

安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 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	4
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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37

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	37
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	37
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	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 7 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,036,836,168.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种投资策略，深入挖掘和把握市场投资机会，分享中国经济增长和资本市场发展的成果，力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在经济“新常态”的背景下，动态运用多种策略，实现基金资产长期稳定增值。资产配置上，基于宏观、政策及市场分析，将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间，股票投资方面，客观分析在“新常态”背景下行业景气度和发展前景、行业竞争结构和盈利模式，充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会；债券投资方面，利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合，并注重信用风险的控制；此外，本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金将投资港股通标的股票，从而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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	95588
传真	0755-82799292	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层	
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 55 号
邮政编码	518026	100140
法定代表人	刘入领	陈四清

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	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1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	101,190,847.96
本期利润	-41,447,607.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0305
本期加权平均净值利润率	-2.77%
本期基金份额净值增长率	-2.27%
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	122,513,039.93
期末可供分配基金份额利润	0.1182
期末基金资产净值	1,159,349,207.97
期末基金份额净值	1.118
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	50.09%

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

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	5.08%	0.94%	6.24%	1.01%	-1.16%	-0.07%
过去三个月	6.37%	0.89%	7.35%	1.04%	-0.98%	-0.15%
过去六个月	-2.27%	1.48%	-5.03%	1.43%	2.76%	0.05%
过去一年	10.04%	1.22%	-2.19%	1.12%	12.23%	0.10%
过去三年	25.91%	1.34%	6.27%	1.03%	19.64%	0.31%
自基金合同生效起至今	50.09%	1.39%	8.76%	1.04%	41.33%	0.35%

注：根据《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为： $45\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+45\% \times$ 恒生指数收益率 $+10\% \times$ 中证全债指数收益率。沪深 300 指数是中证指数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。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。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 45%、45%、10% 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



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 7 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 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		
袁玮	本基金的基金经理	2016 年 4 月 11 日	-	10 年	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活

					配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置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的基金经理。
谭 珏 娜	本基金的基金经理助理	2017 年 8 月 11 日	-	14 年	谭珏娜女士，经济学学士。历任招商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员，安信基金管理有限责任公司运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理、研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，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的基金经理。现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理，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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王 博	本基金的基金经理助理	2019 年 7 月 31 日	-	8 年	王博先生，工学硕士。历任中投证券有限责任公司研究部研究员，深圳望正资产管理有限公司研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、现任安信基金管理有限责任公司权益投资部分析师。现任安信动态策略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、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金的基金经理助理；安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2020 年上半年，新冠疫情在全球范围的爆发，让国内外经济都蒙受了巨大的损失，使得大部分上市公司的经营业绩都受到了或多或少的影响，股票市场也一度跌幅巨大。但是另一方面，为了应对疫情冲击，各国央行都大量向市场投放货币，数量之大可以说是前所未有的，充裕的流动性对全球权益市场起到了很强的支撑，尤其是科技、必选消费和医药等行业表现亮眼，估值不断提升。相比之下，传统行业以及周期性行业在经济预期不断走弱的背景下，估值不断下行，使得市场的估值分化程度达到了历史的最大值。

截至 6 月份，社融、信贷数据继续高增，经济各项数据均不同程度上回暖，总体上看，基建与房地产投资恢复较快，消费中的必选和高端消费（奢侈品、高档白酒、豪华汽车等）恢复较好，而一般耐用消费品（汽车、家电）的需求恢复相对较慢，与疫情相关度较高的餐饮、旅游、酒店、交运等行业依然受损严重。出口的整体情况好于预期，海外疫情对供给的影响大于需求，外部环境向国内输入了一定的通胀压力，而中国制造业的率先恢复，也很大程度上对冲了全球的通胀压力。基于国内经济的整体回暖预期，以及中国央行相对稳健的货币投放思路，国内的资产价格走

势分化明显，整体上符合我们此前的预期：股票、房地产表现最好，商品表现其次，债券表现最差。

尽管从公司的经营业绩表现来看，我们选择的低估值蓝筹股表现较好，例如地产的各项数据快速回暖、大量基建项目的启动、银行的一季报表现稳健等，但是市场仍然对中国经济的前景缺乏信心，尤其是传统行业，市场普遍认为接下来的转型过程将会加速这些行业的凋零，因此尽管估值已经处于历史分位数的最低位，尽管当下的经营业绩依然亮眼，但是估值依然一路走低。必须承认，低估值的价值策略在上半年完全背离了市场的主流运行逻辑，本基金的表现也不够理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.118 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.27%，同期业绩比较基准收益率为-5.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期呈现出来的数据看，地产、基建两大传统经济支柱的表现依然会持续超市场预期，尤其是地产的表现有望继续大幅好于市场的主流预期。长期来看，我们依然对中国的房地产与基建产业链充满信心。中国经济正在经历从以“工业化+出口”向“城市化+内需”的转变，从世界经济发展史来看，在这个长达 10 年以上的转变阶段中，房地产依然是经济发展的支柱之一。随着大量基础设施的投建，配套资源（学校、医药、公园、图书馆、音乐厅、游乐场、体育馆、停车场等）短板的补齐，优质土地的供应将越来越充足，供求关系将持续改善，房屋的品质与科技感会不断上升，房价会变得越来越亲民而不是疏民。在这个过程中房地产业的增加值（与利润同步的指标）在 GDP 中的占比会越来越高，房屋的品质、品牌、服务变得越来越重要，房屋真正的从“炒”变成“住”，行业集中度持续提升，龙头公司无疑将迎来新一轮的发展契机。考虑到当前这些股票的估值所隐含的预期过于悲观，我们相信在未来的半年内，本基金依然有机会为投资者取得一个稳健的收益，实现我们中长期的投资目标。关于目前市场中比较热门的一些行业，坦率地讲其中相当一部分个股的估值是脱离基本面运行的，未来也可能存在一定的估值回归压力。另一方面，在不违背价值投资框架的基础上，我们也会努力地尝试拓宽能力圈，尽可能的在更多的行业中挖掘优秀的个股，平衡我们组合的整体风格，进而改善投资者的投资体验。

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，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信新常态沪港深精选股票型证券投资

资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	106,490,079.53	251,543,747.81
结算备付金		1,326,797.82	1,390,373.03
存出保证金		371,910.96	381,397.18
交易性金融资产	6.4.7.2	1,054,764,242.89	1,591,739,632.20
其中：股票投资		1,054,764,242.89	1,591,739,632.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		8,775,895.53	-
应收利息	6.4.7.5	12,522.46	46,383.12
应收股利		-	-
应收申购款		158,457.04	250,454.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,171,899,906.23	1,845,351,988.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-

应付证券清算款		-	25,735,836.00
应付赎回款		9,486,006.89	117,357,932.88
应付管理人报酬		1,575,410.90	2,116,688.70
应付托管费		262,568.47	352,781.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,113,264.49	1,261,751.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,447.51	384,480.35
负债合计		12,550,698.26	147,209,470.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,036,836,168.04	1,483,795,367.78
未分配利润	6.4.7.10	122,513,039.93	214,347,149.49
所有者权益合计		1,159,349,207.97	1,698,142,517.27
负债和所有者权益总计		1,171,899,906.23	1,845,351,988.21

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.118 元，基金份额总额 1,036,836,168.04 份。

6.2 利润表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 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
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-23,879,092.08	135,989,603.46
1. 利息收入		471,692.69	231,336.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	471,692.69	227,446.46
债券利息收入		-	14.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,875.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		116,469,401.00	66,833,942.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	103,017,118.17	53,210,789.98
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	10,040.71

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	13,452,282.83	13,613,111.96
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.18	-142,638,455.92	68,675,910.33
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	1,818,270.15	248,414.42
减：二、费用		17,568,515.88	8,144,496.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,137,635.66	4,974,103.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,856,272.63	829,017.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	4,460,275.09	2,246,239.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	0.06
7. 其他费用	6.4.7.21	114,332.50	95,136.48
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-41,447,607.96	127,845,106.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-41,447,607.96	127,845,106.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	1,483,795,367.78	214,347,149.49	1,698,142,517.27
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	-41,447,607.96	-41,447,607.96
三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数	-446,959,199.74	-50,386,501.60	-497,345,701.34

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	531,033,838.99	57,014,409.85	588,048,248.84
2. 基金赎回款	-977,993,038.73	-107,400,911.45	-1,085,393,950.18
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)	1,036,836,168.04	122,513,039.93	1,159,349,207.97
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	426,018,022.51	-6,003,080.75	420,014,941.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	127,845,106.62	127,845,106.62
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)	308,557,950.44	58,345,098.71	366,903,049.15
其中：1. 基金申购款	447,882,124.45	90,263,848.08	538,145,972.53
2. 基金赎回款	-139,324,174.01	-31,918,749.37	-171,242,923.38
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)	734,575,972.95	180,187,124.58	914,763,097.53

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

安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金（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”）2015年6月15日下发的证监许可[2015]1248号文《关于准予安信新常态沪港深精选股票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《安信新常态沪港深精选股票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2015年7月2日至2015年8月3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(2015)验字60962175_H87号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币224,675,782.53元。经向中国证监会备案，《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》于2015年8月7日正式生效。截至2015年8月7日止，安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币224,675,782.53元，折合224,675,782.53份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币47,579.66元，折合47,579.66份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币224,723,362.19元，折合224,723,362.19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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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上市的股票）、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金各类资产投资比例为：本基金股票投资比例为基金资产的80%-95%（其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的0-95%），基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*45%+恒生指数收益率*45%+中证全债指数收益率*10%。

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》、《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 1 月 1 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 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	106,490,079.53
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	106,490,079.53

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	1,060,276,173.35	1,054,764,242.89	-5,511,930.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,060,276,173.35	1,054,764,242.89	-5,511,930.46

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工具。

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	11,758.56
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	596.60
应收债券利息	-
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	167.30
合计	12,522.46

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	1,113,264.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,113,264.49

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	13,993.61
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	59,672.34
应付审计费	39,781.56
合计	113,447.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,483,795,367.78	1,483,795,367.78
本期申购	531,033,838.99	531,033,838.99
本期赎回（以“-”号填列）	-977,993,038.73	-977,993,038.73
本期末	1,036,836,168.04	1,036,836,168.04

注：申购含转入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	132,837,413.77	81,509,735.72	214,347,149.49
本期利润	101,190,847.96	-142,638,455.92	-41,447,607.96
本期基金份额交易产生的变动数	-63,281,441.25	12,894,939.65	-50,386,501.60
其中：基金申购款	66,977,187.31	-9,962,777.46	57,014,409.85
基金赎回款	-130,258,628.56	22,857,717.11	-107,400,911.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	170,746,820.48	-48,233,780.55	122,513,039.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	451,200.44
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	17,048.46
其他	3,443.79
合计	471,692.69

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	1,800,315,381.53
减：卖出股票成本总额	1,697,298,263.36
买卖股票差价收入	103,017,118.17

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1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,452,282.83
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	13,452,282.83

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1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-142,638,455.92
股票投资	-142,638,455.92
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	-142,638,455.92

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	1,816,529.69
基金转换费收入	1,740.46
合计	1,818,270.15

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	4,460,275.09
银行间市场交易费用	-
合计	4,460,275.09

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,878.60
银行间账户维护费	9,000.00
合计	114,332.50

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(以下简称“安信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称“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(以下简称“安信乾盛”)	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,137,635.66	4,974,103.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,306,188.04	390,606.15

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。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,856,272.63	829,017.29

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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 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

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 8 月	-	-

7 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	7,691,538.46
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	7,691,538.46
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注: 本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
安信乾盛	4,445,255.57	0.43	-	-

注: 本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
工商银行	106,490,079.53	451,200.44	89,527,997.97	212,025.69

注: 本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管, 按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金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	-
688085	三友医疗	2020年3月30日	2020年10月9日	新股锁定	20.96	67.62	8,807	184,594.72	595,529.34	-
688106	金宏气体	2020年6月9日	2020年12月16日	新股锁定	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	-
688200	华峰测控	2020年2月11日	2020年8月18日	新股锁定	107.41	270.02	3,780	406,009.80	1,020,675.60	-
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	-

			日							
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	-
688566	吉贝尔	2020年5月8日	2020年11月18日	新股锁定	23.69	38.43	9,882	234,104.58	379,765.26	-
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	-
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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金无从事证券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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券投资（2019 年 12 月 31 日：无）。

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 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	106,490,079.53	-	-	-	106,490,079.53
结算备付金	1,326,797.82	-	-	-	1,326,797.82
存出保证金	371,910.96	-	-	-	371,910.96
交易性金融资产	-	-	-	1,054,764,242.89	1,054,764,242.89
应收利息	-	-	-	12,522.46	12,522.46
应收申购款	-	-	-	158,457.04	158,457.04

应收证券清算款	-	-	-	8,775,895.53	8,775,895.53
资产总计	108,188,788.31	-	-	-1,063,711,117.92	1,171,899,906.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,486,006.89	9,486,006.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,575,410.90	1,575,410.90
应付托管费	-	-	-	262,568.47	262,568.47
应付交易费用	-	-	-	1,113,264.49	1,113,264.49
其他负债	-	-	-	113,447.51	113,447.51
负债总计	-	-	-	12,550,698.26	12,550,698.26
利率敏感度缺口	108,188,788.31	-	-	-1,051,160,419.66	1,159,349,207.97
上年度末 2019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	251,543,747.81	-	-	-	251,543,747.81
结算备付金	1,390,373.03	-	-	-	1,390,373.03
存出保证金	381,397.18	-	-	-	381,397.18
交易性金融资产	-	-	-	-1,591,739,632.20	1,591,739,632.20
应收利息	-	-	-	46,383.12	46,383.12
应收申购款	-	-	-	250,454.87	250,454.87
资产总计	253,315,518.02	-	-	-1,592,036,470.19	1,845,351,988.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	117,357,932.88	117,357,932.88
应付管理人报酬	-	-	-	2,116,688.70	2,116,688.70
应付托管费	-	-	-	352,781.45	352,781.45
应付证券清算款	-	-	-	25,735,836.00	25,735,836.00
应付交易费用	-	-	-	1,261,751.56	1,261,751.56
其他负债	-	-	-	384,480.35	384,480.35
负债总计	-	-	-	147,209,470.94	147,209,470.94
利率敏感度缺口	253,315,518.02	-	-	-1,444,826,999.25	1,698,142,517.27

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

本基金于 2020 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。本基金股票投资比例为基金资产的 80%-95%（其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的 0-95%），基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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		上年度末 2019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	1,054,764,242.89	90.98	1,591,739,632.20	93.73
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	1,054,764,242.89	90.98	1,591,739,632.20	93.73

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）

1. 沪深 300 指数上升 5%	57,593,078.98	89,637,897.63
2. 沪深 300 指数下降 5%	-57,593,078.98	-89,637,897.63

§ 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	1,054,764,242.89	90.00
	其中：股票	1,054,764,242.89	90.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	107,816,877.35	9.20
8	其他各项资产	9,318,785.99	0.80
9	合计	1,171,899,906.23	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	-	-
B	采矿业	40,726,943.38	3.51
C	制造业	310,984,118.26	26.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	75,125,952.56	6.48
F	批发和零售业	8,982,664.32	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	13,821,128.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,906,533.65	5.25
J	金融业	223,369,485.66	19.27

K	房地产业	265,559,192.64	22.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,305,700.00	1.58
N	水利、环境和公共设施管理业	5,676,823.60	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,210,056.50	0.97
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	20,082,878.00	1.73
S	综合	-	-
	合计	1,054,764,242.89	90.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	2,770,010	72,408,061.40	6.25
2	601668	中国建筑	14,748,436	70,350,039.72	6.07
3	600383	金地集团	5,102,789	69,908,209.30	6.03
4	600048	保利地产	4,593,753	67,895,669.34	5.86
5	601318	中国平安	897,000	64,045,800.00	5.52
6	002230	科大讯飞	1,622,116	60,715,801.88	5.24
7	000069	华侨城A	9,133,210	55,347,252.60	4.77
8	600036	招商银行	1,612,135	54,361,192.20	4.69
9	601166	兴业银行	2,778,000	43,836,840.00	3.78
10	002202	金风科技	4,126,685	41,143,049.45	3.55
11	000338	潍柴动力	2,923,075	40,104,589.00	3.46
12	600196	复星医药	1,144,700	38,748,095.00	3.34
13	002078	太阳纸业	3,940,866	37,517,044.32	3.24
14	002142	宁波银行	1,306,898	34,332,210.46	2.96
15	601225	陕西煤业	4,266,258	30,759,720.18	2.65
16	600030	中信证券	1,111,300	26,793,443.00	2.31
17	600690	海尔智家	1,419,300	25,121,610.00	2.17
18	600741	华域汽车	1,198,190	24,910,370.10	2.15
19	603833	欧派家居	195,037	22,604,788.30	1.95
20	600585	海螺水泥	392,165	20,749,450.15	1.79
21	600031	三一重工	1,092,859	20,502,034.84	1.77
22	300144	宋城演艺	1,160,860	20,082,878.00	1.73
23	603259	药明康德	189,500	18,305,700.00	1.58
24	601636	旗滨集团	2,399,092	14,202,624.64	1.23

25	601021	春秋航空	392,200	13,821,128.00	1.19
26	000333	美的集团	204,720	12,240,208.80	1.06
27	002607	中公教育	403,966	11,210,056.50	0.97
28	601899	紫金矿业	2,265,278	9,967,223.20	0.86
29	601966	玲珑轮胎	469,900	9,491,980.00	0.82
30	000501	鄂武商 A	572,874	8,982,664.32	0.77
31	603359	东珠生态	339,320	5,676,823.60	0.49
32	601186	中国铁建	569,918	4,775,912.84	0.41
33	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.09
34	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.09
35	688085	三友医疗	8,807	595,529.34	0.05
36	688566	吉贝尔	9,882	379,765.26	0.03
37	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
38	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
39	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
40	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
41	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
42	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
43	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
44	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
45	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
46	300847	300847 SZ	1,421	9,861.74	0.00
47	300845	N捷安	470	8,286.10	0.00
48	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
49	300840	300840 SZ	1,185	7,038.90	0.00
50	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	600383	金地集团	107,203,986.17	6.31
2	002202	金风科技	65,446,600.23	3.85
3	600741	华域汽车	58,544,111.71	3.45
4	600048	保利地产	56,021,673.43	3.30
5	000002	万科 A	54,072,227.60	3.18
6	000338	潍柴动力	52,347,360.00	3.08
7	002078	太阳纸业	52,203,533.44	3.07
8	002230	科大讯飞	46,469,707.04	2.74
9	601186	中国铁建	43,846,396.36	2.58
10	603259	药明康德	42,571,167.82	2.51
11	000501	鄂武商 A	42,434,142.38	2.50

12	000069	华侨城 A	42,397,468.05	2.50
13	601899	紫金矿业	41,939,109.05	2.47
14	600196	复星医药	40,792,014.63	2.40
15	601225	陕西煤业	38,778,528.30	2.28
16	601636	旗滨集团	37,423,539.56	2.20
17	600031	三一重工	35,301,702.33	2.08
18	600690	海尔智家	32,982,287.05	1.94
19	002142	宁波银行	30,259,932.04	1.78
20	600585	海螺水泥	28,781,413.84	1.69

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600383	金地集团	124,430,711.62	7.33
2	603259	药明康德	103,446,991.83	6.09
3	002230	科大讯飞	96,031,204.60	5.66
4	600196	复星医药	77,181,491.23	4.55
5	601186	中国铁建	75,778,204.00	4.46
6	600606	绿地控股	74,572,962.36	4.39
7	000501	鄂武商 A	66,486,778.30	3.92
8	600741	华域汽车	62,091,567.98	3.66
9	603833	欧派家居	56,361,578.85	3.32
10	600048	保利地产	55,518,932.90	3.27
11	002078	太阳纸业	54,735,830.18	3.22
12	601636	旗滨集团	54,462,377.84	3.21
13	000338	潍柴动力	49,192,611.40	2.90
14	601668	中国建筑	47,681,753.84	2.81
15	000002	万科 A	44,746,852.10	2.64
16	600690	海尔智家	43,771,521.40	2.58
17	002142	宁波银行	43,042,297.89	2.53
18	000932	华菱钢铁	42,544,372.16	2.51
19	600068	葛洲坝	36,637,038.02	2.16
20	600031	三一重工	36,448,999.32	2.15
21	601899	紫金矿业	34,678,872.75	2.04

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。

7.4.3 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	1,302,961,329.97
卖出股票收入（成交）总额	1,800,315,381.53

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

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

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

7.11.2 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

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

7.12 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国建筑（股票代码：601668.SH）、招商银行（股票代码：600036.SH）、科大讯飞（股票代码：002230.SZ）、保利地产（股票代码：600048.SH）、金风科技（股票代码：002202.SZ）、兴业银行（股票代码：601166.SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2019-2020 年，中国建筑股份有限公司因未依法履行职责被深圳市住房和建设局【深建罚（2019）280 号】、国家税务总局北京市海淀区税务局【京海一税简罚（2019）6025922 号】处以罚款，被国家税务总局大连市中山区税务局、成都市住建局、济宁市住建局通报批评并责令改正；因违反交通法规被江西省交通建设工程质量监督管理局罚款五万元【赣交质安监罚（2019）5 号】。

2019 年 7 月 8 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被全国银行间同业拆借中心通报批评。

2019 年 8 月 22 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被深圳市消委会责令改正。

2020 年 1 月 2 日，招商银行股份有限公司因违规经营被银保监会消保局依法依规进行后续处理。

2019 年，科大讯飞股份有限公司因未依法履行职责被工业和信息化部、国家税务总局合肥高新技术产业开发区税务局、中华人民共和国工业和信息化部网络安全管理局责令改正。

2019 年 8 月 26 日，保利发展控股集团股份有限公司因违反税收管理被国家税务总局广州市税务局第三税务分局罚款 2000 元【穗税三分局 罚（2019）150035 号】。

2020 年 5 月 9 日，新疆金风科技股份有限公司因违反海关监管规定被上海浦东国际机场海关罚款 9700 元【沪浦机关缉违字[2020]0142 号】。

2019 年 8 月 19 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会监管(约见)谈话并责令改正。

2020 年 4 月 27 日，兴业银行股份有限公司因违反自律规则被中国银行间市场交易商协会自律处分。

2020 年 5 月 15 日，兴业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，被中国银行间市场交易商协会警告并责令整改。

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	371,910.96
2	应收证券清算款	8,775,895.53
3	应收股利	-
4	应收利息	12,522.46
5	应收申购款	158,457.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,318,785.99

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

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 (%)
4,084	253,877.61	977,924,891.99	94.32	58,911,276.05	5.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,113,515.70	0.11

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 8 月 7 日）基金份额总额	224,723,362.19
本报告期期初基金份额总额	1,483,795,367.78
本报告期基金总申购份额	531,033,838.99
减：本报告期基金总赎回份额	977,993,038.73
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	1,036,836,168.04

§ 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	
广发证券	2	794,987,091.31	25.73%	565,471.04	24.35%	-
华泰证券	1	621,445,177.03	20.11%	442,036.88	19.04%	-
中信证券	2	589,707,827.53	19.09%	537,400.25	23.14%	-
国泰君安	1	326,079,454.19	10.55%	238,462.47	10.27%	-
东莞证券	2	323,992,212.12	10.49%	230,453.43	9.92%	-
中泰证券	2	302,172,603.53	9.78%	214,936.32	9.26%	-
国金证券	1	131,108,879.82	4.24%	93,258.11	4.02%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于暂停泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报	2020-01-14
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	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-01-17
3	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-01-20
4	安信新常态沪港深精选股票证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年3月更新）	中国证券报	2020-03-13
5	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
6	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
7	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
8	安信基金管理有限责任公司关于香港耶稣受难节、复活节期间旗下部分基金非港股通交易日暂停相关业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-08
9	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
10	安信基金管理有限责任公司关于 2020 年香港佛诞日期间旗下部分基金非港股通交易日暂停相关业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-24
11	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	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报	2020-04-28
12	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

13	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	2020-06-19
14	安信基金管理有限责任公司关于 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200228-20200229; 20200512-20200630	260,368,518.12	-	-	260,368,518.12	25.11
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新常态沪港深精选股票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

2020年8月28日