH）、招商银行（代码：600036 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1. 兴业银行股份有限公司

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

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

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

#### 2. 招商银行股份有限公司

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

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	177,532.04
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	177,532.04

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
安信中证 A500 指数增强 A	1,081	38,281.36	1,988,571.57	4.81	39,393,574.15	95.19
安信中证 A500 指数增强 C	460	80,155.51	0.00	0.00	36,871,532.47	100.00
合计	1,530	51,146.19	1,988,571.57	2.54	76,265,106.62	97.46

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	安信中证 A500 指数增强 A	10,001.67	0.02
	安信中证 A500 指数增强 C	99.63	0.00
	合计	10,101.30	0.01

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	安信中证 A500 指数增强 A	0
	安信中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信中证 A500 指数增强 A	0
	安信中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信中证 A500 指数增强 A	安信中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 29 日）基金份额总额	75,860,895.03	207,979,650.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,705,317.54	2,231,550.30
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	38,184,066.85	173,339,667.93
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	41,382,145.72	36,871,532.47

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

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

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

### 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容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
大同证券	2	305,540,997.15	100.00	59,856.23	100.00	-

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

### 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(%)
大同证券	-	-	-	-	-	-

### 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	安信中证 A500 指数增强型证券投资基 金基金合同生效公告	证券时报	2025 年 4 月 30 日
2	安信中证 A500 指数增强型证券投资基 金开放申购、赎回、转换及定期定额 投资业务的公告	证券时报	2025 年 5 月 6 日
3	安信基金管理有限责任公司关于终止 民商基金销售（上海）有限公司办理 旗下基金销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2025 年 5 月 28 日
4	安信基金管理有限责任公司关于电子 直销交易平台暂停服务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2025 年 6 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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中证 A500 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

## 12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 28 日