安信中证A500指数增强型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9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

报告送出日期：2026年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	325,659,943.28份
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×95%＋银行活期存款利率（税后）×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。	
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	
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	145,283,480.86份	180,376,462.42份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年7月1日 - 2026年9月30日）	
	安信中证A500指数增强A	安信中证A500指数增强C
1.本期已实现收益	-22,056,657.44	-17,531,856.01
2.本期利润	-35,549,860.46	-30,098,309.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2283	-0.1771
4.期末基金资产净值	177,453,431.25	219,053,750.30
5.期末基金份额净值	1.2214	1.2144

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 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	净值增长率①	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
过去三个月	-13.50%	1.69%	-14.23%	1.43%	0.73%	0.26%
过去六个月	-3.69%	1.57%	-2.62%	1.40%	-1.07%	0.17%
过去一年	1.56%	1.33%	-4.10%	1.24%	5.66%	0.09%
自基金合同生效起至今	22.14%	1.18%	20.18%	1.12%	1.96%	0.06%

安信中证 A500 指数增强 C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-13.58%	1.69%	-14.23%	1.43%	0.65%	0.26%
过去六个月	-3.89%	1.57%	-2.62%	1.40%	-1.27%	0.17%
过去一年	1.16%	1.33%	-4.10%	1.24%	5.26%	0.09%
自基金合同生效起至今	21.44%	1.18%	20.18%	1.12%	1.26%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日。

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2025 年 4 月 29 日	-	13 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

	理，量化投资部副总经理（主持工作）				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、总经理助理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部副总经理（主持工作）。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、安信红利量化选股股票型证券投资基金、安信创业板指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度，从量化投资的风格因子层面看，盈利、估值等因子表现较好，小市值、动量等因子表现较弱。从行业层面看，煤炭、石油石化、农林牧渔等行业表现较好，电子、建筑材料、电力设备等行业表现不佳。

2026年三季度，全球经济与政治格局继续面临较高不确定性，中东地缘冲突反复演化，对全球能源供应和国际油价形成扰动，通胀压力与经济增长放缓之间的矛盾持续凸显。受通胀韧性及能源价格波动影响，主要经济体货币政策面临新的挑战，美联储于9月宣布加息25个基点，进一步加大全球金融市场对利率路径的分歧与不确定性。在此背景下，中国经济总体保持平稳运行，宏观政策持续围绕扩大内需、稳定投资和培育新质生产力协同发力，推动经济结构向高质量发展演进。资本市场层面，人工智能产业链在经历前期持续上涨后，于7月出现显著调整，全球半导体、存储及AI基础设施相关股票普遍承压，市场对AI产业资本开支、估值水平及未来盈利兑现能力的担忧有所上升，相关调整亦传导至中国科技股市场，部分高估值科技资产出现明显回撤。此后，AI产业链内部的结构分化进一步加大，市场对算力需求、技术迭代、国产替代及企业盈利能力的关注持续提升。与此同时，价值与红利类资产的表现受到市场风险偏好变化和资金配置调整的影响，板块轮动与市场风格再平衡特征更加明显。整体来看，全球货币政策变化、地缘政治风险与科技产业估值调整共同影响三季度资本市场运行，中国经济在政策支持与产业升级推动下保持韧性，市场投资逻辑则逐步由单纯的产业主题驱动转向产业景气、估值水平与业绩兑现并重，结构性机会与风险并存。

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。

4.5 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1.2214元，本报告期基金份额净值增长率为-13.50%；安信中证A500指数增强C基金份额净值为1.2144元，本报告期基金份额净值增长率为-13.58%；同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	372,527,560.08	93.49
	其中：股票	372,527,560.08	93.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,002,591.16	5.02
	其中：债券	20,002,591.16	5.02
	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	4,559,836.03	1.14
8	其他资产	1,369,747.81	0.34
9	合计	398,459,735.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	19,951,505.00	5.03
C	制造业	205,033,453.52	51.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,516,778.00	2.65
E	建筑业	6,411,979.00	1.62
F	批发和零售业	5,491,859.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	15,523,117.00	3.91
H	住宿和餐饮业	12,635.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,823,670.59	2.98
J	金融业	29,402,448.00	7.42
K	房地产业	4,812,715.00	1.21
L	租赁和商务服务业	2,587,117.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	6,358,920.00	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	2,536,420.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	113,316.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	320,575,933.11	80.85

5.2.2 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	415,213.75	0.10
C	制造业	42,444,706.04	10.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,934,077.68	0.49
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	333,974.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,394,391.85	0.60
J	金融业	321,850.00	0.08
K	房地产业	1,105,449.00	0.28
L	租赁和商务服务业	865,972.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,670,188.65	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	465,804.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,951,626.97	13.10

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300308	中际旭创	13,800	11,156,472.00	2.81
2	300502	新易盛	19,680	7,655,520.00	1.93
3	300750	宁德时代	23,980	6,980,817.80	1.76
4	600519	贵州茅台	5,144	6,474,341.28	1.63
5	603259	药明康德	38,000	6,358,920.00	1.60
6	688256	寒武纪	5,491	5,540,473.91	1.40
7	603986	兆易创新	13,400	4,742,260.00	1.20
8	601398	工商银行	540,100	4,472,028.00	1.13
9	688981	中芯国际	37,324	4,179,914.76	1.05

10	601318	中国平安	71,900	3,831,551.00	0.97

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688825	长鑫科技	63,414	2,450,951.10	0.62
2	002386	天原股份	299,800	1,753,830.00	0.44
3	688411	海博思创	10,313	1,638,323.18	0.41
4	688172	燕东微	38,214	1,621,420.02	0.41
5	603876	鼎胜新材	90,600	1,561,944.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,001,591.15	5.04
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）	1,000.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,002,591.16	5.04

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019846	26国债14	135,000	13,516,018.77	3.41
2	019792	25国债19	64,000	6,485,572.38	1.64
3	113711	常青转债	10	1,000.01	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-217,388.62
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-164,600.00

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,369,747.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,369,747.81

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	2,450,951.10	0.62	新股锁定

5.11.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	180,766,576.51	140,390,792.28
报告期期间基金总申购份额	44,328,933.60	64,661,612.93
减:报告期期间基金总赎回份额	79,812,029.25	24,675,942.79
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

报告期期末基金份额总额	145,283,480.86	180,376,462.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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

2026 年 10 月 26 日