

安信价值成长混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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	8
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
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真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	17
§ 7 投资组合报告	39
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	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44

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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信价值成长混合型证券投资基金	
基金简称	安信价值成长混合	
基金主代码	008891	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 18 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	528,603,272.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信价值成长混合 A	安信价值成长混合 C
下属分级基金的交易代码	008891	008892
报告期末下属分级基金的份额总额	487,589,316.50 份	41,013,955.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上，精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资，注重安全边际，为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	资产配置策略方面，本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求，合理确定基金在股票、债券、金融衍生品等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。股票投资策略方面，以价值成长主题相关股票的界定，施用综合分析，合理构建与调整股票组合。债券投资策略方面，通过比较不同券种之间的收益率水平、流动性、信用风险等因素评估债券的内在投资价值，灵活运用多种策略进行债券组合的配置。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。投资的原则是控制投资风险、稳健增值。其中股指期货以对冲持仓现货波动风险为主要原则。资产支持证券投资策略方面，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中债总指数(全价)收益率*25%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。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	乔江晖	贺倩
	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	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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

§ 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(2020 年 3 月 18 日(基金合同生效日)-2020 年 6 月 30 日)	
	安信价值成长混合 A	安信价值成长混合 C
本期已实现收益	26,442,283.52	1,909,192.02
本期利润	111,082,455.62	7,243,497.15
加权平均基金份	0.1178	0.1236

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	11.49%	12.03%
本期基金份额净值增长率	14.73%	14.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	21,819,600.82	1,785,083.12
期末可供分配基金份额利润	0.0447	0.0435
期末基金资产净值	559,393,223.69	47,000,181.01
期末基金份额净值	1.1473	1.1460
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	14.73%	14.60%

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。

4、本基金合同生效日为 2020 年 03 月 18 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

安信价值成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.78%	1.19%	5.39%	0.68%	6.39%	0.51%
过去三个月	14.80%	0.88%	8.70%	0.69%	6.10%	0.19%

自基金合同生效起至	14.73%	0.82%	8.52%	0.86%	6.21%	-0.04%
-----------	--------	-------	-------	-------	-------	--------

安信价值成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.74%	1.19%	5.39%	0.68%	6.35%	0.51%
过去三个月	14.68%	0.88%	8.70%	0.69%	5.98%	0.19%
自基金合同生效起至	14.60%	0.82%	8.52%	0.86%	6.08%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中债总指数（全价）收益率×25%。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债总指数（全价）是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 70%、5%、25%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

安信价值成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信价值成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2020 年 3 月 18 日，截至报告期末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，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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 57 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）、安信睿享纯债债券型证券投资基金、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）、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）。

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		
聂世林	本基金的基金经理	2020 年 3 月 18 日	—	12 年	聂世林先生，经济学硕士。历任安信证券股份有限公司资产管理部研究员、证券投资部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部、权益投资部基金经理助理，现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配合混合型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金的基金经理。
陈振宇	本基金的基金经理，副总经理	2020 年 3 月 18 日	—	26 年	陈振宇先生，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理、证券投资部副总经理，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理，东方基金管理有限责任公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金、安信价值成长混合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。

4.1.3 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》、《证券投资基金销

售管理办法》、《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

“两会”未给出全年 GDP 目标，但并不意味着放弃实现经济增长的努力。二季度宏观经济呈现较为明显的环比改善趋势，地产、汽车等重点行业在边际上受疫情的影响不断减弱。“六保”中的“保就业”是头等任务，如果能达成就业目标，全年的经济或能实现 3% 左右的增长。

加大投资作为保就业的重要抓手，我们认为全年都会维持较高的强度——无论是基建投资，还是地产投资。到下半年，随着重大项目的陆续获批，投资端的表现值得期待。消费端，鼓励地摊经济、直播电商，放松免税政策等等，刺激居民消费，引导海外消费的回流。外围的疫情依然在持续并且社会动荡加剧，这对国内的出口会构成较长时间的压力。

上半年，从投资端这条主线出发，以水泥为代表的建材类周期品，盈利依然会维持较高的水平。地产后周期中，精装修的占比越来越高，集采大势所趋，B 端相对于 C 端消费类建材更为受益。必选消费品由于受疫情冲击最小，盈利增长的确定性高，这也成为市场一致认可的方向。可选消费品中，由于受收入预期下降以及海外出口不景气，不同行业受到的冲击差异较大。随着财富集中度提升，越高端的消费品受到的冲击反而越小。医药的需求相对刚性，虽有一定政策预期的扰动，但科技研发实力强的公司，估值溢价越明显。

上半年建仓期，我们配置部分周期，部分估值相对合理的消费和医药；长期竞争优势明显的 TMT 公司，短期受外部冲击，我们也配置了一定比例。

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 1.1473 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.73%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.1460 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.60%；同期业绩比较基准收益率为 8.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在流动性持续宽松的大背景下，科技成长、消费和周期三个方向都有各自的利弊：

中美的经济摩擦日益显性化，国产产业链在供给端受到一定制约，但进口替代的进程仍在加速。5G 手机的渗透率会持续提升，相关的应用陆续爆发，射频、IDC、云游戏、VR、自动驾驶等领域，具备核心技术能力的公司是我们重点跟踪布局的方向。各国都在加码新能源汽车补贴政策，各主机厂也都在全力往电动化方向转型，中国在新能源汽车具备先发优势，电池等核心零部件，国内公司比较优势明显，未来必然会诞生众多新的产业机会。

周期板块缺乏长期逻辑，但短期水泥等基本面景气度非常高，估值也相对较低。消费，尤其是必选消费，估值已形成泡沫化趋势；可选消费的估值相对合理，风险收益比相对更高。

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、信用研究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、研究部及信用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；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持

估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《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 2020 年 3 月 18 日至 2020 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《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：安信价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	22,645,338.38
结算备付金		12,685,913.89
存出保证金		197,693.80
交易性金融资产	6.4.7.2	575,227,313.24
其中：股票投资		573,347,321.48
基金投资		-
债券投资		1,879,991.76
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		27,297,130.87
应收利息	6.4.7.5	19,084.00
应收股利		316,761.16
应收申购款		1,627,091.78
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		640,016,327.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		31,459,936.73
应付管理人报酬		938,071.22
应付托管费		156,345.23
应付销售服务费		16,461.55
应付交易费用	6.4.7.7	920,040.42
应交税费		4.84
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	132,062.43
负债合计		33,622,922.42
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	528,603,272.37

未分配利润	6.4.7.10	77,790,132.33
所有者权益合计		606,393,404.70
负债和所有者权益总计		640,016,327.12

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 528,603,272.37 份，其中安信价值成长混合 A 基金份额总额为 487,589,316.50 份，基金份额净值 1.1473 元；安信价值成长混合 C 基金份额总额为 41,013,955.87 份，基金份额净值 1.1460 元。

2、本基金基金合同生效日为 2020 年 3 月 18 日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：安信价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同 生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		125,261,130.83
1. 利息收入		1,705,062.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,179,255.29
债券利息收入		144.02
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		525,663.38
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,390,796.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,322,650.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	5,068,145.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	89,974,477.23
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	2,190,794.77
减：二、费用		6,935,178.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,343,768.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	723,961.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,275.19
4. 交易费用	6.4.7.20	1,729,348.55
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.52
7. 其他费用	6.4.7.21	69,823.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		118,325,952.77
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		118,325,952.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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)	1,126,062,877.06	-	1,126,062,877.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	118,325,952.77	118,325,952.77
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)	-597,459,604.69	-40,535,820.44	-637,995,425.13
其中：1. 基金申购款	14,860,549.77	1,227,431.57	16,087,981.34
2. 基金赎回款	-612,320,154.46	-41,763,252.01	-654,083,406.47
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)	528,603,272.37	77,790,132.33	606,393,404.70

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

安信价值成长混合型证券投资基金（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”）2019 年 5 月 28 日下发的证监许可[2019]947 号文“关于准予安信价值成长混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信价值成长混合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。本基金募集期间为 2020 年 2 月 21 日至 2020 年 3 月 12 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（2020）验字 60962175_H06 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信价值成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 18 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 1,126,062,877.06 份，其中认购资金利息折合 929,979.34 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《安信价值成长混合型证券投资基金基金合同》及《安信价值成长混合型证券投资基金招募说明书》，安信价值成长混合型证券投资基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信价值成长混合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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、次级债、永续债）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），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，本基金保持不低于

基金资产净值 5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于价值成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中债总指数（全价）收益率×25%。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟本会计期间为自 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产及贷款和应收款项。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、资产支持证券和衍生工具等投资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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由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利息收入。

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。

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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及相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；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。

6.4.7 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	22,645,338.38
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	22,645,338.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	483,372,844.25	573,347,321.48	89,974,477.23
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	1,879,991.76	1,879,991.76
	银行间市场	—	—
	合计	1,879,991.76	1,879,991.76
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	485,252,836.01	575,227,313.24	89,974,477.23

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,118.34
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	6,720.18
应收债券利息	156.58
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	88.90
合计	19,084.00

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	920,040.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	920,040.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73,931.28
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	32,699.10
应付审计费	25,432.05
合计	132,062.43

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信价值成长混合 A

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,061,774,952.09	1,061,774,952.09
本期申购	10,689,500.72	10,689,500.72
本期赎回（以“-”号填列）	-584,875,136.31	-584,875,136.31
本期末	487,589,316.50	487,589,316.50

安信价值成长混合 C

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
----	---

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	64,287,924.97	64,287,924.97
本期申购	4,171,049.05	4,171,049.05
本期赎回（以“-”号填列）	-27,445,018.15	-27,445,018.15
本期末	41,013,955.87	41,013,955.87

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信价值成长混合 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	-	-	-
本期利润	26,442,283.52	84,640,172.10	111,082,455.62
本期基金份额交易产生的变动数	-4,622,682.70	-34,655,865.73	-39,278,548.43
其中：基金申购款	142,734.04	730,925.65	873,659.69
基金赎回款	-4,765,416.74	-35,386,791.38	-40,152,208.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,819,600.82	49,984,306.37	71,803,907.19
安信价值成长混合 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	-	-	-
本期利润	1,909,192.02	5,334,305.13	7,243,497.15
本期基金份额交易产生的变动数	-124,108.90	-1,133,163.11	-1,257,272.01
其中：基金申购款	54,849.51	298,922.37	353,771.88
基金赎回款	-178,958.41	-1,432,085.48	-1,611,043.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,785,083.12	4,201,142.02	5,986,225.14

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
----	---

活期存款利息收入	1,123,976.64
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	54,865.92
其他	412.73
合计	1,179,255.29

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	499,219,874.27
减：卖出股票成本总额	472,897,223.50
买卖股票差价收入	26,322,650.77

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,068,145.37
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	5,068,145.37

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	89,974,477.23
股票投资	89,974,477.23
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	89,974,477.23

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,188,689.75
基金转换费收入	2,105.02
合计	2,190,794.77

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,729,348.55
银行间市场交易费用	-
合计	1,729,348.55

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	25,432.05
信息披露费	32,699.10
证券出借违约金	-
银行汇划费用	11,292.41
其他	400.00
合计	69,823.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
安信证券	306,656.00	0.02

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2020年3月18日（基金合同生效日）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	218.15	0.02	-	-

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
	2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,343,768.75
其中：支付销售机构的客户维护费	2,365,568.93

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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
	2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	723,961.49

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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		
	2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信价值成长混合 A	安信价值成长混合 C	合计
安信基金	-	769.98	769.98

安信证券	-	37,163.42	37,163.42
中国农业银行	-	15,010.85	15,010.85
合计	-	52,944.25	52,944.25

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% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金本报告期末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
	2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	22,645,338.38	1,123,976.64

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末(2020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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年07月08日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年07月02日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年07月03日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年07月01日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年07月09日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年07月09日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-

688377	迪 威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 07 月 08 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 07 月 01 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688599	天合光能	2020 年 6 月 2 日	2020 年 12 月 10 日	新股锁定	8.16	13.91	102,459	836,065.44	1,425,204.69	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 07 月 03 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600185	格力地产	2020 年 6 月 30 日	重大事项	11.61	2020 年 07 月 01 日	12.77	202,100	2,373,518.00	2,346,381.00	-

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，本基金无从事交易所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。

6.4.12.4 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 2020 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 0.31%。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	—
AAA 以下	1,879,991.76
未评级	—
合计	1,879,991.76

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约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 2020 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	22,645,338.38	-	-	-	22,645,338.38
结算备付金	12,685,913.89	-	-	-	12,685,913.89
存出保证金	197,693.80	-	-	-	197,693.80
交易性金融资产	-	-	1,879,991.76	573,347,321.48	575,227,313.24
应收利息	-	-	-	19,084.00	19,084.00
应收股利	-	-	-	316,761.16	316,761.16
应收申购款	-	-	-	1,627,091.78	1,627,091.78
应收证券清算款	-	-	-	27,297,130.87	27,297,130.87
资产总计	35,528,946.07	-	1,879,991.76	602,607,389.29	640,016,327.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,459,936.73	31,459,936.73
应付管理人报酬	-	-	-	938,071.22	938,071.22
应付托管费	-	-	-	156,345.23	156,345.23
应付销售服务费	-	-	-	16,461.55	16,461.55
应付交易费用	-	-	-	920,040.42	920,040.42
应交税费	-	-	-	4.84	4.84
其他负债	-	-	-	132,062.43	132,062.43
负债总计	-	-	-	33,622,922.42	33,622,922.42
利率敏感度缺口	35,528,946.07	-	1,879,991.76	568,984,466.87	606,393,404.70

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	
	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（2020 年 6 月 30 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	27,809.40
	2. 市场利率上升 25 个基点	-27,354.66

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 2020 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	-	39,752,201.73	-	39,752,201.73
应收股利	-	316,761.16	-	316,761.16
资产合计	-	40,068,962.89	-	40,068,962.89
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	-	40,068,962.89	-	40,068,962.89

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
----	--------------------

	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（2020 年 6 月 30 日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	2,003,448.14
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-2,003,448.14

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%），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，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于价值成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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 2020 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	573,347,321.48	94.55
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	573,347,321.48	94.55

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	
	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（2020 年 6 月 30 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	32,330,403.28
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-32,330,403.28

§ 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	573,347,321.48	89.58
	其中：股票	573,347,321.48	89.58
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,879,991.76	0.29
	其中：债券	1,879,991.76	0.29
	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	35,331,252.27	5.52
8	其他各项资产	29,457,761.61	4.60
9	合计	640,016,327.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	30,097,534.00	4.96
B	采矿业	—	—
C	制造业	386,517,780.06	63.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	10,321,584.00	1.70
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	35,546,391.37	5.86
J	金融业	21,847,916.00	3.60
K	房地产业	2,346,381.00	0.39
L	租赁和商务服务业	16,703,873.00	2.75
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	853,174.00	0.14
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	29,347,720.00	4.84
S	综合	—	—
	合计	533,595,119.75	87.99

7.2.2 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（%）
能源	—	—
材料	—	—
工业	—	—
非必需消费品	—	—
必需消费品	20,815,967.34	3.43
保健	18,936,234.39	3.12
金融	—	—
科技	—	—
通讯	—	—
公用事业	—	—
合计	39,752,201.73	6.56

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600690	海尔智家	2,796,800	49,503,360.00	8.16
2	002475	立讯精密	717,100	36,823,085.00	6.07
3	002241	歌尔股份	1,233,300	36,209,688.00	5.97
4	002938	鹏鼎控股	698,500	34,966,910.00	5.77
5	603916	苏博特	1,324,126	33,301,768.90	5.49
6	002299	圣农发展	1,037,846	30,097,534.00	4.96
7	300144	宋城演艺	1,696,400	29,347,720.00	4.84

8	000625	长安汽车	2,375,561	26,131,171.00	4.31
9	600585	海螺水泥	456,200	24,137,542.00	3.98
10	002304	洋河股份	220,368	23,169,491.52	3.82
11	002371	北方华创	133,000	22,731,030.00	3.75
12	300059	东方财富	1,081,580	21,847,916.00	3.60
13	06186	中国飞鹤	1,468,334	20,815,967.34	3.43
14	002555	三七互娱	423,417	19,815,915.60	3.27
15	601799	星宇股份	140,800	17,881,600.00	2.95
16	002027	分众传媒	2,998,900	16,703,873.00	2.75
17	002624	完美世界	269,600	15,539,744.00	2.56
18	000739	普洛药业	641,100	14,931,219.00	2.46
19	01177	中国生物制药	924,000	12,322,670.98	2.03
20	603378	亚士创能	275,974	12,073,862.50	1.99
21	600176	中国巨石	1,228,800	11,243,520.00	1.85
22	600867	通化东宝	625,233	10,897,811.19	1.80
23	002697	红旗连锁	945,200	10,321,584.00	1.70
24	603799	华友钴业	235,100	9,135,986.00	1.51
25	000651	格力电器	159,500	9,022,915.00	1.49
26	02269	药明生物	39,500	5,116,268.78	0.84
27	603160	汇顶科技	21,000	4,680,900.00	0.77
28	300702	天宇股份	38,700	4,114,584.00	0.68
29	600185	格力地产	202,100	2,346,381.00	0.39
30	600519	贵州茅台	1,600	2,340,608.00	0.39
31	01093	石药集团	111,966	1,497,294.63	0.25
32	688599	天合光能	102,459	1,425,204.69	0.24
33	002007	华兰生物	24,380	1,221,681.80	0.20
34	000526	紫光学大	14,900	853,174.00	0.14
35	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
36	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
37	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
38	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
39	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
40	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
41	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
42	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
43	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
44	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
45	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
46	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
47	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
48	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600690	海尔智家	73,002,890.55	12.04
2	002304	洋河股份	61,781,468.50	10.19
3	002938	鹏鼎控股	52,287,656.00	8.62
4	603916	苏博特	47,642,785.36	7.86
5	600585	海螺水泥	41,747,714.42	6.88
6	002475	立讯精密	34,212,887.00	5.64
7	000625	长安汽车	33,170,374.58	5.47
8	000651	格力电器	32,569,009.00	5.37
9	002241	歌尔股份	32,417,174.78	5.35
10	300144	宋城演艺	29,575,550.00	4.88
11	002299	圣农发展	26,083,540.11	4.30
12	002371	北方华创	23,997,263.88	3.96
13	000401	冀东水泥	23,671,294.00	3.90
14	600742	一汽富维	22,860,707.00	3.77
15	300782	卓胜微	21,480,285.79	3.54
16	06186	中国飞鹤	20,977,096.71	3.46
17	002555	三七互娱	19,429,398.65	3.20
18	002624	完美世界	18,272,135.00	3.01
19	300450	先导智能	17,988,678.00	2.97
20	300737	科顺股份	17,444,064.36	2.88
21	002027	分众传媒	17,439,101.00	2.88
22	300059	东方财富	16,421,671.00	2.71
23	601799	星宇股份	15,179,779.00	2.50
24	600867	通化东宝	14,602,144.06	2.41
25	600176	中国巨石	13,829,505.00	2.28
26	603378	亚士创能	13,107,483.00	2.16
27	002809	红墙股份	13,073,898.00	2.16
28	01093	石药集团	12,788,419.60	2.11
29	000739	普洛药业	12,783,318.00	2.11

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	002304	洋河股份	44,901,772.76	7.40
2	600690	海尔智家	32,990,306.02	5.44

3	002938	鹏鼎控股	30,595,588.28	5.05
4	000651	格力电器	24,889,781.10	4.10
5	600742	一汽富维	21,291,387.79	3.51
6	300782	卓胜微	20,796,477.00	3.43
7	000401	冀东水泥	20,752,627.26	3.42
8	300737	科顺股份	17,194,676.30	2.84
9	300450	先导智能	17,058,592.47	2.81
10	603916	苏博特	14,853,076.00	2.45
11	002475	立讯精密	14,395,483.98	2.37
12	600585	海螺水泥	14,330,158.00	2.36
13	002809	红墙股份	13,568,910.00	2.24
14	002241	歌尔股份	13,174,272.00	2.17
15	01093	石药集团	11,182,415.40	1.84
16	000625	长安汽车	10,617,613.00	1.75
17	000672	上峰水泥	10,298,835.00	1.70
18	300054	鼎龙股份	10,221,326.00	1.69
19	002291	星期六	9,958,755.00	1.64
20	600030	中信证券	8,611,910.00	1.42

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	956,270,067.75
卖出股票收入（成交）总额	499,219,874.27

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	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）	1,879,991.76	0.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,879,991.76	0.31
----	----	--------------	------

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	128112	歌尔转 2	18,800	1,879,991.76	0.31

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

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，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

本基金本报告期内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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	197,693.80
2	应收证券清算款	27,297,130.87
3	应收股利	316,761.16
4	应收利息	19,084.00
5	应收申购款	1,627,091.78
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,457,761.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安 信	9,434	51,684.26	266,908.42	0.05	487,322,408.08	99.95

价 值 成 长 混 合 A						
安 信 价 值 成 长 混 合 C	1,835	22,350.93	0.00	0.00	41,013,955.87	100.00
合计	11,098	47,630.50	266,908.42	0.05	528,336,363.95	99.95

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	安信价值成长混合 A	54,469.89	0.01
	安信价值成长混合 C	600,734.33	1.46
	合计	655,204.22	0.12

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	安信价值成长混合 A	0
	安信价值成长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信价值成长混合 A	0
	安信价值成长混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信价值成长混合 A	安信价值成长混合 C
基金合同生效日 （2020 年 3 月 18 日） 基金份额总额	1,061,774,952.09	64,287,924.97
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	10,689,500.72	4,171,049.05
减：基金合同生效日	584,875,136.31	27,445,018.15

起至报告期期末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	487,589,316.50	41,013,955.87

§ 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

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
兴业证券	2	1,300,035,653.54	89.53%	930,032.08	89.59%	-

国盛证券	2	151,702,235.57	10.45%	107,905.75	10.39%	—
安信证券	2	306,656.00	0.02%	218.15	0.02%	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
宏信证券	2	—	—	—	—	—
世纪证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	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	—	—	—	—	—
上海证券	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
兴业证券	—	—	6,224,700,000.00	100.00%	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—

东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

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	安信价值成长混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报	2020-03-19
2	安信基金管理有限责任公司关于延期披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-03-25
3	安信基金管理有限责任公司关于暂停北京中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-03-30
4	关于安信基金管理有限责任公司旗下开放式基金在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资和转换等业务的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-01
5	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	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-20
6	安信价值成长混合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	上海证券报	2020-05-13
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下所有开放式基金在直销渠道面向养老金客户开展赎回费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-06-01
8	安信基金管理有限责任公司关于 2020 年端午节期间旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换转入及	证券时报，上海证券报，中国证券报	2020-06-19

	定期定额投资业务的公告		
9	安信基金管理有限公司关于 2020 年香港特别行政区成立纪念日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报, 上海证券报, 中国证券报	2020-06-29

§ 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

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价值成长混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信价值成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信价值成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

本基金管理人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>

安信基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日