

安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资 基金(LOF) 2021 年中期报告

2021 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
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	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
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	投资组合报告附注	49
§ 8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末上市基金前十名持有人	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4	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
§ 9	开放式基金份额变动	52
§ 10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	56
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	安信深圳科技指数 (LOF)	
场内简称	深圳科技	
基金主代码	167506	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2019 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	145,497,166.38 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2020 年 1 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
下属分级基金的交易代码	167506	167507
报告期末下属分级基金的份额总额	108,295,396.61 份	37,201,769.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证深圳科技创新主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法进行投资，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证深圳科技创新主题指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p>
业绩比较基准	中证深圳科技创新主题指数收益率 × 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。
--	---

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	秦一楠
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-68121816
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518026	100031
法定代表人		刘入领	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
本期已实现收益	32,094,625.34	11,279,104.89
本期利润	14,309,944.99	4,668,659.82
加权平均基金份额本期利润	0.1113	0.1024
本期加权平均净值利润率	7.86%	7.26%

本期基金份额净值增长率	5.41%	5.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	56,015,609.89	19,022,258.87
期末可供分配基金份额利润	0.5172	0.5113
期末基金资产净值	164,311,006.50	56,224,028.64
期末基金份额净值	1.5172	1.5113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	51.72%	51.13%

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

安信深圳科技指数 (LOF) 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	5.93%	1.36%	5.55%	1.37%	0.38%	-0.01%
过去三个月	16.06%	1.30%	14.52%	1.32%	1.54%	-0.02%
过去六个月	5.41%	1.55%	4.14%	1.53%	1.27%	0.02%
过去一年	14.63%	1.63%	11.32%	1.61%	3.31%	0.02%
自基金合同生效起至今	51.72%	1.78%	51.94%	1.78%	-0.22%	0.00%

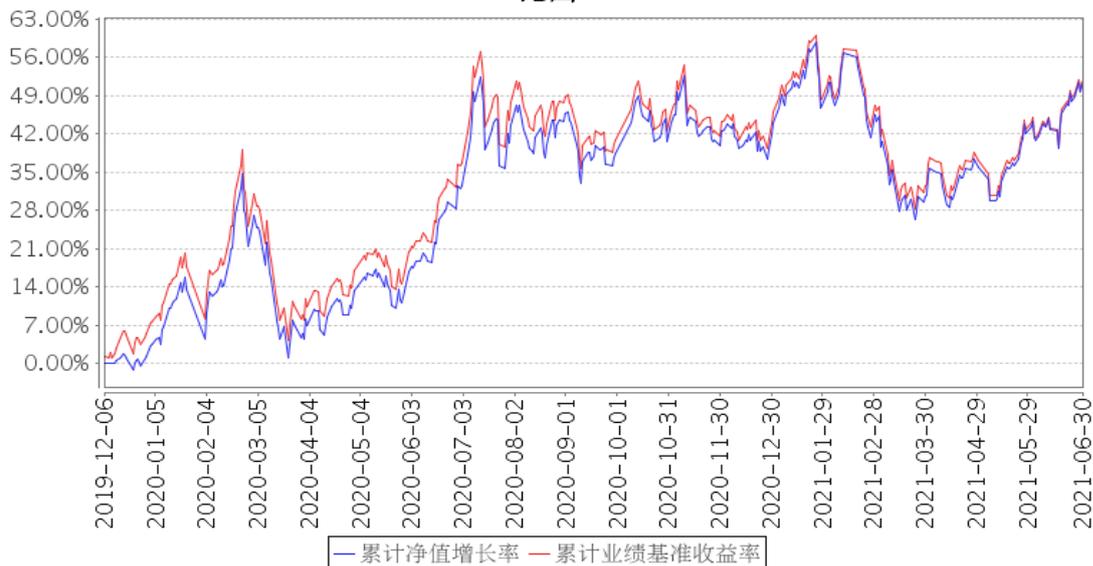
安信深圳科技指数 (LOF) C

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	5.91%	1.36%	5.55%	1.37%	0.36%	-0.01%
过去三个月	15.99%	1.30%	14.52%	1.32%	1.47%	-0.02%
过去六个月	5.29%	1.55%	4.14%	1.53%	1.15%	0.02%
过去一年	14.35%	1.63%	11.32%	1.61%	3.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	51.13%	1.78%	51.94%	1.78%	-0.81%	0.00%

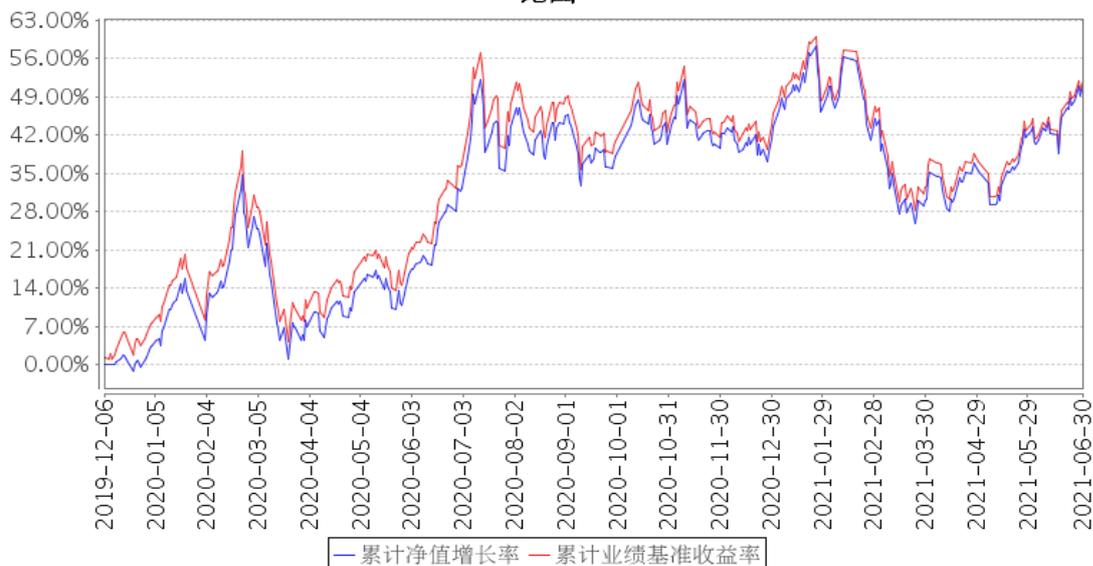
注：根据《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证深圳科技创新主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。中证深圳科技创新主题指数围绕深圳科技创新主题，从成长、估值、质量以及研发四个维度选取一定数量的股票作为指数样本股，采用自由流通市值加权，以反映深圳科技创新主题上市公司的整体表现。由于本基金投资标的指数为中证深圳科技创新主题指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证深圳科技创新主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

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

安信深圳科技指数(LOF)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



安信深圳科技指数(LOF)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 2019 年 12 月 6 日。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 72 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、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、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、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、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、安信永丰定期开放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、安信永泰定期开放债券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、安信永瑞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、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、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、安信平穩双利 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、安信平穩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、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航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		
徐黄玮	本基金的基金经理, 量化投资部总经理	2019 年 12 月 6 日	-	14.0 年	徐黄玮先生, 理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理, 安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 现任安信量化精选沪深 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 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。
施荣盛	本基金的基金经理	2020 年 1 月 13 日	-	8.0 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，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理，安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

2021 年上半年,国内疫情持续控制较好,疫苗接种稳步进行。国内经济在此基础上稳步复苏,但介于整个上半年原材料持续上涨,给企业造成了一定的压力。国家后续出台了相应政策,以抑制大宗商品的上涨。经济增速上半年是逐步放缓的一个过程,下半年预计有一定压力。海外方面,上半年部分国家疫情仍然在反复,美国随着疫苗接种率上升,国内经济活动逐步恢复正常。美国市场由于就业数据较差,流动性方面预计不会采取过激的措施。国内流动性方面,整个上半年基本维持一个相对宽松的状态。

市场方面,上半年前期机会主要是集中在疫情受益以及出口受益方向,如部分周期股;随着国内经济活动逐步恢复正常,市场继续转向高景气度行业进行投资,如新能源、半导体等。

本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,跟踪指数收益,力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.5172 元,本报告期基金份额净值增长率为 5.41%;截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.5113 元,本报告期基金份额净值增长率为 5.29%;同期业绩比较基准收益率为 4.14%。

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 2021 年第三季度,国内经济将继续保持复苏状态,增长或将趋缓,有一定的压力,且结构性也将发生一定变化。我们认为,下半年将从制造业投资、服务性消费以及外需三方面拉动经济增长,会更多地依靠内生增长来稳住经济。在政策支持下,预计仍将以高端制造业作为重点发展方向。大宗商品方面,我们认为目前快速上涨带来的通胀风险还是可控的,主要认为供需格局下半年会有所改善,全球流动性也会有一定边际变化,从而抑制大宗商品的持续上涨。货币政策方面,预计仍将保持相对中性的态度,流动性趋于平稳。国内主要目标主要集中在稳增长,保证疫情后的经济活动平稳过渡。但是要密切关注海外流动性收紧对 A 股市场造成的影响。美联储有在三季度集中缩减 QE 的预期。社融方面,上半年缩减的较快,有基数原因和稳杠杆的原因。下半年预计社融收敛速度将小于上半年,仍将重点防止资金流入房市,鼓励流向制造业等实体经济。所以在流动性变化不大背景下,上半年估值已经有所扩张,下半年估值提升空间较小,要重点关注企业盈利能力的变化。后面我们将持续积极关注市场资金变化,做到有效应对规模变化,将跟踪误差控制在一定范围。

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，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核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：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人

—安信基金管理有限责任公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,545,615.23	9,115,402.70
结算备付金		19,032.79	115,518.87
存出保证金		52,822.57	104,966.93
交易性金融资产	6.4.7.2	218,639,497.05	407,309,119.49
其中：股票投资		207,007,757.87	383,344,385.49
基金投资		-	-
债券投资		11,631,739.18	23,964,734.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		245,268.58	3,776,631.34

应收利息	6.4.7.5	223,693.85	502,767.97
应收股利		67,852.77	-
应收申购款		273,467.91	524,846.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		227,067,250.75	421,449,253.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,000,000.00	8,000,000.00
应付证券清算款		2.16	-
应付赎回款		4,122,710.36	8,697,252.50
应付管理人报酬		90,721.23	171,875.25
应付托管费		18,144.24	34,375.04
应付销售服务费		11,879.44	20,841.60
应付交易费用	6.4.7.7	125,999.56	144,107.12
应交税费		0.47	-
应付利息		1,284.66	9,408.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	161,473.49	273,081.12
负债合计		6,532,215.61	17,350,941.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	145,497,166.38	280,949,189.32
未分配利润	6.4.7.10	75,037,868.76	123,149,123.30
所有者权益合计		220,535,035.14	404,098,312.62
负债和所有者权益总计		227,067,250.75	421,449,253.81

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 145,497,166.38 份，其中安信深圳科技指数 (LOF)A 基金份额总额 108,295,396.61 份，基金份额净值 1.5172 元；安信深圳科技指数 (LOF)C 基金份额总额 37,201,769.77 份，基金份额净值 1.5113 元。

6.2 利润表

会计主体：安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		20,817,884.49	153,603,595.44

1. 利息收入		226,551.89	541,929.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,292.87	115,020.87
债券利息收入		186,826.14	426,908.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,432.88	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,939,533.24	83,726,665.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	44,120,539.21	81,444,665.63
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	17,852.95	122,542.44
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	910,890.43
股利收益	6.4.7.17	801,141.08	1,248,566.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-24,395,125.42	68,924,533.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	46,924.78	410,466.63
减：二、费用		1,839,279.68	3,912,892.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	615,249.25	1,444,663.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	123,049.87	288,932.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	80,326.55	129,182.81
4. 交易费用	6.4.7.20	720,931.05	1,784,241.57
5. 利息支出		82,440.11	18,338.31
其中：卖出回购金融资产支出		82,440.11	18,338.31
6. 税金及附加		0.05	3,279.56
7. 其他费用	6.4.7.21	217,282.80	244,253.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,978,604.81	149,690,703.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,978,604.81	149,690,703.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	280,949,189.32	123,149,123.30	404,098,312.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,978,604.81	18,978,604.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-135,452,022.94	-67,089,859.35	-202,541,882.29
其中：1. 基金申购款	53,220,707.82	22,777,502.92	75,998,210.74
2. 基金赎回款	-188,672,730.76	-89,867,362.27	-278,540,093.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	145,497,166.38	75,037,868.76	220,535,035.14
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	819,538,968.48	11,133,223.71	830,672,192.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	149,690,703.31	149,690,703.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-462,006,006.63	-45,282,057.44	-507,288,064.07

其中：1. 基金申购款	455,896,568.32	72,827,317.17	528,723,885.49
2. 基金赎回款	-917,902,574.95	-118,109,374.61	-1,036,011,949.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	357,532,961.85	115,541,869.58	473,074,831.43

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

范瑛

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

安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）（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”）2019年9月20日下发的证监许可[2019]1739号文“关于准予安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）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《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为2019年11月11日至2019年12月2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(2019)验字第60962175_H08号验资报告。经向中国证监会备案，《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于2019年12月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为819,538,968.48份，其中认购资金利息折合237,325.24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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》及《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》，本基金根据认购/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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/

申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 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，以中证深圳科技创新主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券、债券回购、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、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）。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：本基金投资于股票资产的比例占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证深圳科技创新主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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。

6.4.6.3 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》、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》、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》、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》、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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》的规定及其他相关法规：

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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（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。

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

6.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	7,545,615.23
定期存款	-
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	-
合计	7,545,615.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	176,085,443.29	207,007,757.87	30,922,314.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,632,989.95	11,631,739.18
	银行间市场	-	-
	合计	11,632,989.95	11,631,739.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	187,718,433.24	218,639,497.05	30,921,063.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,645.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	18.64
应收债券利息	222,005.59
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	23.80
合计	223,693.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	125,999.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	125,999.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,377.55
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
应付审计费	19,835.79
应付上市费	29,752.78
合计	161,473.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信深圳科技指数 (LOF) A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	212,718,763.13
本期申购	32,516,941.64	32,516,941.64
本期赎回（以“-”号填列）	-136,940,308.16	-136,940,308.16
本期末	108,295,396.61	108,295,396.61

安信深圳科技指数 (LOF) C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	68,230,426.19
本期申购	20,703,766.18	20,703,766.18
本期赎回（以“-”号填列）	-51,732,422.60	-51,732,422.60
本期末	37,201,769.77	37,201,769.77

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信深圳科技指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,306,222.73	14,133,033.28	93,439,256.01
本期利润	32,094,625.34	-17,784,680.35	14,309,944.99
本期基金份额 交易产生的变动数	-45,966,181.54	-5,767,409.57	-51,733,591.11
其中：基金申 购款	16,414,403.59	-2,453,488.38	13,960,915.21
基金赎 回款	-62,380,585.13	-3,313,921.19	-65,694,506.32
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	65,434,666.53	-9,419,056.64	56,015,609.89

安信深圳科技指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,169,507.20	4,540,360.09	29,709,867.29
本期利润	11,279,104.89	-6,610,445.07	4,668,659.82
本期基金份额交易产生的变动数	-14,208,395.18	-1,147,873.06	-15,356,268.24
其中：基金申购款	10,421,395.44	-1,604,807.73	8,816,587.71
基金赎回款	-24,629,790.62	456,934.67	-24,172,855.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,240,216.91	-3,217,958.04	19,022,258.87

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	30,913.34
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	5,766.52
其他	613.01
合计	37,292.87

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	333,630,082.30
减：卖出股票成本总额	289,509,543.09
买卖股票差价收入	44,120,539.21

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	38,211,870.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,499,684.11
减：应收利息总额	694,333.08
买卖债券差价收入	17,852.95

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	801,141.08
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	801,141.08

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,395,125.42
股票投资	-24,399,727.65
债券投资	4,602.23
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	-24,395,125.42

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	46,924.78
合计	46,924.78

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	720,931.05
银行间市场交易费用	-
合计	720,931.05

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	8,186.86
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	217,282.80

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
安信证券	62,333,832.11	13.31	552,178,967.87	47.76

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	49,867.06	14.72	11,236.14	8.92
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
安信证券	397,090.43	48.03	31,610.84	8.24

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	615,249.25	1,444,663.47
其中：支付销售机构的客户维护费	233,315.06	529,923.85

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的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	123,049.87	288,932.75

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C	合计
安信基金	-	5,435.26	5,435.26
安信证券	-	6,892.10	6,892.10
中国农业银行	-	5,553.12	5,553.12
合计	-	17,880.48	17,880.48

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C	合计
安信基金	-	19,470.82	19,470.82
安信证券	-	22,775.01	22,775.01
中国农业银行	-	15,861.18	15,861.18
合计	-	58,107.01	58,107.01

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 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（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

本基金本报告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

本基金本报告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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人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及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国农业银行	7,545,615.23	30,913.34	2,792,019.19	88,300.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新	2021年	2021年	新股锁	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-

	材	1月13日	7月21日	定						
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	179	8,472.07	45,100.84	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐 照	2021年 3月29 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300967	晓鸣股 份	2021年 4月2日	2021年 10月13 日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精 密	2021年 4月6日	2021年 10月15 日	新股锁 定	6.87	12.07	983	6,753.21	11,864.81	-
300971	博亚精 工	2021年 4月7日	2021年 10月15 日	新股锁 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生 物	2021年 4月8日	2021年 10月19 日	新股锁 定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食 品	2021年 4月8日	2021年 10月15 日	新股锁 定	28.28	115.71	216	6,108.48	24,993.36	-
300975	商络电 子	2021年 4月14 日	2021年 10月21 日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科 技	2021年 4月15 日	2021年 10月26 日	新股锁 定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集 团	2021年 4月15 日	2021年 10月26 日	新股锁 定	33.22	87.50	296	9,833.12	25,900.00	-
300981	中红医 疗	2021年 4月19 日	2021年 10月27 日	新股锁 定	48.59	90.39	185	8,989.15	16,722.15	-
300982	苏文电 能	2021年 4月19 日	2021年 10月27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新 能	2021年 4月21 日	2021年 10月29 日	新股锁 定	24.90	24.81	245	6,100.50	6,078.45	-
300986	志特新 材	2021年 4月21 日	2021年 11月1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传 媒	2021年 4月28	2021年 11月11	新股锁 定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

		日	日							
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股锁 定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月27 日	新股锁 定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 6月4日	2021年 12月16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8日	2021年 12月17 日	新股锁 定	12.54	27.89	693	8,690.22	19,327.77	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9日	2021年 12月20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9日	2021年 12月17 日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	新股锁 定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激	2021年	2022年	新股锁	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

	光	06月28日	01月06日	定						
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	新股锁定	24.60	163.00	497	12,226.20	81,011.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123116	万兴转债	2021年6月9日	2021年7月1日	配债未上市	100.00	100.00	930	92,999.18	92,999.18	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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，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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 2,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 19 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

截至 2021 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 0.04%（2020 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,538,740.00	23,145,345.00
合计	11,538,740.00	23,145,345.00

- 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。
3. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	92,999.18	-
未评级	-	819,389.00
合计	92,999.18	819,389.00

- 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。
3. 债券投资以净价列示。

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。

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，除在附注 6.4.12 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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 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。银行存款、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 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,545,615.23	-	-	-	7,545,615.23
结算备付金	19,032.79	-	-	-	19,032.79
存出保证金	52,822.57	-	-	-	52,822.57
交易性金融资产	11,538,740.00	-	92,999.18	207,007,757.87	218,639,497.05
应收利息	-	-	-	223,693.85	223,693.85
应收股利	-	-	-	67,852.77	67,852.77
应收申购款	-	-	-	273,467.91	273,467.91

应收证券清算款	-	-	-	245,268.58	245,268.58
资产总计	19,156,210.59	-	92,999.18	207,818,040.98	227,067,250.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,122,710.36	4,122,710.36
应付管理人报酬	-	-	-	90,721.23	90,721.23
应付托管费	-	-	-	18,144.24	18,144.24
应付证券清算款	-	-	-	2.16	2.16
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	11,879.44	11,879.44
应付交易费用	-	-	-	125,999.56	125,999.56
应付利息	-	-	-	1,284.66	1,284.66
应交税费	-	-	-	0.47	0.47
其他负债	-	-	-	161,473.49	161,473.49
负债总计	2,000,000.00	-	-	4,532,215.61	6,532,215.61
利率敏感度缺口	17,156,210.59	-	92,999.18	203,285,825.37	220,535,035.14
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,115,402.70	-	-	-	9,115,402.70
结算备付金	115,518.87	-	-	-	115,518.87
存出保证金	104,966.93	-	-	-	104,966.93
交易性金融资产	23,649,495.00	315,239.00	-	383,344,385.49	407,309,119.49
应收利息	-	-	-	502,767.97	502,767.97
应收申购款	-	-	-	524,846.51	524,846.51
应收证券清算款	-	-	-	3,776,631.34	3,776,631.34
资产总计	32,985,383.50	315,239.00	-	388,148,631.31	421,449,253.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,697,252.50	8,697,252.50
应付管理人报酬	-	-	-	171,875.25	171,875.25
应付托管费	-	-	-	34,375.04	34,375.04
卖出回购金融资产款	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	20,841.60	20,841.60
应付交易费用	-	-	-	144,107.12	144,107.12
应付利息	-	-	-	9,408.56	9,408.56
其他负债	-	-	-	273,081.12	273,081.12
负债总计	8,000,000.00	-	-	9,350,941.19	17,350,941.19
利率敏感度缺口	24,985,383.50	315,239.00	-	378,797,690.12	404,098,312.62

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	7,373.15	6,061.63
	2. 市场利率上升 25 个基点	-7,340.96	-6,046.35

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,836,683.34	-	9,836,683.34
应收股利	-	67,852.77	-	67,852.77
资产合计	-	9,904,536.11	-	9,904,536.11
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,904,536.11	-	9,904,536.11
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	60,195,843.41	-	60,195,843.41
资产合计	-	60,195,843.41	-	60,195,843.41
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	60,195,843.41	-	60,195,843.41

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	495,226.81	3,009,792.17
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-495,226.81	-3,009,792.17

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。本基金投资于股票资产的比例占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于中证深圳科技创新主题指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评

估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	207,007,757.87	93.87	383,344,385.49	94.86
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	207,007,757.87	93.87	383,344,385.49	94.86

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 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	11,941,689.86	21,706,882.08
2. 沪深 300 指数下降 5%	-11,941,689.86	-21,706,882.08	

§ 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	207,007,757.87	91.17
	其中：股票	207,007,757.87	91.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,631,739.18	5.12
	其中：债券	11,631,739.18	5.12

	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	7,564,648.02	3.33
8	其他各项资产	863,105.68	0.38
9	合计	227,067,250.75	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	-	-
C	制造业	156,376,445.52	70.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	31,086,802.60	14.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,942,440.00	4.05
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	196,405,688.12	89.06

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	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	568,358.30	0.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.02
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	30,477.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.02
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	35,742.75	0.02
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	765,386.41	0.35

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	9,836,683.34	4.46
合计	9,836,683.34	4.46

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300124	汇川技术	266,891	19,819,325.66	8.99
2	300454	深信服	66,200	17,177,576.00	7.79

3	002475	立讯精密	364,244	16,755,224.00	7.60
4	000063	中兴通讯	473,400	15,731,082.00	7.13
5	002008	大族激光	305,300	12,331,067.00	5.59
6	603160	汇顶科技	77,600	10,059,288.00	4.56
7	00285	比亚迪电子	231,800	9,836,683.34	4.46
8	300136	信维通信	313,100	9,668,528.00	4.38
9	300676	华大基因	75,400	8,942,440.00	4.05
10	002138	顺络电子	216,200	8,382,074.00	3.80
11	002402	和而泰	321,300	7,701,561.00	3.49
12	002139	拓邦股份	327,118	5,884,852.82	2.67
13	600380	健康元	410,323	5,633,734.79	2.55
14	688208	道通科技	64,488	5,609,811.12	2.54
15	300115	长盈精密	224,700	4,628,820.00	2.10
16	300638	广和通	73,618	3,437,960.60	1.56
17	600446	金证股份	201,500	2,909,660.00	1.32
18	300377	赢时胜	218,100	2,429,634.00	1.10
19	002130	沃尔核材	373,900	2,389,221.00	1.08
20	300679	电连技术	82,630	2,381,396.60	1.08
21	002106	莱宝高科	203,300	2,287,125.00	1.04
22	600525	长园集团	332,400	2,150,628.00	0.98
23	002421	达实智能	554,000	2,127,360.00	0.96
24	300624	万兴科技	32,200	1,886,276.00	0.86
25	688389	普门科技	58,797	1,802,716.02	0.82
26	002913	奥士康	23,000	1,792,850.00	0.81
27	300206	理邦仪器	106,700	1,696,530.00	0.77
28	002912	中新赛克	38,880	1,592,913.60	0.72
29	002815	崇达技术	122,400	1,527,552.00	0.69
30	002334	英威腾	260,600	1,495,844.00	0.68
31	603063	禾望电气	86,100	1,424,094.00	0.65
32	688318	财富趋势	6,449	1,205,963.00	0.55
33	002970	锐明技术	26,400	1,146,024.00	0.52
34	002837	英维克	58,400	1,056,456.00	0.48
35	002957	科瑞技术	41,400	1,054,044.00	0.48
36	300531	优博讯	60,800	948,480.00	0.43
37	002979	雷赛智能	32,985	945,679.95	0.43
38	688025	杰普特	19,236	906,207.96	0.41
39	002845	同兴达	32,900	842,898.00	0.38
40	300693	盛弘股份	44,700	801,918.00	0.36
41	300686	智动力	46,200	760,452.00	0.34
42	002869	金溢科技	30,900	731,712.00	0.33
43	000004	国华网安	39,100	725,696.00	0.33
44	300771	智莱科技	28,800	699,264.00	0.32

45	002881	美格智能	21,500	593,400.00	0.27
46	300925	法本信息	22,000	578,380.00	0.26
47	002980	华盛昌	15,000	539,250.00	0.24
48	300532	今天国际	49,600	453,344.00	0.21
49	002835	同为股份	32,800	410,984.00	0.19
50	002917	金奥博	39,500	348,390.00	0.16

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	300919	中伟股份	497	81,011.00	0.04
2	300957	贝泰妮	179	45,100.84	0.02
3	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
4	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
5	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
6	300979	华利集团	296	25,900.00	0.01
7	300973	立高食品	216	24,993.36	0.01
8	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
9	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
10	301009	可靠股份	693	19,327.77	0.01
11	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
12	300981	中红医疗	185	16,722.15	0.01
13	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
14	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
15	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
16	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
17	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
18	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
19	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
20	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
21	300968	格林精密	983	11,864.81	0.01
22	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
23	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
24	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
25	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
26	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
27	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
28	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
29	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
30	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
31	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
32	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00

33	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
34	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
35	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
36	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
37	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
38	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
39	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
40	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
41	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
42	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
43	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
44	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
45	300985	致远新能	245	6,078.45	0.00
46	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
47	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
48	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
49	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
50	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
51	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
52	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
53	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
54	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
55	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
56	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
57	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	11,243,068.31	2.78
2	000063	中兴通讯	8,949,128.00	2.21
3	300676	华大基因	8,204,012.31	2.03
4	002138	顺络电子	8,007,731.00	1.98
5	002402	和而泰	7,875,591.48	1.95
6	688208	道通科技	5,598,461.93	1.39
7	300454	深信服	4,805,923.87	1.19
8	300115	长盈精密	4,670,420.20	1.16
9	600380	健康元	4,000,493.05	0.99
10	603160	汇顶科技	3,563,712.20	0.88
11	300136	信维通信	3,556,038.00	0.88
12	002475	立讯精密	2,852,595.00	0.71

13	00909	明源云	2,725,769.22	0.67
14	002130	沃尔核材	2,422,072.00	0.60
15	300377	赢时胜	2,306,067.00	0.57
16	002106	莱宝高科	2,272,502.00	0.56
17	002421	达实智能	2,249,882.56	0.56
18	600525	长园集团	2,110,558.00	0.52
19	002913	奥士康	1,864,258.72	0.46
20	688389	普门科技	1,716,555.11	0.42

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	39,193,356.62	9.70
2	00700	腾讯控股	32,318,947.82	8.00
3	000063	中兴通讯	23,471,895.00	5.81
4	00909	明源云	21,224,498.35	5.25
5	300124	汇川技术	17,454,639.00	4.32
6	002008	大族激光	16,555,578.39	4.10
7	002475	立讯精密	14,931,130.00	3.69
8	300454	深信服	13,154,555.31	3.26
9	300676	华大基因	12,244,662.00	3.03
10	002456	欧菲光	11,112,189.88	2.75
11	002916	深南电路	10,221,449.67	2.53
12	002138	顺络电子	9,859,822.11	2.44
13	002402	和而泰	8,721,095.40	2.16
14	603160	汇顶科技	7,544,109.73	1.87
15	002831	裕同科技	7,204,832.15	1.78
16	600380	健康元	5,812,959.81	1.44
17	300136	信维通信	5,548,726.00	1.37
18	300348	长亮科技	4,981,277.88	1.23
19	00285	比亚迪电子	4,406,829.43	1.09
20	000555	神州信息	3,865,397.00	0.96

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	137,572,643.12
卖出股票收入（成交）总额	333,630,082.30

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	11,538,740.00	5.23
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）	92,999.18	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,631,739.18	5.27

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	019640	20 国债 10	61,220	6,122,000.00	2.78
2	019645	20 国债 15	54,000	5,416,740.00	2.46
3	123116	万兴转债	930	92,999.18	0.04

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，

本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

7.11.2 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。

7.11.3 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中兴通讯（股票代码：000063 SZ）、汇顶科技（股票代码：603160 SH）、汇川技术（股票代码：300124 SZ）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021年6月11日，中兴通讯股份有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室通报批评、责令改正。

2020年8月20日，深圳市汇顶科技股份有限公司因未依法履行职责被深圳市福田区应急管理局、国家外汇管理局深圳市分局罚款、警告【（深福）应急罚（2020）126号、深外管检（2018）42号】。

2021年5月18日，深圳市汇川技术股份有限公司因未依法履行职责被广东省通信管理局责令改正。

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	52,822.57
2	应收证券清算款	245,268.58
3	应收股利	67,852.77
4	应收利息	223,693.85
5	应收申购款	273,467.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	863,105.68

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300957	贝泰妮	45,100.84	0.02	新股锁定
2	301021	英诺激光	27,424.54	0.01	新股未上市

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 (%)	

安信深圳科技指数 (LOF) A	10,760	10,064.63	-	-	108,295,396.61	100.00
安信深圳科技指数 (LOF) C	6,415	5,799.18	-	-	37,201,769.77	100.00
合计	16,717	8,703.55	-	-	145,497,166.38	100.00

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

安信深圳科技指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	王益平	1,173,667.00	7.37
2	王树梅	1,111,300.00	6.97
3	王杰峰	1,030,375.00	6.47
4	王堂伟	700,000.00	4.39
5	张智超	600,000.00	3.77
6	虞家扬	594,046.00	3.73
7	钱中明	347,779.00	2.18
8	陆露蝶	309,261.00	1.94
9	陈与胜	300,020.00	1.88
10	陈荣荣	280,000.00	1.76

注：上述上市基金前十名持有人为场内持有人。

8.3 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	安信深圳科技指数 (LOF) A	1,565,079.44	1.45
	安信深圳科技指数 (LOF) C	328,044.13	0.88
	合计	1,893,123.57	1.30

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）。

8.4 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	安信深圳科技指数 (LOF) A	50~100
	安信深圳科技指数 (LOF) C	0

	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	安信深圳科技指数 (LOF) A	0
	安信深圳科技指数 (LOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2019 年 12 月 6 日) 基金份额总额	656,289,459.75	163,249,508.73
本报告期期初基金份 额总额	212,718,763.13	68,230,426.19
本报告期基金总申购 份额	32,516,941.64	20,703,766.18
减：本报告期基金总 赎回份额	136,940,308.16	51,732,422.60
本报告期基金拆分变 动份额 (份额减少以 “-” 填列)	-	-
本报告期期末基金份 额总额	108,295,396.61	37,201,769.77

§ 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

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
天风证券	2	406,096,980.89	86.69%	288,855.89	85.28%	-
安信证券	3	62,333,832.11	13.31%	49,867.06	14.72%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

宏信证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

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
天风证券	62,425,661.76	100.00%	77,500,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

证券						
中信建投						
中信证券						

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 调整投资范围并相应修改法律文件的公告	中国证券报	2021-01-21
2	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
3	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
4	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年春节假期非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-02-04
5	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
6	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
7	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-23
8	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-29
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-30
10	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年香港耶稣受难节、清明节、香港复活节期间非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-03-31
11	关于安信目标收益债券型证券投资基金等 35 只基金新增中国中金财富证券有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-06
12	安信基金管理有限责任公司旗下全部	中国证券报、证券日报、	2021-04-21

	基金季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报	
13	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年劳动节期间非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-04-27
14	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年香港佛诞日非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-05-17
15	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-20
16	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交通银行股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-06-10
17	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名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-26
18	关于安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年香港特别行政区成立纪念日非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2021-06-29

§ 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

本基金为深交所上市基金，根据深圳证券交易所《关于深圳证券交易所基金增加扩位证券简称有关事项的通知（深证上[2021]764号）》，经向深交所申请，自2021年8月23日起，新增扩位简称“安信深圳科技 LOF”，扩位简称适用于交易、申购赎回及行情展示。

§ 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深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 募集的文件；
- 2、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；

4、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

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

2021 年 8 月 27 日