

金信价值精选灵活配置混合型发起式证券  
投资基金  
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：金信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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的情况.....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>58</b>
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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	金信价值精选混合	
基金主代码	005117	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 1 日	
基金管理人	金信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,330,060.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	005117	005118
报告期末下属分级基金的份额总额	11,697,240.49 份	5,632,819.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用价值投资策略对市场进行投资，在控制组合净值波动率的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下九个方面：</p> <p>1、大类资产配置策略 在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段，并将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略 本基金将从定性和定量两方面入手，选取有良好增值潜力的上市公司股票构建股票投资组合。</p> <p>3、债券投资策略 本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。</p> <p>4、可转换债券及可交换债券投资策略 本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资。</p> <p>5、资产支持证券等品种投资策略 本基金将深入分析市场利率等基本面因素，并辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值，以合理价格买入并持有。</p> <p>6、权证投资策略： 本基金以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，追求基金资产稳定的当期收益。</p> <p>7、中小企业私募债券投资策略 本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行</p>

	分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。 8、国债期货投资策略 基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、流动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，力求实现基金资产的长期稳定增值。 9、股指期货投资策略 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
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低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益、中高风险特征的基金。

### 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		金信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	殷克胜	陆志俊
	联系电话	0755-82510502	95559
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-900-8336	95559
传真		0755-82510305	021-62701216
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		518038	200336
法定代表人		殷克胜	任德奇

### 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	<a href="http://www.jxfunds.com.cn">http://www.jxfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金信基金管理有限公司	深圳市福田区益田路6001号太平金

		融大厦 1502 室
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 星展银行大厦 6 楼



### § 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

基金级别	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
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)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	2,207,581.17	1,133,547.43
本期利润	3,186,137.38	1,694,517.91
加权平均基金份额本期利润	0.2708	0.2718
本期加权平均净值利润率	29.82%	29.75%
本期基金份额净值增长率	35.21%	35.13%
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	-803,693.11	-333,748.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0687	-0.0593
期末基金资产净值	12,275,802.40	5,969,895.57
期末基金份额净值	1.0495	1.0598
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	4.95%	5.98%

注：1. 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。

2. 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(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

金信价值精选混合 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	6.70%	1.04%	3.47%	0.44%	3.23%	0.60%
过去三个月	24.82%	1.27%	6.35%	0.45%	18.47%	0.82%
过去六个月	35.21%	1.88%	1.98%	0.74%	33.23%	1.14%
过去一年	50.29%	1.63%	6.92%	0.60%	43.37%	1.03%
自基金合同	4.95%	1.65%	12.35%	0.63%	-7.40%	1.02%

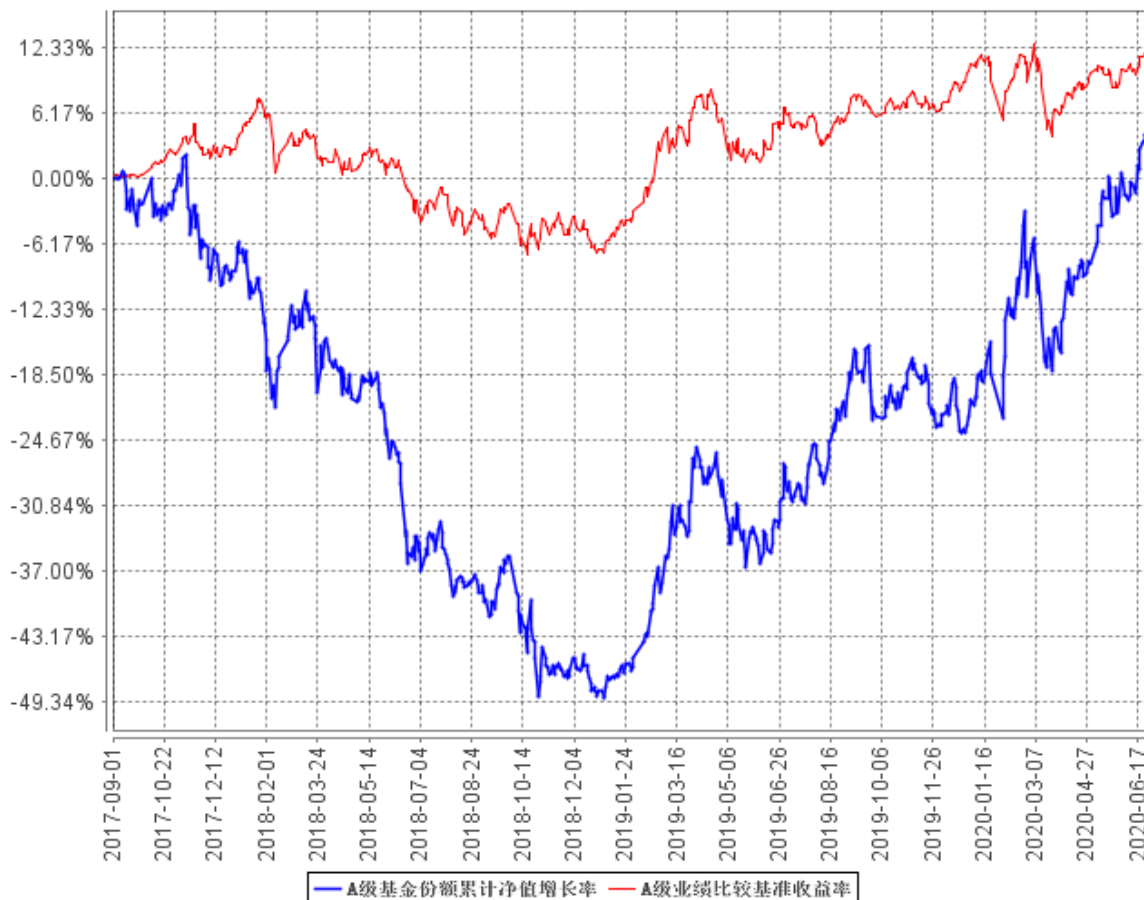
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

金信价值精选混合 C

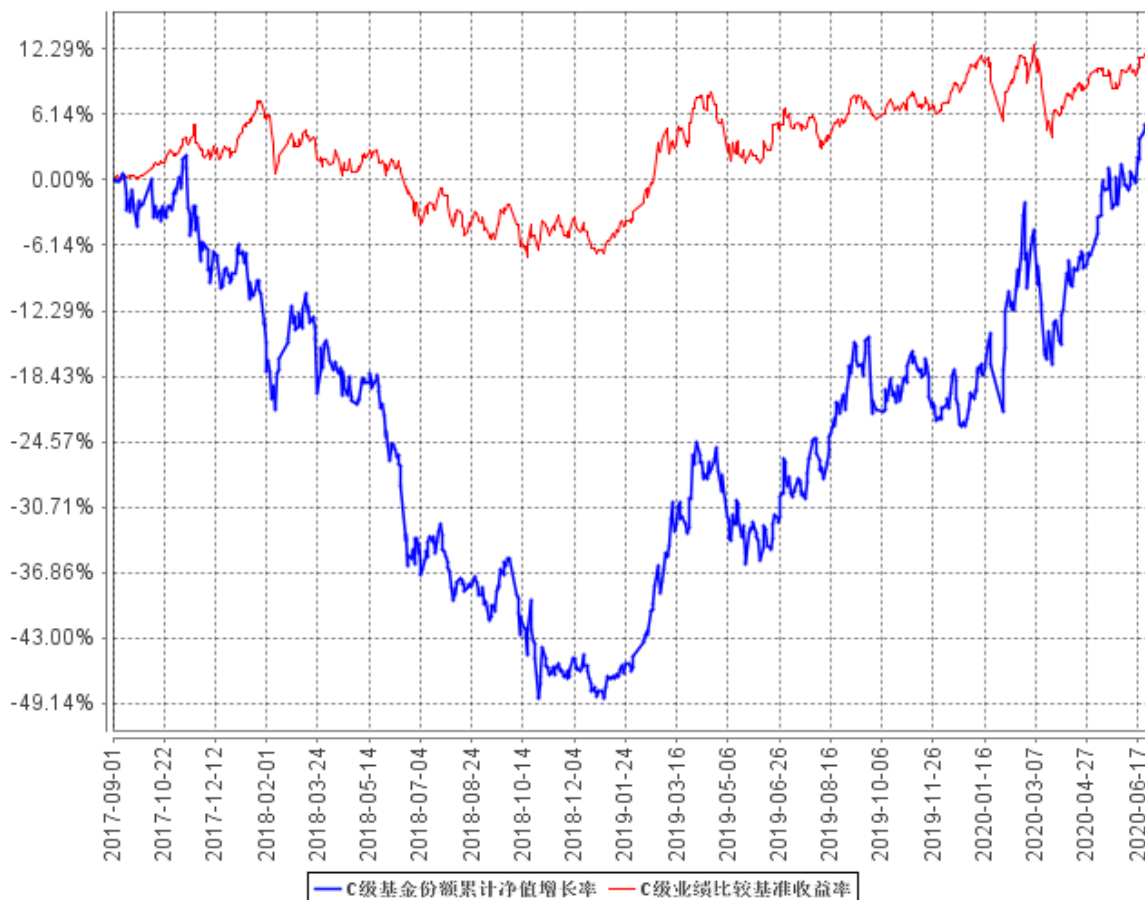
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.68%	1.05%	3.47%	0.44%	3.21%	0.61%
过去三个月	24.79%	1.27%	6.35%	0.45%	18.44%	0.82%
过去六个月	35.13%	1.88%	1.98%	0.74%	33.15%	1.14%
过去一年	50.33%	1.63%	6.92%	0.60%	43.41%	1.03%
自基金合同生效起至今	5.98%	1.65%	12.35%	0.63%	-6.37%	1.02%

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

A级基金份额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



C级基金份额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



## § 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

金信基金管理有限公司成立于 2015 年 7 月，注册资本 1 亿元人民币，注册地位于深圳前海，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳卓越创业投资有限责任公司及安徽国元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司管理资产规模超过 34.61 亿元，旗下管理 15 只开放式基金和 4 只资产管理计划。

#### 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		
吴清宇	本基金基金经理	2018 年 12 月 28 日	-	9	男，北京大学经济学硕士。先后任职于融通基金管理有限公司、德邦证券股份有限公司、中国人保资产管理有限公司。现任金信基金管理有限公司基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 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 A 股市场指数呈现先跌后涨的震荡走势，上证指数下跌-2.14%，沪深 300 指数上涨 1.65%，二季度以来，在国内外新冠疫情逐步得到控制的大背景下，国内 A 股整体市场逐步恢复。在这一过程中，以医药、教育、半导体、消费电子、新能源车等为代表的板块轮番表现。我们按照行业景气与 GARP 的投资框架，选择了上述较为景气的板块中的龙头个股进行了配置，取得了较好的绝对以及相对收益。未来本基金仍将重点关注估值合理、业绩稳定增长的公司的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末金信价值精选混合 A 基金份额净值为 1.0495 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.21%；截至本报告期末金信价值精选混合 C 基金份额净值为 1.0598 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.13%；同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，新冠病毒肆虐国内外，给国内外人们的生产、生活都造成了巨大的影响。海内外资本市场波动巨大。但从长期而言，此次疫情终将过去。同时，为了应对这一疫情对经济的冲击，各个国家都充分的释放了流动性，这对于各个资本市场都形成了一定支撑。我们认为，在这一过程中，拥有中长期产业逻辑的行业都有望迎来发展。未来，我们仍将按照行业景气与 GARP 的投资框架，发掘并选择景气行业中龙头个股进行配置。同时，未来本基金将持续密切关注市场的环境变化，通过积极主动的投资策略，把握市场机会并规避市场风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，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要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人由总经理、督察长、运作保障部、基金投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他相关人员，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金无利润分配事项。

## § 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

2020 年上半年度，基金托管人在金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2020 年上半年度，金信基金管理有限公司在金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2020 年上半年度，由金信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,364,592.03	580,108.54
结算备付金		456,734.81	651,626.36
存出保证金		29,443.94	38,045.31
交易性金融资产	6.4.7.2	18,180,098.94	15,283,654.21
其中：股票投资		17,214,328.94	14,433,144.21
基金投资		-	-
债券投资		965,770.00	850,510.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,326,852.63
应收利息	6.4.7.5	25,065.57	18,987.75
应收股利		-	-
应收申购款		122,567.07	229,622.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,178,502.36	18,128,897.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		700,000.00	-
应付证券清算款		534,903.45	-
应付赎回款		601,874.34	196,802.09
应付管理人报酬		15,318.84	14,461.61
应付托管费		2,297.83	2,169.25
应付销售服务费		545.53	638.02
应付交易费用	6.4.7.7	62,782.32	87,755.31
应交税费		-	-



应付利息		143.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,938.62	30,049.14
负债合计		1,932,804.39	331,875.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	17,330,060.10	22,821,445.19
未分配利润	6.4.7.10	915,637.87	-5,024,423.34
所有者权益合计		18,245,697.97	17,797,021.85
负债和所有者权益总计		20,178,502.36	18,128,897.27

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 17,330,060.10 份。金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 A 类份额 11,697,240.49 份，基金份额净值 1.0495 元；金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 C 类份额 5,632,819.61 份，基金份额净值 1.0598 元。

## 6.2 利润表

会计主体：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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 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
<b>一、收入</b>		5,226,280.16	2,378,567.84
1.利息收入		25,150.46	30,392.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,091.53	3,379.46
债券利息收入		14,827.55	8,396.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,231.38	18,616.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,593,117.57	1,409,904.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,531,472.01	1,310,016.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,588.62	-1,635.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	30,019.42
股利收益	6.4.7.16	49,056.94	71,504.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,539,526.69	868,026.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	68,485.44	70,243.85
<b>减：二、费用</b>		345,624.87	292,978.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	81,440.49	58,069.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,216.13	8,710.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,838.63	2,160.78
4. 交易费用	6.4.7.19	227,381.79	202,243.42
5. 利息支出		5,702.40	1,001.33
其中：卖出回购金融资产支出		5,702.40	1,001.33
6. 税金及附加		0.08	108.07
7. 其他费用	6.4.7.20	16,045.35	20,685.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,880,655.29	2,085,589.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,880,655.29	2,085,589.02

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	22,821,445.19	-5,024,423.34	17,797,021.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,880,655.29	4,880,655.29
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）	-5,491,385.09	1,059,405.92	-4,431,979.17
其中：1.基金申购款	18,408,634.59	-1,456,680.45	16,951,954.14
2.基金赎回款	-23,900,019.68	2,516,086.37	-21,383,933.31
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）	17,330,060.10	915,637.87	18,245,697.97
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）	12,209,175.51	-5,895,479.76	6,313,695.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,085,589.02	2,085,589.02
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）	7,485,876.11	-2,081,234.41	5,404,641.70
其中：1.基金申购款	30,825,739.27	-9,507,056.15	21,318,683.12
2.基金赎回款	-23,339,863.16	7,425,821.74	-15,914,041.42
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）	19,695,051.62	-5,891,125.15	13,803,926.47

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：

<u>          殷克胜          </u>	<u>          殷克胜          </u>	<u>          陈瑾          </u>
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

金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(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”)证监许可[2017]1407号《关于准予金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由金信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信价值精选灵活配置混合型发起式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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,101,069.24 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 767 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,101,332.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 262.92 份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,279.89 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信价值精选灵活配置混合型发起式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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券或票据)、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、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。本基金股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；本基金每个交易日日终，在扣除股指期货和国债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的投资比例不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度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 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基金净值变动情况等有关信息。

### 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

本基金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 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

本基金在本报告期间无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 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	1,364,592.03
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：	1,364,592.03

### 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	15,743,005.18	17,214,328.94	1,471,323.76	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	971,388.00	965,770.00	-5,618.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	971,388.00	965,770.00	-5,618.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	16,714,393.18	18,180,098.94	1,465,705.76
----	---------------	---------------	--------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	39.17
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	70.10
应收债券利息	24,943.10
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	13.20
合计	25,065.57

注：“其他”为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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	62,782.32

银行间市场应付交易费用	-
合计	62,782.32

#### 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	20.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,918.54
合计	14,938.62

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

金信价值精选混合 A		
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	12,531,527.15	12,531,527.15
本期申购	6,783,079.17	6,783,079.17
本期赎回(以“-”号填列)	-7,617,365.83	-7,617,365.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,697,240.49	11,697,240.49

金额单位：人民币元

金信价值精选混合 C		
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	10,289,918.04	10,289,918.04
本期申购	11,625,555.42	11,625,555.42
本期赎回(以“-”号填列)	-16,282,653.85	-16,282,653.85
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-



本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,632,819.61	5,632,819.61

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

金信价值精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,267,451.77	462,732.81	-2,804,718.96
本期利润	2,207,581.17	978,556.21	3,186,137.38
本期基金份额交易产生的变动数	256,177.49	-59,034.00	197,143.49
其中：基金申购款	-981,189.75	429,118.52	-552,071.23
基金赎回款	1,237,367.24	-488,152.52	749,214.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-803,693.11	1,382,255.02	578,561.91

单位：人民币元

金信价值精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,600,777.45	381,073.07	-2,219,704.38
本期利润	1,133,547.43	560,970.48	1,694,517.91
本期基金份额交易产生的变动数	1,133,481.14	-271,218.71	862,262.43
其中：基金申购款	-1,615,955.21	711,345.99	-904,609.22
基金赎回款	2,749,436.35	-982,564.70	1,766,871.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-333,748.88	670,824.84	337,075.96

#### 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	892.46
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	1,918.97
其他	280.10
合计	3,091.53

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	88,160,022.27
减：卖出股票成本总额	84,628,550.26
买卖股票差价收入	3,531,472.01

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,588.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,588.62

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,091,975.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,056,843.00
减：应收利息总额	22,544.33
买卖债券差价收入	12,588.62

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益--赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益--申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

**6.4.7.16 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	49,056.94
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	49,056.94

## 6.4.7.17 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	1,539,526.69
——股票投资	1,544,959.69
——债券投资	-5,433.00
——资产支持证券投资	-
——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	1,539,526.69

## 6.4.7.18 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	68,485.44
合计	68,485.44

## 6.4.7.19 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	227,381.79
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	227,381.79

#### 6.4.7.20 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	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,126.81
合计	16,045.35

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金无分部报告。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 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
金信基金管理有限公司（“金信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
深圳市卓越创业投资有限责任公司	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	基金管理人的股东

注：上述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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

### 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	81,440.49	58,069.05
其中：支付销售机构的客户维护费	15,143.07	10,741.11

注：1、支付基金管理人金信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

#### 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	12,216.13	8,710.38

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

#### 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1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C	合计
金信基金	-	554.69	554.69
合计	-	554.69	554.69
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C	合计
金信基金	-	227.48	227.48
合计	-	227.48	227.48

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给金信基金，再由金信基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：  
日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 0.10% 当年天数。

#### 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均未通过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

无。

##### 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

无。

#### 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	
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 1 日）持有的基金份额	-	100,000.00
报告期初持有的基金份额	-	100,000.00
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	100,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.5770%

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 1 日）持有的基金份额	-	100,000.00
报告期初持有的基金份额	-	100,000.00
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	100,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.5077%

##### 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

##### 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
交通银行	1,364,592.03	892.46	424,529.78	1,125.46

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,093	3,683.41	3,683.41	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020年6月11日	2020年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	246	24,600.00	24,600.00	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金无因认购新发/期末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

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，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，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 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 700,000.00 元，于 2020 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通证券出借业务。

### 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与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险以及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建设全面风险管理体系，建立了以公司董事会风险控制与审计委员会为核心的、由投资决策委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。在公司管理层下设立投资决策委员会和监察稽核部对公司的风险进行预防和控制；投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的；监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。在业务部门层面，公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及

时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	200,060.00	850,510.00
合计	200,060.00	850,510.00

注：未评级债券为政策性金融债或国债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

##### 6.4.13.2.4 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	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	24,600.00	0.00
-	-	-

未评级	741,110.00	0.00
合计	765,710.00	0.00

注：未评级债券为政策性金融债或国债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

#### 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.16%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,364,592.03	-	-	-	-	-	1,364,592.03

结算备付金	456,734.81	-	-	-	-	-	456,734.81
存出保证金	29,443.94	-	-	-	-	-	29,443.94
交易性金融资产	-	741,110.00	224,660.00	-	-	-17,214,328.94	18,180,098.94
应收利息	-	-	-	-	-	25,065.57	25,065.57
应收申购款	-	-	-	-	-	122,567.07	122,567.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,850,770.78	741,110.00	224,660.00	-	-	-17,361,961.58	20,178,502.36
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	700,000.00	-	-	-	-	-	700,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	534,903.45	534,903.45
应付赎回款	-	-	-	-	-	601,874.34	601,874.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,318.84	15,318.84
应付托管费	-	-	-	-	-	2,297.83	2,297.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	545.53	545.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	62,782.32	62,782.32
应付利息	-	-	-	-	-	143.46	143.46
其他负债	-	-	-	-	-	14,938.62	14,938.62
负债总计	700,000.00	-	-	-	-	1,232,804.39	1,932,804.39
利率敏感度缺口	1,150,770.78	741,110.00	224,660.00	-	-	-16,129,157.19	18,245,697.97
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	580,108.54	-	-	-	-	-	580,108.54
结算备付金	651,626.36	-	-	-	-	-	651,626.36
存出保证金	38,045.31	-	-	-	-	-	38,045.31
交易性金融资产	850,510.00	-	-	-	-	-14,433,144.21	15,283,654.21
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,326,852.63	1,326,852.63
应收利息	-	-	-	-	-	18,987.75	18,987.75
应收申购款	-	-	-	-	-	229,622.47	229,622.47
资产总计	2,120,290.21	-	-	-	-	-16,008,607.06	18,128,897.27
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	196,802.09	196,802.09
应付管理人报	-	-	-	-	-	14,461.61	14,461.61

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	2,169.25	2,169.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	638.02	638.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	87,755.31	87,755.31
其他负债	-	-	-	-	-	30,049.14	30,049.14
负债总计	-	-	-	-	-	331,875.42	331,875.42
利率敏感度缺口	2,120,290.21	-	-	-	-	-15,676,731.64	17,797,021.85

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	854.02	101.28
2. 市场利率上升 25 个基点	-847.16	-101.26	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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范围 0-95%；债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具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(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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	17,214,328.94	94.35	14,433,144.21	81.10
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	965,770.00	5.29	850,510.00	4.78
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	18,180,098.94	99.64	15,283,654.21	85.88

#### 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%		1,021,071.46
2. 沪深 300 指数下降 5%		-1,021,071.46	-875,825.13

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险



#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 17,210,645.53 元，属于第二层次的余额为 969,453.41 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	17,214,328.94	85.31
	其中：股票	17,214,328.94	85.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	965,770.00	4.79
	其中：债券	965,770.00	4.79
	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	1,821,326.84	9.03
8	其他各项资产	177,076.58	0.88
9	合计	20,178,502.36	100.00

### 7.2 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	-	-
C	制造业	13,562,764.10	74.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	826,628.41	4.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,101,286.43	11.52

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	723,650.00	3.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,214,328.94	94.35

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	占基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	34,979	1,370,477.22	7.51
2	603259	药明康德	13,016	1,257,345.60	6.89
3	002216	三全食品	51,841	1,238,999.90	6.79
4	300450	先导智能	26,600	1,229,186.00	6.74
5	300433	蓝思科技	35,400	992,616.00	5.44
6	603019	中科曙光	25,284	970,905.60	5.32
7	000425	徐工机械	152,251	899,803.41	4.93
8	300676	华大基因	5,413	843,940.83	4.63
9	300188	美亚柏科	41,500	822,945.00	4.51
10	002241	歌尔股份	27,500	807,400.00	4.43
11	600436	片仔癀	4,700	800,175.00	4.39
12	600183	生益科技	27,200	796,144.00	4.36
13	300207	欣旺达	40,600	767,340.00	4.21
14	300073	当升科技	22,900	757,303.00	4.15
15	300244	迪安诊断	20,500	723,650.00	3.97
16	300035	中科电气	76,700	704,106.00	3.86
17	300806	斯迪克	12,804	612,671.40	3.36
18	603486	科沃斯	19,717	595,650.57	3.26
19	002866	传艺科技	33,600	546,000.00	2.99
20	002932	明德生物	3,100	198,121.00	1.09
21	300308	中际旭创	2,800	176,400.00	0.97
22	300438	鹏辉能源	5,700	99,465.00	0.55
23	300846	首都在线	1,093	3,683.41	0.02

## 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	300073	当升科技	2,669,528.91	15.00
2	300015	爱尔眼科	2,633,596.00	14.80
3	000425	徐工机械	2,386,629.00	13.41
4	300168	万达信息	2,379,464.27	13.37
5	603019	中科曙光	2,157,963.00	12.13
6	300122	智飞生物	2,105,730.00	11.83
7	000977	浪潮信息	1,924,268.00	10.81
8	002049	紫光国微	1,873,533.00	10.53
9	600763	通策医疗	1,817,102.00	10.21
10	002216	三全食品	1,751,572.54	9.84
11	603127	昭衍新药	1,738,019.00	9.77
12	300450	先导智能	1,682,028.00	9.45
13	603679	华体科技	1,651,094.00	9.28
14	603890	春秋电子	1,541,574.20	8.66
15	601318	中国平安	1,515,691.00	8.52
16	600584	长电科技	1,512,640.00	8.50
17	600867	通化东宝	1,508,671.00	8.48
18	002019	亿帆医药	1,470,172.00	8.26
19	002607	中公教育	1,447,958.00	8.14
20	300363	博腾股份	1,421,526.00	7.99
21	300676	华大基因	1,403,758.00	7.89
22	000100	TCL 科技	1,363,320.00	7.66
23	600183	生益科技	1,305,602.00	7.34
24	603259	药明康德	1,302,298.00	7.32
25	002959	小熊电器	1,266,660.00	7.12
26	002384	东山精密	1,263,214.00	7.10
27	000725	京东方 A	1,248,242.00	7.01
28	300294	博雅生物	1,247,854.00	7.01
29	300476	胜宏科技	1,114,709.00	6.26
30	300296	利亚德	1,109,112.00	6.23

31	300347	泰格医药	1,054,384.00	5.92
32	300078	思创医惠	1,027,125.00	5.77
33	000636	风华高科	962,293.00	5.41
34	300725	药石科技	952,859.28	5.35
35	002368	太极股份	933,329.00	5.24
36	300639	凯普生物	879,949.00	4.94
37	000661	长春高新	875,213.00	4.92
38	300188	美亚柏科	858,610.00	4.82
39	002481	双塔食品	856,157.00	4.81
40	603486	科沃斯	837,941.11	4.71
41	603612	索通发展	790,736.00	4.44
42	601231	环旭电子	764,912.18	4.30
43	603659	璞泰来	754,524.00	4.24
44	300806	斯迪克	738,655.00	4.15
45	601615	明阳智能	738,644.00	4.15
46	600436	片仔癀	729,293.00	4.10
47	300482	万孚生物	723,990.00	4.07
48	300207	欣旺达	723,031.00	4.06
49	002798	帝欧家居	722,068.00	4.06
50	300433	蓝思科技	713,961.00	4.01
51	300357	我武生物	709,561.00	3.99
52	000951	中国重汽	704,570.00	3.96
53	002918	蒙娜丽莎	693,854.00	3.90
54	000858	五粮液	691,370.00	3.88
55	002241	歌尔股份	685,384.00	3.85
56	600438	通威股份	667,662.00	3.75
57	300035	中科电气	653,703.00	3.67
58	300776	帝尔激光	647,530.00	3.64
59	002876	三利谱	647,105.00	3.64
60	601186	中国铁建	644,780.09	3.62
61	300244	迪安诊断	638,813.00	3.59
62	300182	捷成股份	633,871.00	3.56
63	002866	传艺科技	625,224.00	3.51
64	002897	意华股份	602,630.00	3.39
65	603185	上机数控	598,186.00	3.36
66	300010	豆神教育	576,899.00	3.24

67	600872	中炬高新	555,816.00	3.12
68	000401	冀东水泥	544,997.00	3.06
69	000063	中兴通讯	543,089.00	3.05
70	300308	中际旭创	512,758.00	2.88
71	002405	四维图新	511,350.00	2.87
72	300227	光韵达	504,578.00	2.84
73	688005	容百科技	502,607.81	2.82
74	002463	沪电股份	475,770.00	2.67
75	603208	江山欧派	466,424.00	2.62
76	603993	洛阳钼业	406,553.00	2.28
77	002185	华天科技	403,305.00	2.27
78	600276	恒瑞医药	401,877.00	2.26
79	300212	易华录	384,263.00	2.16
80	300759	康龙化成	377,315.00	2.12

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000425	徐工机械	3,139,184.10	17.64
2	300015	爱尔眼科	2,826,714.84	15.88
3	300168	万达信息	2,404,485.50	13.51
4	300122	智飞生物	2,196,905.01	12.34
5	300363	博腾股份	2,185,040.36	12.28
6	300073	当升科技	2,130,491.84	11.97
7	000725	京东方 A	2,054,195.57	11.54
8	600763	通策医疗	2,043,300.68	11.48
9	000977	浪潮信息	1,970,765.97	11.07
10	002049	紫光国微	1,887,841.73	10.61
11	603127	昭衍新药	1,850,475.61	10.40
12	603890	春秋电子	1,844,837.27	10.37
13	002607	中公教育	1,828,158.55	10.27
14	603679	华体科技	1,584,441.59	8.90
15	600867	通化东宝	1,569,122.08	8.82
16	000661	长春高新	1,562,720.12	8.78

17	002019	亿帆医药	1,544,993.58	8.68
18	600584	长电科技	1,534,149.95	8.62
19	600585	海螺水泥	1,512,287.40	8.50
20	000100	TCL 科技	1,450,521.82	8.15
21	300476	胜宏科技	1,446,104.87	8.13
22	601318	中国平安	1,444,877.00	8.12
23	002959	小熊电器	1,400,419.45	7.87
24	002123	梦网集团	1,390,327.66	7.81
25	002798	帝欧家居	1,331,280.00	7.48
26	603208	江山欧派	1,305,600.14	7.34
27	002216	三全食品	1,274,762.78	7.16
28	603019	中科曙光	1,214,096.10	6.82
29	000636	风华高科	1,198,220.13	6.73
30	300347	泰格医药	1,180,695.91	6.63
31	002384	东山精密	1,151,770.65	6.47
32	300294	博雅生物	1,126,530.68	6.33
33	300296	利亚德	1,108,655.61	6.23
34	002463	沪电股份	1,099,305.65	6.18
35	300602	飞荣达	1,082,765.78	6.08
36	300725	药石科技	1,080,367.18	6.07
37	300751	迈为股份	964,881.29	5.42
38	603659	璞泰来	945,936.87	5.32
39	002368	太极股份	921,769.99	5.18
40	300078	思创医惠	900,351.00	5.06
41	300639	凯普生物	891,696.60	5.01
42	601231	环旭电子	854,370.08	4.80
43	002481	双塔食品	838,779.47	4.71
44	601138	工业富联	817,434.29	4.59
45	002918	蒙娜丽莎	803,538.02	4.52
46	300482	万孚生物	796,970.89	4.48
47	000951	中国重汽	769,015.40	4.32
48	601615	明阳智能	746,026.63	4.19
49	300676	华大基因	740,470.65	4.16
50	000858	五粮液	705,599.24	3.96
51	300357	我武生物	705,228.24	3.96
52	000671	阳光城	682,248.00	3.83
53	603612	索通发展	657,283.58	3.69
54	600438	通威股份	646,270.78	3.63

55	601186	中国铁建	629,340.00	3.54
56	000063	中兴通讯	629,237.64	3.54
57	300776	帝尔激光	625,910.00	3.52
58	002876	三利谱	623,387.74	3.50
59	603185	上机数控	602,733.63	3.39
60	300182	捷成股份	592,416.98	3.33
61	002897	意华股份	586,011.75	3.29
62	600872	中炬高新	548,818.00	3.08
63	600340	华夏幸福	541,944.00	3.05
64	002832	比音勒芬	538,097.76	3.02
65	300010	豆神教育	534,263.21	3.00
66	002507	涪陵榨菜	530,243.00	2.98
67	000401	冀东水泥	515,864.00	2.90
68	600183	生益科技	505,567.00	2.84
69	300227	光韵达	465,636.06	2.62
70	688005	容百科技	456,938.70	2.57
71	002185	华天科技	452,133.19	2.54
72	603993	洛阳钼业	438,064.00	2.46
73	002405	四维图新	430,650.00	2.42
74	002596	海南瑞泽	406,334.97	2.28
75	600276	恒瑞医药	403,782.89	2.27
76	300759	康龙化成	377,412.00	2.12
77	300450	先导智能	357,101.00	2.01

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	85,864,775.30
卖出股票收入（成交）总额	88,160,022.27

### 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	941,170.00	5.16



	其中：政策性金融债	941,170.00	5.16
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）	24,600.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	965,770.00	5.29

## 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	018007	国开 1801	7,400	741,110.00	4.06
2	018013	国开 2004	2,000	200,060.00	1.10
3	128112	歌尔转 2	246	24,600.00	0.13

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

## 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投资。

## 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

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。

## 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 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投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 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	29,443.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,065.57
5	应收申购款	122,567.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	177,076.58

### 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的情况。

### **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
金信价值精选混合 A	1,058	11,055.99	0.00	0.00%	11,697,240.49	100.00%
金信价值精选混合 C	1,553	3,627.06	100,000.00	1.78%	5,532,819.61	98.22%
合计	2,611	6,637.33	100,000.00	0.58%	17,230,060.10	99.42%

注：1、分类基金机构及个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计。

### 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	金信价值精选混合 A	98,592.20	0.8429%
	金信价值精选混合 C	1,000,052.50	17.7540%
	合计	1,098,644.70	6.3395%

### 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的情况

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	金信价值精选混合 A	-
	金信价值精选混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	金信价值精选混合 A	-
	金信价值精选混合 C	-

	合计	-
--	----	---

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	100,000.00	0.58	100,000.00	0.58	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	1,000,052.50	5.77	1,000,052.50	5.77	自合同生效之日起不少于3年
基金经理等人员	5,000,000.00	28.85	5,000,000.00	28.85	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人股东	4,000,227.39	23.08	4,000,227.39	23.08	自合同生效之日起不少于3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,100,279.89	58.28	10,100,279.89	58.28	自合同生效之日起不少于3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金信价值精选混 合 A	金信价值精选混 合 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 1 日）基金份 额总额	9,000,259.20	1,101,072.96
本报告期期初基金份额总额	12,531,527.15	10,289,918.04
本报告期基金总申购份额	6,783,079.17	11,625,555.42
减：本报告期基金总赎回份额	7,617,365.83	16,282,653.85
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	11,697,240.49	5,632,819.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本基金管理人 2020 年 4 月 28 日公告，督察长段卓立先生因个人原因于 2020 年 4 月 27 日离任，由公司总经理殷克胜先生任代督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。

### 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
安信证券	2	173,827,594.16	99.90%	123,644.32	99.90%	-
太平洋证券	2	177,360.00	0.10%	126.17	0.10%	-

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，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市

场走向、个股分析报告和专门研究报告；

c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司投资、研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果征求有关部门意见，经公司领导审核后选择交易单元：

a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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
安信证券	2,157,389.70	100.00%	113,400,000.00	100.00%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

### 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	金信基金关于旗下基金增加东北证券为代销机构的公告	公司网站	2020年1月3日
2	金信基金关于旗下基金增加东方财富证券为代销机构的公告	公司网站	2020年1月10日
3	金信基金关于旗下基金增加平安证券为代销机构的公告	公司网站	2020年1月16日
4	金信基金管理有限公司旗下11只基金2019年第4季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020年1月21日
5	金信基金管理有限公司修改旗下金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	公司网站、中国证券报	2020年3月17日



	基金合同的公告		
6	金信基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 3 月 25 日
7	金信基金管理有限公司旗下 12 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 4 月 21 日
8	金信基金关于旗下部分基金增加玄元保险为代销机构的公告	公司网站	2020 年 4 月 28 日
9	金信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 4 月 28 日
10	金信基金关于旗下部分基金增加中信证券华南公司为代销机构的公告	公司网站	2020 年 4 月 30 日
11	金信基金管理有限公司关于变更客服热线的公告	公司网站	2020 年 5 月 14 日
12	金信基金关于旗下部分基金增加华瑞保险销售为代销机构的公告	公司网站	2020 年 5 月 18 日
13	金信基金关于旗下部分基金增加喜鹊基金为代销机构的公告	公司网站	2020 年 5 月 29 日
14	金信基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	公司网站	2020 年 6 月 10 日
15	金信基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	公司网站	2020 年 6 月 17 日

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20200101-20200630	5,000,000.00	0.00	0.00	5,000,000.00	28.85%
	2	20200115-20200630	4,000,227.39	0.00	0.00	4,000,227.39	23.08%
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1、大额赎回风险

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。

##### 2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

### 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、中国证监会准予金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

金信基金管理有限公司

地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室。

### 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.jxfunds.com.cn](http://www.jxfunds.com.cn)。

金信基金管理有限公司

2020 年 8 月 26 日