安信新价值灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:安信基金管理有限责任公司 基金托管人:宁波银行股份有限公司 送出日期2012年20日

送出日期:2018年08月20日 51 重要提示 51 重要提示 66管理人份董平会、董平保证本报告所载资料不存在虚假记载。误导性陈述或표大遗漏,并对其内容 的宾实性、海滩居识影性实担个别及连带的选择责任。本半年度报告已经三分之二以上放立董事签字问 意,并由董事长签发。

思,并由董事长签发。 基金托管人介波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28日复核了本程告中的财务指 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已载,误导性陈 述或者形式遗嘱。

達或者虽大遭編。 基金管理人承诺以減次信用,勤勉母素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 谈明书及其更新。

肝及其史衡。 半年度报告擴要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

基金简称	安信新价值混合				
基金主代码	003026				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2016年8月19日				
基金管理人	安信基金管理有限责任公司				
基金托管人	宁波银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额	66,460,363.52(f)				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	安信新价值混合A	安信新价值混合C			
下属分级基金的交易代码	003026	003027			
报告期末下属分级基金的 份额总额	4,020,346.49份 62,440,017.03份				

本基金将以严格的风险控制为前提,结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及活人的个股/个券挖掘,动态灵活调整投资策略,力争为基金份额持有人获取超越业绩比率 "配置方面,本基金以定性研究为主,结合定量分析,制定股票,债券。现金等大 间的配置比例,调整原则和调整范围;固定收益类投资方面,本基金将灵活采用 风险收益特征 基金管理人和基金托

3.1.1 期间数据和指标 期末基金份額净值 ::1、所述基金业绩指

		安	信新价值混合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	10-3	2-4
过去一个月	-1.03%	0.34%	-3.44%	0.63%	2.41%	-0.299
过去三个月	-0.43%	0.31%	-4.17%	0.56%	3.74%	-0.259
过去六个月	-1.27%	0.44%	-5.08%	0.57%	3.81%	-0.139
过去一年	10.21%	0.41%	-1.32%	0.47%	11.53%	-0.069
自基金合同生 效起至今	19.25%	0.33%	0.44%	0.41%	18.81%	-0.089
		安	信新价值混合C	;		
	60 000 0 00000	份额净值增	小幼叶小校基	业绩比较基准		
阶段	份额净值增 长率①	长率标准差	准收益率3	收益率标准差 ④	(I) - (3)	2-4
阶段 过去一个月	分额净值增 长率① -1.04%	长率标准差 2 0.34%		收益率标准差 ④ 0.63%	①-③ 240%	
	长率①	(2)	准收益率③	40		2) - (4) -0.299 -0.269
过去一个月	长率①	0.34%	准收益率③ -3.44%	0.63%	240%	-0.299
过去一个月 过去三个月	长率① -1.04% -0.48%	0.34%	准收益率③ -3.44% -4.17%	0.63% 0.56%	2.40% 3.69%	-0.299 -0.269



:1.本基金基金合同生效日为2016年8月19日。 本基金合同规定、基金管理人应单旨基金合理生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金 初定。建仓期档束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。 5.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金证明mros 4.11 基金管理人及转管理基金的经验 安倍基金管理利限责任公司经中国证监会批准。成立于2011年12月,总部位于高圳,注册资本5.0625亿 15日,现在及股股转均为,石宁省本股股有限公司持有20.04%的股权,安信证券股份有限公司持有 6%的股权,他山市原德区新普贸易有限公司持有20.28%的股权,中广被财务有限责任公司持有5.03%的

無限证券投資縣金,从2015年4月16日高管理安信汤金與略與尾配置混合型证券投资基金,从2015年5月11日起管理安信中证一带一部主题情報分级证券收货基金。从2015年5月16日起管理安信的证一带一部主题情報分级证券收货基金。从2015年5月10日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款分别金。从2015年5月5日起管理安信款金,从2015年5月5日起管理安信款分别金。从2016年5月9日至2015年5月28日管理定信贷安登保本港合型证券投资基金,从2016年5月5日起管理安信款的报及无限显决。从2016年5月2日已营理安信款价度,是否证券投资基金,从2016年5月5日起管理安信款价值,是否证券投资基金,从2016年5月5日起管理安信款价值,是否证券投资基金,从2016年5月5日起营理安信款价值,是否证券投资基金,以2016年5月5日起营业安信款价值,是否证券投资基金,从2016年5月5日起营业安信款金,从2016年10月16日起营业安信款金,从2016年10月16日起营业安信款金。以2016年5月7日起营业安信款金。以2016年5月7日过营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2016年10月7日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安任款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日起营业全营业公司金。2017年1月1日起营业全营业公司金。2017年1月1日起营业安信款金。以2017年1月1日在营业安信款金。以2017年1月1日在营业安信款金。以2017年1月1日在营业安信款金。以2017年1月1日在营业安信款金。以2017年1月1日起营业全营业金。2017年1月1日起营业全营业金。2017年1月1日起营业全营业金。2017年1月1日起营业全营业金。2017年1月1日起营业全营业金。2017年1月1日在营业全营业金。2017年1月1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日至日本金、2017年1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日至日本营业金、2017年1日至日本营业金、2017年1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日本金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日至日本金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日本金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日本营业金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、2017年1日本金、 勞风活配置能含型证券投资基金,从2016年12月10日起管理交信需要。 势风活配置能含型证券投资基金,从2016年12月10日起管理交信需要的现在, 2017年1月13日至2018年6月11日管理宣信未废证押托债债券型证券投资基金。从2017年3月16日起管理交信需要。 2017年1月13日至2018年6月11日管理宣信未废证押托债债券型证券投资基金。从2017年3月16日起管理交信 信需起点规定配置能合管证券投资基金。从2017年3月16日起管理安信中国新造业公司净债率及活配置能合 证券投资基金。从2017年1月20日起管理安信与作助新工业净产程度正面监督产业产业投资基金。从2017年7月20日起管理安信证处现实是发现金。 4次2017年12月20日起管理安信本发现基金,从2017年12日日起管理安信选择。 对基金,从2017年12月20日起管理安信本发出于12月日起管理安信动能停水流定即开放混合规发起 式基金,从2017年12月20日起管理安信本发出形式的条件发生之机关身投资基金。从2018年5月14日起管理 支信等享延龄专业证券投资起产业公司经济基金。从2018年3月2日起管理安信处效为规定证券合置证券投资基金, 从2018年5月30日起管理安信未废定则不债券型发起式汇券投资基金,2018年6月1日起管理发信本第 2017年6月1日起管理经信中证契发展(2018年6月12日起管理经信本条件强等企业分享基金)。 121日起管理经信中证契发展(1013年8月12日起管理经信本条件强等企业分享基金)。 121日包管理经信中证契发展(1013年8月12日起管理经信本条件强等。 121日包管理经信中证契发展(1013年8月12日起管理经信本条件强等。) 121日总管理经信中证契发展(1013年8月12日起管理经信本条件强等。) 121日总管理经信中证契发展(1013年8月12日起管理经信本条件强等。) 121日总管理经信息,2018年6月12日起管理经信,2018年6月12日起管理经信。

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	
70. L3		任职日期	离任日期	AE stribit		
庄园	本基金的基金经理	2016年8月19日	-	14.0	は関本し、他の子の他、伊子に最高を物理的場合。 「中でのできなり、「動物の体を発生的ない」 のできなり、「からない」のできない。 は、一般では、一般では、一般では、一般では、一般では、一般では、一般では、一般で	
李巍	本基金的基金經理助理	2016年10 月25日	-	5.0	を構造し、再学者に、特性有限を基金管理を持つ。 で、登場的を支援し、関連を登場し、対して、 は、対して、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、、	

注:1.基金经理的"任职日期"根据公司决定的公告(主效)日期填写;基金经理助理的"任职日期"根司决定确定的聘任日期报写。"海任田明"根据公司决定的公告(主效)日期填写。"海任田明"根据公司决定的公告(主效)日期填写。 2.证券从业年报计算标准进从行业协会(证券业从业人员资格管理处准)中关于证券从业人员范围的

2.证券从处年限计算标准建从T3E/D9 x 1 M2726/C/M2 村发规定。 42 管理人对报告期内本基金信用选择守信情况的说明 本报告期介,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)、公开募解证券投资基金信息作管理办法)、(证券投资基金信息规障管理办法)等有方法律法规、监管部门的相关规定基金合同的定定、依明能公司用、勤助是劳、安全级的间隙间等规定用基金资产。在认真控制投资风险的基础上、为基金份额持有人规定最大利益。没有损害基金份额持有人利益的行为。

astrounce、WEE.
4.22 异常交易行为的专项说明
本报告即许未发现来基合存在等常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价
同日应向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交融的等。
4. 省界人別侵害的基金的投资重整和运行分析
2018年2季度运筹证的同时通过最大股份的明
4.1 报告期的基金投资重整和运行分析
2018年2季度运筹证时间计划逐从净重的6.03%下降至6.7%、宏观数据显示、无论是在投资还是消费方面,内阁造造均有形成级。央行推出了一系列货币成策度,以及规则程、机场风险的权衡、定向降由普越会最少为强处申期的投资则,至至解收。由老红行至次起红行、收回服用区或审批权限,通免统市任安置使等
PSL资金等级防地产价格大幅变动;不到随美国加速、保持货币政策致立性。
利率极方面,提上日底、上半年16年期间接收基本从205%服务下行至3.47%、跌幅约40p.,10年期国
开俄收益率别人457%回路至4.25%、跌幅的90p.),信用格方面,主要受信用违约风险影响,相对于利率使而含信用债安处总体较为清涨、不同评级品种信做收益率曲线分化明显,AAA企业债下行幅度明显大于AA企业债

业员、本基金上半年债券部分进行了超当的调整。适当的加入杠杆,并采取了长久期策略。权益方面我们相信 长期投资优秀公司会给我们带来不销售收益。对于近期市场被动的加大,我们认为不必太过担心,公司未来 是否能够维持是需要我们非常保持支柱的。 4.42 报告期内基金的业绩表表。

44.2 报告期内基金的业绩表现 截至水报台期本本基金公基基金份额净值为1.1425元,本报告期基金份额净值增长率为-1.27%;截至本 报告期末本基金党基金份额净值为1.369元,本报告期基金份额净值增长率为-1.44%;同期业绩比较基准 收益率为-5.00%

收益率为-5.16%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 在中共贸易环实。经济数据不及预销等多重外部中市下、二季度市场流动性出现了缺叶式的改善。虽然 当前债市销格回题、但我们认为短期在乐观当中还近铁特警惕。一方面、流动性缓和的程度还取决于风险事 件的进一步演化、另一方面,是"更怪外"。古数特长可能出现战绩、市场将度为依赖处千王功操怀对流动性

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信请院,押引 本报告期内,本托管人在安信部价值,更配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中, 严格遵守(证券投资基金法)及其他有关法律法规,基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额

持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。 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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本 基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金

费用开支等方面进行了认真地复核。未发现本基金管理人存在损害基金价额持有人利益的行为。 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

会计主体:安信新价值灵活配置混合型证券投资基金 报告截止日:2018年6月30日

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	6,932,618.71	13,751,018.50
结算备付金	920,162.30	644,890.12
存出保证金	79,471.29	27,245.55
交易性金融资产	59,268,078.98	351,607,194.37
其中:股票投资	14,276,078.98	142,969,045.87
基金投资	_	-
债券投资	44,992,000.00	208,638,148.50
资产支持证券投资	_	-
贵金属投资	_	-
衍生金融资产	-	-
买人返售金融资产	13,000,000.00	-
应收证券清算款	-	4,485,906.83
应收利息	734,169.40	2,077,435.61
应收股利	-	-
应收申购款	3,510.57	13,405.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	80,938,011.25	372,607,096.29
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,000,000.00	
应付赎回款	45,422.72	30,162.30
应付管理人报酬	61,769.12	251,707.40
应付托管费	7,721.14	31,463.42
应付销售服务费	14,656.97	33,572.66
应付交易费用	37,201.74	30,799.80
应交税费	230.67	-
应付利息	_	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	_	
其他负债	188,437.29	260,000.00
负债合计	5,355,439.65	637,705.58
所有者权益:		·
实收基金	66,460,363.52	308,449,349.87
未分配利润	9,122,208.08	63,520,040.84
所有者权益合计	75,582,571.60	371,969,390.71
负债和所有者权益总计	80,938,011.25	372,607,096.29
6.2 利润表		, ,

会计主体:安信新价值灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

一、收入	781,010.01	33,377,242.28
1.利息收入	2,543,819.92	7,228,513.81
其中:存飲利息收入	119,158.63	121,773.39
债券利息收入	2,338,611.02	7,039,262.97
资产支持证券利息收入		-
买人返售金融资产收入	86,050.27	67,477.45
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)	27,948,310.85	2,328,014.30
其中:股票投资收益	35,031,472.80	4,772,277.75
基金投资收益		-
债券投资收益	-7,225,954.94	-4,501,571.57
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	142,792.99	2,057,308.12
3.公允价值变动收益(损失以 "-" 号填列)	-29,752,879.19	23,790,086.48
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	41,758.43	30,627.69
减:二、费用	1,588,053.66	3,190,501.57
1. 管理人报酬	819,055.95	1,843,062.93
2. 托管费	102,381.98	230,382.89
3. 销售服务费	139,160.55	257,176.47
4. 交易费用	307,750.96	91,668.98
5. 利息支出	6,854.26	591,091.81
其中: 卖出回购金融资产支出	6,854.26	591,091.81
6. 税金及附加	5,812.67	-
7. 其他费用	207,037.29	177,118.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-807,043.65	30,186,740.71
减:所得税费用		-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:安信新价值灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

、本期基金份额交易产生的基金净值 物 -49,517,044 -291,506,031, 1、本期向基金份额持有人分配利润产 1基金净值变动(净值减少以"-"号 -4,073,744. -4,073,744 9、本期向基金份额持有人分配利润产 9基金净值变动(净值减少以"-"号

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署

6.4.1 基金基本情况 安信新价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")终中国证券监督管理委员会(以下简 正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暇《中华人早共和国证券投资基金法》 和《安信新价值灵活配置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

首次发售募集期内产生的利息人民币0元,折合0份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币887.89 39.52元,折合887,899,239.52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、基金托管人为宁波银行股份有限公司 机内对定门基金管理有限提任公司,基金任告人为了宏顺行废约有限公司。 本基金投资范围为具有银好资产的金融工具。据国国内统法发行和上市交易的国债、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、资产支持证券、银行存 款、债券回购、其他货币市起工具等限定收益发品种、股票(包括中小板、创业板及其他您中国证监会核准上 市的票票),权证等权益类品种。股档期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须 符合中国证监会的相关规定)。

好容中国地區試的排水域定。 基金的於費組合的對本基金較票投資占基金资产的比例为0%-96%,持有全部权证的市值不超过 基金资产净值的3%。每个交易日日核在印刷股制辦按和国债辦股合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持 不能于基金资产净值5%的现金或者到第日在一年以内的政府债券。 本基金的实施比较基础为:50%中深5000 指数效益率450%中提总指数(全价)收益率。

6.42 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 糠板第3号

年度报告和半年度报告 > 》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 太财务报表以太基金持续经营为基础列报 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2018年6月30日的财务状况以及

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

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。

根期財政部、国家税务总局財稅 [2016]36 号文 《关于金面推开营业构及增值税试点的通知》、财税 [2016]46 号文 《关于进一步明确企画班开密放增点(金融地有关政策的通知)。规模2016]70号文 《关于破影机内的证在来等增值税政策的补充通知)。规模2016]140 号文 《关于明念金融,房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知)。规模(2017)36 号文 《关于根人周定资产进项税额抵闭等增值税政策的通知 的规定及战他相关决据。资产是从周定资产进项税额抵闭等增值税政策的通知的规定及战他相关决据。资产是成立党租中发生的增值规则积行为,该项产品管理从为增值的规模人。自 2018年 1 月 1 日起,资管产品管理人支持。按管产品管理人发生的增值税或税行为,该项用商品标价方法,按图 3%的证收 来缴纳金额积。从转管产品产业以租 1 月 1 日本 1 语言或引用的最小规分,未够管产品产业,未够的证收

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,未缴纳增值移的, 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。

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 机构作的基金速度的现实的效应。让9%人,他另外的总数体的现象人,由上市公司,很对众们还以定面解机构作的基金速度是1.12机 债务的自己级蓄蓄制度的计划。所有1.13和 1.13和 1.13和

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。 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

注:1、本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理(深圳 之,以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

本基金本报告期内及上年度无通过关联方交易单元进行的权证交易。 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金

項目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月3 日
当期发生的基金应支付的管理费	819,055.95	1,843,0629
其中:支付销售机构的客户维护费	93.948.49	22.3685

H 为每日应支付的基金管理表

6.4.8.2.2 基金托管费

			单位:人			
The same half also many the same half and a half many half	2018	本期 年1月1日 至 2018年6月30日				
获得销售服务费的各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	安信新价值混合A	安信新价值混合C	合计			
宁波银行	-	0.50	0.50			
安信基金	-	122,053.57	122,053.57			
安信证券	-	14,937.74	14,937.74			
合计	-	136,991.81	136,991.81			
25 (明 66 da 182 da 48 da 42 14 14 12 12	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日					
获得销售服务费的各关联方 名称	当期发	生的基金应支付的销售服务费	ł			
	安信新价值混合A	安信新价值混合C	合计			
宁波银行	-	1.32	1.32			
安信基金	-	239,935.03	239,935.03			

注: 本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基 0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷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 C 类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。

6.048.3 与关联疗进行银行间的证据的使用含的的交易 水基金水提告期处上年度订出的根本写实联方进行银行间间业市场债券(含图购)交易。 6.8.8 今关联方规计量的最大量等。 6.8.8 今关联方规计基金管理人运用器有资金投资本基金的情况

本报告期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 6.4.8.4.2 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本期末及上年度末未持有本基金份额。 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2018年1月1日 至 2018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		
宁波银行	6,932,618.71	115,413.07	13,073,000.89	90,537.20		

6.4.8.6 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

6.4.8.7 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无其他关联交易事项

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券 6401 居认购新发/增发证券而于期末线有的资通器阻证券

								金雀	真单位	江:人民市	170
1 受限证	E券类別:股票										
证券 名称	成功 认购日	可统通日	流受类	认购 价格	期 抗 単 位 价	数量 (単位: 股)	期末 成本总額	期末估值总 额	备注		
科力尔	2017年8年 10日	2018年8月 17日	新股 锁定	17.5 6	29.9 0	11, 000.00	193,160.00	328,900.00	-	6400	벩
英可 瑞	2017年10 月23日	2018年11 月1日	新股領定	22.3 8	39.0 7	12, 614.00	282,35232	492,828.98	-	6.4.9.2	糾
	证券 名称 科力 尔 英可	科力 尔 2017年8年 10日 英可 2017年10	证券 成功 可流通日 名称 认购日 可流通日 科力 2017年8年 2018年8月 尔 10日 17日 英可 2017年10 2018年11	证券 名称 成功 认购日 可進通日 受限 更型 高速 受限 更型 科力 タ 2017年8年 10日 2018年8月 17日 新股 17日 本可 2017年10 2018年11 新股	正弁 成功 可流通日 流通 以助 公報 以助 の流通日 元通 以助 が格 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大	正弁 成功 可能器目 発達 以略 関末 関末 関末 対略 対略 対略 対略 対略 対略 対略 対	成功 可能理日 流通 以前 原末 数量 数量 数量 数量 数量 数量 数量 数	近歩 成功	1. 登積证券與別:投票 (以前	.1 受阻证券类别: 股票	近方 成功 可能測目 高調 大阪 大阪 大阪 大阪 大阪 大阪 大阪 大

末结有的新时候隐第溶涌受阻股票 本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。 6.492 期末债券下回购容易由作为抵押的债券

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。

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。 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

太甚全管理人坚持"风险管理创造价值"。"风险管理人人有害"。"会提风险需求忍"的理念。终风险管 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 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 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

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

性风险及货币场风险等相关风险。本基金的基金管钢人从事风险管理则主要目标最争取得相对风险控制在限 定的指距之内,越来基金全成场收益之间和得越性的平衡。 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、风险的严阻和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 量分析的角度过处,通过金融键模和按定风险量化特计增,在日常工作中实計地对各种最化风险进行假 踪。他查和测衡,并被近相应边策将风险控制在可承受的范围内。 6.4.10.2 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。 本基金管理人提出了严格的服务各选油制度14枚速程制度1月以降,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 截止2018年6月30日,本基金持有的除国债、央行票期和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比

16.55%。(2017年12月31日:51.94%。) 6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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。

6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.10.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	18,156,388.15
AAA以下	-	200,558,407.24
未评级	20,430,334.24	_
合计	20,430,334.24	218,714,795.39

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.债券投资以全价列示

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 5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。

6.4.10.3.1 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《公开嘉集证券投资基金运作管理办法》及《公开嘉集开放式证券投资

本基金的基金管理人一階校照(公开募集证券投资基金运产管理处法)及(公开募集开放式证券投资基金流对性风险管理规定)等有关法规的要求建立健全开放式基金流对性风险管理的内部控制体系,申解评估条资资产的流动性、特对性制定流动性风险管理阻衡。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均仓集中度指标。逆回的交易的参照日与安慰关于的集中度,流动性受限资产比例、基金组合资产均个工作日可变现资产的可变现价。但以及上加制试等方式的流域中区、非开开放日对本是的申购施间所设进行监控、保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相形配。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。约定在非常特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。有效保险基金持有人利益。 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),

其余時度及时变現。此外,本基金可避攻數但即金融被产方式借入短期增金应对途元等。 不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附近6.412.3中则示的变出回购金融被产款余额(如有)将在1个 月內到期且计息外,本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约的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 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

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

2018年半年度报告摘要

					单位:人
本期末 2018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	6,932,618.71	_	-	-	6,932,618.71
结算备付金	920,16230	_	-	_	920,162.30
存出保证金	79,471.29	_	-	_	79,471.29
交易性金融资	35,050,000.00	_	9,942,000.00	14,276,078.98	59,268,078.98
买人返售金融 资产	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应收利息	_	_	-	734,169.40	734,169.40
应收股利	_	_	_	_	_
应收申购款	_	_	_	3,510.57	3,510.57
应收证券清算 数	-	-	-	-	-
其他资产	_	_	_	_	_
资产总计	55,982,252.30	_	9,942,000.00	15,013,758.95	80,938,011.25
负债	,,		.,,	,,	,,
应付赎回款				45,422.72	45,422.72
应付管理人报 酬	-	_	-	61,769.12	61,769.12
应付托管费	_	_	_	7,721.14	7,721.14
应付证券清算 飲	-	_	_	5,000,000.00	5,000,000.00
い 卖出回购金融 资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	14,656.97	14,656.97
应付交易费用	_	_	_	37,201.74	37,201.74
应付利息			_		
立行利息			_	230.67	230,67
立付利润			_		aa10,017
は他の借			_	188,437.29	188.437.29
负债总计	_		_	5,355,439.65	5,355,439.65
贝伽尼IT 利率敏感度缺 口	55,982,252.30		9,942,000.00	9,658,319.30	75,582,571.60
上年度末 2017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	13,751,01850	_	_	-	13,751,018.50
· · · · · · · · · ·	644.890.12		_	_	644,890.12
存出保证金	27,245.55		_	_	27,245.55
交易性金融资 cc	44,688,793.50	163,949,355.00	-	142,969,045.87	351,607,194.37
买人返售金融 资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,077,435.61	2,077,435.61
应收股利	-	_	-	_	-
沙收申购款	_	_	_	13,405.31	13,405.31
应收证券清算 款	-	-	-	4,485,906.83	4,485,906.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,111,947.67	163,949,355.00	-	149,545,793.62	372,607,096.29
负债					
立付赎回款	_	-	-	30,162.30	30,162.30
应付管理人报 制	-	-	-	251,707.40	251,707.40
应付托管费	-	_	-	31,463.42	31,463.42
立付证券清算 次	-	-	-	-	-
た 安出回购金融 资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	33,572.66	33,572.66
应付交易费用	-	-	-	30,799.80	30,799.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	_
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	260,000.00	260,000.00
负债总计	-	-	-	637,705.58	637,705.58
利率敏感度缺	59,111,947.67	163 040 3EF-00			
	50,111,947.67	163,949,355.00	_	148,908,088.04	371,969,390.71

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以

上年度末(201

6.4.10.4.2 外汇风险

资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。 6.4.10.4.3 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。

有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,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, 本基金保持不低于基金资产净值6%的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 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。

		本期末 2018年6月30日						
项目	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	14,276,078.98	18.89	142,969,045.87	38.44				
交易性金融资产 – 基金投资	-	-	-					
交易性金融资产 – 债券投资	-	-	-	-				
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	14,276,078.98	18.89	142,969,045.87	38.44				

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 (2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)		
分析	1、沪深300指数上升5%	752,046.59	7,011,67234		
23.61	2、沪深300指数下降5%	-752,046.59	-7,011,67234		

§ 7 投资组合报告

64.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
C	制造业	11,388,478.98	15.07
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	-	_
Н	住宿和餐饮业	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,057,600.00	1.40
K	房地产业	1,830,000.00	2.42
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	-	
0	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	14,276,078.98	18.89

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元 股票名称 数量(股) 公允价值(元)

序号 股票代码 股票名称 本期累计买人金额

1	600352	浙江龙盛	4,436,322.00	1.19
2	600566	济川药业	3,715,020.00	1.00
3	601012	隆基股份	3,310,203.00	0.89
4	601088	中国神华	3,036,600.00	0.82
Б	600612	老风祥	2,792,702.00	0.75
6	600703	三安光电	2,656,077.00	0.71
7	601288	农业银行	2,265,000.00	0.6
8	601799	星宇股份	1,464,215.00	0.39
9	601111	中国国航	1,265,000.00	0.34
10	000651	格力电器	924,000.00	0.25
11	601166	兴业银行	869,000.00	0.23
12	300296	利亚德	764,002.00	0.21
13	600741	华域汽车	738,000.00	0.20
14	603589	口子容	715,100.00	0.19
15	600048	保利地产	660,000.00	0.18
16	002081	金螳螂	621,000.00	0.17
17	600201	生物股份	598,000.00	0.16
18	000910	大亚圣象	581,852.00	0.16
19	600436	片仔癀	517,900.00	0.14
20	603365	水星家纺	468,600.00	0.13

F:本项的"累计买人金额"按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

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	000858	五粮液	11,184,256.00	3.01
2	000651	格力电器	9,887,624.39	2.66
3	601398	工商银行	9,686,000.00	2.60
4	000488	晨鸣纸业	9,163,133.00	2.46
5	002202	金风科技	8,694,946.14	2.34
6	600887	伊利股份	7,267,206.00	1.95
7	601318	中国平安	6,618,113.00	1.78
8	600104	上汽集团	6,016,290.00	1.62
9	600048	保利地产	5,892,000.00	1.58
10	600519	贵州茅台	5,465,500.00	1.47
11	601006	大秦铁路	5,313,614.00	1.43
12	002507	治陵棹菜	4,359,795.80	1.17
13	601857	中国石油	4,270,700.00	1.15
14	000568	泸州老客	4,196,820.00	1.13
15	002508	老板电器	3,909,611.10	1.05
16	000725	京东方A	3,432,000.00	0.92
17	002003	伟星股份	3,331,623.04	0.90
18	601012	隆基股份	3,083,674.00	0.83
19	000001	平安银行	2,965,000.00	0.80
20	600352	浙江龙盛	2,938,000.00	0.79

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

ter i primiralisti calcula i Maler	单位: 人民
买人股票成本(成交)总额	33,942,879.81
卖出股票收入(成交)总额	159,023,150.84

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持 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 本基金本报告期末去持有权证。

710 报告期末本其全投资的股损期货容易情况说明

15. 后宫族原则政府的组成的强烈,与确定评印规队对评的规度对产业行产价也此、超过少失成至头套的球组等跟选行股份部股投资,实现基金产增值保值。 7-11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 7-111 本期部使附近投政策 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

3。 7.112 极告期末本基金投密的国德朗货持仓和脱越明细 本基金本报告期末未持有国德朋货合约。 7.113 本期国德朗货投资评的 本基金油末在基金合同中明确国领期货的投资策略,比例限制、信息被紧等,本基金暂不参与国确期货

7.12 投资组合报告附注

7.12 校成成正保在9962.
7.12. 校成成正保在9962.
7.12. 校成成正保在9962.
7.12. 校成成正保在9962.
7.12. 校園在9662.
7.12. 校園在

局的下方提处到。 招商银行股份有限公司于2016年2月12日经营中国银营合行股处制办定书、销售司机率(2018 1号) 因内控管理严重违反申慎经继规则,进规批量收让以个人为借款主体的不良贷款,销售同业非保本理财产品 附违规保存保本等于保项组进行方,被订成成功万万元,没收益指价和2024万元,现在当1年07.2024万元。 基金管理人上上还身份投资投资银度和评价合份以该建设等成务成分的现在分享。

7.12.2 本基金校瓷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胚

单位:人		
金额	名称	序号
79,471.29	存出保证金	1
-	应收证券清算款	2
-	应收股利	3
734,169.40	应收利息	4
3,610.67	应收申购款	5
_	其他应收款	6
_	待摊费用	7
_	其他	8
917 151 36	△H-	0

§ 8 基 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

与持有的 份额 持有份额 持有份额

82 期末基金管理人的

金合同生效日 再投。 § 10 重大事件揭示

0.2 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 本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事 3 涉及甚会管理人 甚会财产 甚会托管业务的证法

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 6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等

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

E: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 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指 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

	券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	白門期間券 回购 成交总额的 比例	iti 成交总额 的比例 7% — 3% —	正 证 成交总额 的比例
	申万宏源	84,514,133.70	77.64%	136,000,000.00	39.27%	-	-
	中泰证券	24,338,000.00	22.36%	210,362,000.00	60.73%	-	-
1	1.1 报告期	内单一投资者持		投资者决策的其他 北例达到或超过20			
	Art vár	拍	告期内持有基	金份额变化情况		报告期末持	有基金情况

期初 份額

	-3	20100101-20100302	135,015,700.46	_	130,010,700.40	_	_	
个人	-	-	-	-	-	-	-	
产品特有风险								
可能等(持根可)	致: 1)基金 1有基金 排化 排化 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	现单一投资者持有基金 在短时间内无法变现足 份额比例达到或超过基 金合同》的约定决定部分 《基金合同》的约定暂份 《基金合同》的约定暂份 《基金合同》的约定暂份 《基金合同》的约定暂份 《基金合同》的《自己》	够的资产予以应对, 金份额总额的20%的 延期赎回,如果连约 接受基金的赎回申 应付基金赎回的现。	可能会 约单一持 数2个开 请,对对 金需要,	:产生基金仓位调射 Q资者大额赎回引 的故曰以上(含本数 则余投资者的赎回。 则可能使基金资产	各困难,导致流动的 发巨额赎回,基金 ()发生巨额赎回, 办理造成影响; ()净值受到不利影响	生风险; 管理人 基金管	

3)因悬金净值精度订單问题,或因除问要收入则悬金资产,等或悬金净值出现款大成功; 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)大额联回导致基金资产规模过小,不能满足存线的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止

安信基金管理有限责任公司