

信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期: 2021 年 08 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年03月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	其他指标	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	投资组合报告附注	49
§ 8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§ 9	开放式基金份额变动.....	52
§ 10	重大事件揭示.....	52
10.1	基金份额持有人大会决议.....	52
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4	基金投资策略的改变.....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8	其他重大事件.....	54
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§ 12	备查文件目录.....	55
12.1	备查文件目录.....	55
12.2	存放地点.....	55
12.3	查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	信达价值精选	
基金主代码	970021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年03月01日	
基金管理人	信达证券股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,197,753.21份	
基金合同存续期	本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过三年。	
下属分级基金的基金简称	信达价值精选A	信达价值精选B
下属分级基金的交易代码	970020	970021
报告期末下属分级基金的份额总额	10,863,681.21份	38,334,072.00份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”或“本基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争获得超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，风险收益水平

低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金。

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”或“本基金”。

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		信达证券股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	万颖	李申
	联系电话	010-63081089	021-60637102
	电子邮箱	wanying@cindasc.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95321	021-63637111
传真		010-63081344	021-60635778
注册地址		北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100031	100033
法定代表人		祝瑞敏	田国立

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.cindasc.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年03月01日(基金合同生效日)-2021年06月30日)	
	信达价值精选A	信达价值精选B
本期已实现收益	138,960.55	510,249.71
本期利润	112,344.26	391,946.44
加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0121
本期加权平均净值利润率	0.90%	1.08%
本期基金份额净值增长率	0.89%	0.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	1,367,582.39	4,825,950.54
期末可供分配基金份额利润	0.1259	0.1259
期末基金资产净值	12,231,263.60	43,160,022.54
期末基金份额净值	1.1259	1.1259
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.89%	0.93%

注：1、本集合计划分设两类基金份额：A类基金份额和B类基金份额。详情请参阅相关公告。

2、因本集合计划合同等法律文件于2021年03月01日生效，本报告期为2021年03月01日至2021年06月30日，详细信息请查阅相关公告。

3、上述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、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。

3.2 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

信达价值精选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	0.12%	0.20%	-0.96%	0.41%	1.08%	-0.21%
过去三个月	0.93%	0.14%	2.50%	0.49%	-1.57%	-0.35%
自基金合同生效起至今	0.89%	0.12%	0.15%	0.61%	0.74%	-0.49%

注：因本集合计划合同等法律文件于 2021 年 03 月 01 日生效，本集合计划 A 类份额报告期为 2021 年 03 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日，详细信息请查阅相关公告。

信达价值精选B

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	0.12%	0.20%	-0.96%	0.41%	1.08%	-0.21%
过去三个月	0.93%	0.14%	2.50%	0.49%	-1.57%	-0.35%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.12%	0.72%	0.58%	0.21%	-0.46%

注：本集合计划合同等法律文件于 2021 年 03 月 01 日生效，本集合计划 B 类份额实际起始日期为 2021 年 03 月 08 日，因此 B 类份额报告期为 2021 年 03 月 08 日至 2021 年 06 月 30 日，详细信息请查阅相关公告。

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：信达价值精选 B 类份额实际起始日期为 2021 年 3 月 8 日。

3.3 其他指标

本集合计划本报告期内无其他指标。

§ 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

信达证券股份有限公司（以下简称“信达证券”、“公司”或“管理人”）是于2007年9月成立的中国国内AMC系第一家证券公司，总部位于北京市西城区闹市口大街9号院1号楼，是一家经中国证券监督管理委员会批准，由中国信达资产管理公司（现名中国信达资产管理股份有限公司）作为主要发起人，联合中海信托投资有限责任公司（现名中海信托股份有限公司）和中国材料工业科工集团公司（现名中国中材集团有限公司），在承继中国信达资产管理股份有限公司投资银行业务和收购辽宁省证券公司、汉唐证券有限责任公司的证券类资产基础上成立的证券公司。

截至2021年06月30日，公司最新注册资本为2,918,700,000元。公司经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；代销金融产品；证券投资基金销售；证券公司为期货公司提供中间介绍业务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

信达证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，截至2021年06月30日，旗下已有2只大集合产品完成公募化改造，分别为“信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”、“信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划”。

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		
朱振坤	本基金的基金经理、基金经理	2021-03-01	-	9	朱振坤，清华大学经济管理学院毕业，管理学博士。9年证券从业经验，曾任职于国信证券、民生加银基金从事证券研究和投资工作，2015年7月加入信达证

					券资产管理部，目前担任部门权益投资经理。经历多个牛熊周期，有丰富的投资经验，坚持实践价值投资思想，对绝对收益有深刻理解。
薛宇	本基金的基金经理、基金经理。	2021-04-08	2021-06-22	7	薛宇，中国人民大学财政金融学院财政学硕士，中级经济师。7年从业经验，曾任中国邮政储蓄银行金融市场部副处长。2013年8月加入信达证券，历任固定收益部副总经理、资产管理事业部固收投资经理；擅长研究宏观经济金融形势、财政货币政策、市场供求关系，经历多个完整经济周期，能够较好把握市场的运行节奏。

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，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
朱振坤	公募基金	1	55,391,286.14	2021-03-01
	私募资产管理计划	1	5,149,625.98	2019-08-15
	其他组合	-	-	-
	合计	2	60,540,912.12	-

注：本部分所述的“公募基金”、“私募资产管理计划”为已经/拟按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，对标公募基金进行管理的证券公司存量大集合资产管理产品。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无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

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》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期内，管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在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成交量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

截至2021年6月30日，产品净值为1.1259元，本报告期内本集合计划A类份额净值增长率为0.89%，B类份额净值增长率为0.93%。自合同生效以来，本集合计划A类份额业绩比较基准上涨0.15%，B类份额业绩比较基准上涨0.72%，本集合计划净值增长小幅跑赢业绩比较基准。

本集合计划自2021年3月合同生效后，在2021年4月初开始运作，目前仍处于建仓期。运作初期，我们坚持了绝对收益的原则，谨慎出手，逐步积累安全垫，逐渐加仓，控制净值回撤。经过两年的上涨，A股股票价格整体处于比较高的水平，我们在股票投资方面比较谨慎。一方面，不断寻找业绩优秀、估值较低的股票开展投资；另一方面，在建仓期保持较低的股票仓位，灵活调整持仓，适当增加可转债和债券投资，控制净值回撤。

具体而言，在股票投资方面，本集合计划有得有失，整体上略有收益。2021年第二季度A股市场非常活跃，沪深300指数上涨3.48%，指数高位震荡，主题投资活跃，新能源、半导体、医美、次高端白酒等继续上涨，泡沫初现。另一方面，低估值的地产、银

行、家电等传统优质蓝筹持续下跌，部分股票已经出现了明显的投资价值。随着一些优质标的下跌，我们适当增加了投资仓位，当然短期也承受了一些损失。目前持仓股票均经过长期深入的研究，我们对今后获得良好投资回报很有信心。

在可转债方面，金融市场流动性较为宽裕，可转债指数平稳上涨。仅在2021年6月中旬中证转债指数出现了2%左右的调整，我们把握机会、果断增加了可转债仓位，并获得了一定的收益。根据Wind统计，截至2021年6月30日，可转债价格中位数为112.25元，平均的转股溢价率为17.73%，估值在历史上处于中间偏上水平。目前可转债投资策略主要有两方面：一是精选标的，在业绩高增长的个券和上市新券中寻找投资机会；二是控制可转债整体仓位，等待更具性价比的时机。

综上所述，我们仍将持续挖掘优质的投资标的，相信今天辛勤的研究努力，会逐渐转化为明天的投资业绩。

提示：本报告中的观点仅代表投资经理的判断，不构成业绩承诺或任何投资建议或实际的投资结果。管理人不保证当中的观点和预测不会发生任何调整或变更。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达价值精选A基金份额净值为1.1259元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.89%，同期业绩比较基准收益率为0.15%；截至报告期末信达价值精选B基金份额净值为1.1259元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.93%，同期业绩比较基准收益率为0.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年的货币环境较为宽松，利率呈现下行趋势，但信用环境偏紧。受低基数效应影响，名义GDP同比增速异常高企。财政不积极，政府有比较明确的控制地方隐性债务和稳房价诉求。

展望2021年下半年，货币政策预计将维持稳健，保持流动性合理充裕，随着PPI回落，社融增速的下行则逐步趋缓甚至企稳。严厉的地产调控政策，可能对经济增长产生一定的冲击。如果经济和就业面临压力时，政策空间较大且操作灵活。

对于权益市场而言，经过两年的上涨，A股股票整体演绎比较充分，目前难以判断后续的趋势。但我们不会把投资建立在对趋势的判断上，而是建立在对上市公司股权价值的审慎评估上。一方面，不断寻找业绩优秀、估值较低的股票开展投资；另一方面，灵活调整持仓，适当增加可转债投资，控制净值回撤。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 参与估值流程人员专业胜任能力和相关工作经历

估值团队成员共5人，全部来自运营管理部，具备丰富产品运营管理、估值核算工作经验，熟悉资管产品相关法律法规，具备良好的产品运营风险管理能力。

(2) 投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的与估值相关的任何定价服务。本集合计划所采用的估值流程及估值结果均已经过托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本集合计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、集合计划合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、集合计划合同、托管协议和其他有关规定，对本集合计划的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本集合计划的投资运作方面进行了监督，未发现本集合计划管理人有损害集合计划份额持有人利益的行为。

报告期内，本集合计划未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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、误导性陈述或重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	2,751,760.74
结算备付金		1,007,909.24
存出保证金		4,448.69
交易性金融资产	6.4.7.2	33,261,215.72
其中：股票投资		12,695,772.00
基金投资		-
债券投资		15,552,943.72
资产支持证券投资		5,012,500.00
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	18,000,380.00
应收证券清算款		496,790.47
应收利息	6.4.7.5	75,477.84
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		55,597,982.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日
负 债：		
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		27,193.86
应付托管费		4,532.30
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	109,664.20
应交税费		542.40
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	64,763.80
负债合计		206,696.56
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	49,197,753.21
未分配利润	6.4.7.10	6,193,532.93
所有者权益合计		55,391,286.14
负债和所有者权益总计		55,597,982.70

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额49,197,753.21份。其中，A类基金份额净值1.1259元，基金份额总额10,863,681.21份；B类基金份额净值1.1259元，基金份额总额38,334,072.00份。

6.2 利润表

会计主体：信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年03月01日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日

一、收入		733,370.10
1. 利息收入		212,732.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,285.52
债券利息收入		5,190.21
资产支持证券利息收入		31,782.13
买入返售金融资产收入		126,474.56
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		665,557.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	419,319.32
基金投资收益	6.4.7.13	-6,408.58
债券投资收益	7.4.7.6	170,495.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
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	82,151.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-144,919.56
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	-
减：二、费用		229,079.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	94,719.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,786.60
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	53,084.47
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		130.13
7. 其他费用	6.4.7.21	65,358.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		504,290.70

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		504,290.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06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）	11,586,637.17	1,340,960.14	12,927,597.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	504,290.70	504,290.70
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）	37,611,116.04	4,348,282.09	41,959,398.13
其中：1. 基金申购款	38,334,072.00	4,434,004.10	42,768,076.10
2. 基金赎回款	-722,955.96	-85,722.01	-808,677.97
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）	49,197,753.21	6,193,532.93	55,391,286.14

注：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：

万颖

张毅

俞仕龙

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

信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划由信达满堂红基金优选集合资产管理计划变更而来。信达满堂红基金优选集合资产管理计划管理人信达证券股份有限公司于2021年03月01日发布《关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告》。根据该公告，自2021年03月01日起，信达满堂红基金优选集合资产管理计划正式更名为信达证券价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划，《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》、《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件正式生效，原《信达满堂红基金优选集合资产管理计划资产管理合同》、《信达证券满堂红基金优选集合资产管理计划说明书》和《信达满堂红基金优选集合资产管理计划风险揭示书》等法律文件同时失效。本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中国境内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、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、股指期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，本集合计划管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本集合计划的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%。

本财务报表由本集合计划的管理人信达证券于2021年08月31日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协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

本集合计划2021年03月01日至2021年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本集合计划2021年06月30日的财务状况以及2021年03月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和集合计划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

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度,即每年01月01日起至12月31日止。本会计期间为2021年03月01日(本集合计划合同生效日)至2021年06月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金

融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者 (3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公

公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划

(1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且：

(2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

本集合计划的份额面值为人民币 1.00 元。实收基金为对外发行基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于申购确认日或赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 集合计划可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介和集合计划管理人网站公告。

6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本集合计划的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自2018年1月1日起施行。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。

(2) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息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	
	2021年06月30日	
活期存款	2,751,760.74	
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	2,751,760.74	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		12,870,733.32	12,695,772.00	-174,961.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	15,541,219.35	15,552,943.72	11,724.37
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,541,219.35	15,552,943.72	11,724.37
资产支持证券		5,000,000.00	5,012,500.00	12,500.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		33,411,952.67	33,261,215.72	-150,736.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	18,000,380.00	-
银行间市场	-	-
合计	18,000,380.00	-

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期内未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,250.43
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	453.50
应收债券利息	37,533.43
应收资产支持证券利息	32,735.56
应收买入返售证券利息	3,502.92
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	2.00
合计	75,477.84

6.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期内未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	109,664.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	109,664.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	64,763.80
合计	64,763.80

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 信达价值精选A

金额单位：人民币元

项目 (信达价值精选A)	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	11,586,637.17	11,586,637.17
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-722,955.96	-722,955.96
本期末	10,863,681.21	10,863,681.21

6.4.7.9.2 信达价值精选B

金额单位：人民币元

项目 (信达价值精选B)	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	38,334,072.00	38,334,072.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	38,334,072.00	38,334,072.00

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 信达价值精选A

单位：人民币元

项目 (信达价值精选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	4,125,059.89	-2,784,099.75	1,340,960.14
本期利润	138,960.55	-26,616.29	112,344.26
本期基金份额交易产生的变动数	-258,350.20	172,628.19	-85,722.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-258,350.20	172,628.19	-85,722.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,005,670.24	-2,638,087.85	1,367,582.39

6.4.7.10.2 信达价值精选B

单位：人民币元

项目 (信达价值精选B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	510,249.71	-118,303.27	391,946.44
本期基金份额交易产生的变动数	4,432,701.45	1,302.65	4,434,004.10
其中：基金申购款	4,432,701.45	1,302.65	4,434,004.10
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,942,951.16	-117,000.62	4,825,950.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	45,901.44
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	3,369.86
其他	14.22
合计	49,285.52

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 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	7,646,064.00
减：卖出股票成本总额	7,226,744.68
买卖股票差价收入	419,319.32

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响

6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	4,757,481.34
减：卖出/赎回基金成本总额	4,763,889.92
基金投资收益	-6,408.58

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06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	170,495.16
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	170,495.16

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,754,911.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,567,975.13
减：应收利息总额	16,440.97
买卖债券差价收入	170,495.16

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——证券申购差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无无债权投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益——其他收益投资。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	81,380.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	771.34
合计	82,151.34

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-144,919.56
——股票投资	-174,961.32
——债券投资	11,724.37
——资产支持证券投资	12,500.00
——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	-144,919.56

6.4.7.19 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	53,084.47
银行间市场交易费用	-
合计	53,084.47

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	3,342.80
信息披露费	59,804.40
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,211.32
合计	65,358.52

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，本集合计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作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

本集合计划本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的的关联方发生变化的情况。

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
信达证券股份有限公司	集合计划管理人
中国建设银行股份有限公司	集合计划托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
信达证券	27,726,532.00	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
信达证券	32,912,758.97	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
信达证券	652,900,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期基金成交 总额的比例
信达证券	4,757,481.34	100.00%

注：本集合计划基金投资为基金合同生效日（2021年03月01日）之前持有的货币ETF，合同生效后已全部卖出，本集合计划基金交易未产生交易费用。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
信达证券	51,456.99	100.00%	109,664.20	100.00%

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 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06 月30日

当期发生的基金应支付的管理费	94,719.68
其中：支付销售机构的客户维护费	34,835.57

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与托管人双方核对无误后，集合计划托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,786.60

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与托管人双方核对无误后，集合计划托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

无。

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

信达价值精选A

份额单位：份

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至 2021年06月30日
基金合同生效日（2021年03月01日）持有的基金份额	2,510,000.00
报告期初持有的基金份额	2,510,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	2,510,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.10%

信达价值精选B

份额单位：份

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至 2021年06月30日
基金合同生效日（2021年03月01日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%
---------------------	-------

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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,751,760.74	45,901.44

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06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

本集合计划本报告期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告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

截至本报告期末2021年06月30日，本集合计划本报告期末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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日，本集合计划本报告期末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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有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

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系，建立了总经理办公会——资产管理业务投资决策委员会——资产管理事业部——大集合业务部四级决策体系，按照授权原则有效控制风险。

6.4.13.2 信用风险

本集合计划在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成基金资产损失的风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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

	2021年06月30日
AAA	3,033,113.00
AAA以下	12,519,830.72
未评级	-
合计	15,552,943.72

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日
AAA	2,010,800.00
AAA以下	3,008,400.00
未评级	-
合计	5,019,200.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险主要包括：

(1) 在某些情况下如果本集合计划持有的某些投资品种的流动性不佳、交易量不足，将会导致证券交易的执行难度提高，例如该投资品种的买入成本提高，或者不能迅速、低成本地变现，从而对本集合计划财产造成不利的影响。

(2) 本集合计划的运作方式为契约型开放式，基金本集合计划主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括中国境内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、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、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。

一般情况下，本集合计划拟投资的资产类别具有较好的流动性，但是在特殊市场环境下本集合计划仍有可能出现流动性不足的情形。本集合计划将严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。本集合计

划管理人还将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。同时，本集合计划管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

规模将随着投资者的申购和赎回而不断波动。若出现巨额赎回，导致本集合计划的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售证券，将会使本集合计划资产净值受到不利影响。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。

6.4.13.4.1 利率风险

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06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	2,751,760.74	-	-	-	-	-	2,751,760.74
结算备付金	1,007,909.24	-	-	-	-	-	1,007,909.24
存出保证金	4,448.69	-	-	-	-	-	4,448.69
交易性金融资产	-	-	5,012,500.00	8,640,225.72	6,912,718.00	12,695,772.00	33,261,215.72
买入返售金融资产	18,000,380.00	-	-	-	-	-	18,000,380.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	496,790.47	496,790.47
应收利息	-	-	-	-	-	75,477.84	75,477.84
资产总计	21,764,498.67	-	5,012,500.00	8,640,225.72	6,912,718.00	13,268,040.31	55,597,982.70
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,193.86	27,193.86
应付托管费	-	-	-	-	-	4,532.30	4,532.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	109,664.20	109,664.20
应交税费	-	-	-	-	-	542.40	542.40
其他负债	-	-	-	-	-	64,763.80	64,763.80
负债总计	-	-	-	-	-	206,696.56	206,696.56
利率敏感度缺口	21,764,498.67	-	5,012,500.00	8,640,225.72	6,912,718.00	13,061,343.75	55,391,286.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

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。本集合计划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

本集合计划所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场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。本集合计划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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	12,695,772.00	22.92
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,552,943.72	28.08
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	5,012,500.00	9.05
合计	33,261,215.72	60.05

注：其他为交易性金融资产—资产支持证券投资。

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 2021 年 06 月 30 日，本集合计划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 28,248,715.72 元，属于第二层次的余额为 5,012,500.00 元，属于第三层次的余额为 0 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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，本集合计划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 2021 年 6 月 30 日，本集合计划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集合计划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	12,695,772.00	22.83
	其中：股票	12,695,772.00	22.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,565,443.72	36.99
	其中：债券	15,552,943.72	27.97
	资产支持证券	5,012,500.00	9.02
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	18,000,380.00	32.38
	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	3,759,669.98	6.76
8	其他各项资产	576,717.00	1.04
9	合计	55,597,982.70	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

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	585,600.00	1.06
C	制造业	8,415,572.00	15.19
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,694,600.00	6.67
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,695,772.00	22.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末无港股通投资股票。

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	603155	新亚强	59,800	2,720,302.00	4.91
2	000002	万科A	100,000	2,381,000.00	4.30
3	601137	博威合金	181,000	2,076,070.00	3.75
4	000651	格力电器	30,000	1,563,000.00	2.82
5	600299	安迪苏	95,000	1,136,200.00	2.05
6	002475	立讯精密	20,000	920,000.00	1.66
7	601155	新城控股	20,000	832,000.00	1.50
8	601088	中国神华	30,000	585,600.00	1.06
9	600048	保利地产	40,000	481,600.00	0.87

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603155	新亚强	3,228,172.00	5.83
2	000002	万科A	2,677,200.00	4.83
3	601137	博威合金	1,915,280.00	3.46
4	601318	中国平安	1,835,622.00	3.31
5	002466	天齐锂业	1,764,300.00	3.19
6	600299	安迪苏	1,735,000.00	3.13
7	000651	格力电器	1,722,100.00	3.11
8	601088	中国神华	967,450.00	1.75
9	002475	立讯精密	948,000.00	1.71
10	002146	荣盛发展	912,000.00	1.65
11	601155	新城控股	858,094.00	1.55
12	600048	保利地产	535,600.00	0.97
13	601688	华泰证券	506,100.00	0.91
14	002867	周大生	475,550.00	0.86
15	600905	三峡能源	10,600.00	0.02
16	600906	财达证券	3,760.00	0.01
17	688538	和辉光电	2,650.00	0.00

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	1,876,170.00	3.39
2	601318	中国平安	1,849,980.00	3.34
3	603155	新亚强	954,313.00	1.72
4	002146	荣盛发展	916,400.00	1.65

5	600299	安迪苏	613,101.00	1.11
6	601688	华泰证券	507,255.00	0.92
7	002867	周大生	497,332.00	0.90
8	601088	中国神华	393,023.00	0.71
9	600905	三峡能源	19,560.00	0.04
10	600906	财达证券	14,460.00	0.03
11	688538	和辉光电	4,470.00	0.01

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	20,097,478.00
卖出股票收入（成交）总额	7,646,064.00

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	15,552,943.72	28.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,552,943.72	28.08

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

					产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	22,000	2,572,834.00	4.64
2	132020	19蓝星EB	15,000	1,735,200.00	3.13
3	123075	贝斯转债	13,000	1,410,357.00	2.55
4	113017	吉视转债	13,000	1,269,060.00	2.29
5	110079	杭银转债	10,000	1,138,700.00	2.06

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	179817	南湖1优	30,000	3,005,100.00	5.43
2	137989	创恒04A	20,000	2,007,400.00	3.62

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

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

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

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
否。

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
否。

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	4,448.69
2	应收证券清算款	496,790.47
3	应收股利	-
4	应收利息	75,477.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	576,717.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	2,572,834.00	4.64
2	132020	19蓝星EB	1,735,200.00	3.13
3	123075	贝斯转债	1,410,357.00	2.55
4	113017	吉视转债	1,269,060.00	2.29
5	128137	洁美转债	1,022,320.00	1.85
6	128109	楚江转债	1,012,555.40	1.83
7	127006	敖东转债	882,815.10	1.59
8	113516	苏农转债	845,481.00	1.53
9	128014	永东转债	732,767.00	1.32
10	113519	长久转债	732,589.00	1.32
11	128021	兄弟转债	210,324.00	0.38
12	127011	中鼎转2	107,910.72	0.19
13	113026	核能转债	105,730.00	0.19
14	127025	冀东转债	53,483.00	0.10

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

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
信达 价值 精选A	62	175,220.66	2,510,000.00	23.10%	8,353,681.21	76.90%
信达 价值 精选B	760	50,439.57	1,805,512.45	4.71%	36,528,559.55	95.29%
合计	822	59,851.28	4,315,512.45	8.77%	44,882,240.76	91.23%

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	信达价值精选A	0.00	0.00%
	信达价值精选B	956,919.62	2.50%
	合计	956,919.62	1.95%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	信达价值精选A	0
	信达价值精选B	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	信达价值精选A	0
	信达价值精选B	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	信达价值精选A	信达价值精选B
基金合同生效日(2021年03月01日)基金份额总额	11,586,637.17	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	38,334,072.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	722,955.96	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,863,681.21	38,334,072.00

注：本集合计划合同生效日：2021 年 03 月 01 日。

§ 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，本集合计划未召开份额持有人大会。

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

(1) 本集合计划本报告期内，经本集合计划管理人董事会决议，同意李光兵先生不再担任公司副总经理，任命李光兵先生为公司副巡视员；公司副总经理邓强先生不再担任首席风险官；公司合规总监吴立光先生兼任首席风险官。

(2) 本集合计划报告期内，经本集合计划管理人股东大会决议，陆华隽先生不再担任公司监事、监事长，聘任张德印先生为公司监事。

(3) 本集合计划报告期内，经本集合计划管理人监事会选举，张德印先生担任公司监事长。

(4) 本集合计划本报告期内，原董事于帆先生、齐睦丹女士辞任公司董事。

(5) 本集合计划本报告期内，经临时股东大会审议通过，选举刘力一先生、宋永辉女士为公司董事。

本集合计划本报告期内，集合计划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

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本集合计划管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本集合计划管理人的基金投资策略严格遵循本集合计划《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本集合计划聘用北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

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

报告期内基金管理人、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	
信达证券	2	27,726,532.00	100.00%	51,456.99	100.00%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
信达证券	32,912,758.97	100.00%	652,900,000.00	100.00%	-	-	4,757,481.34	100.00%

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	信达价值精选一年持有期灵活配合配置混合型集合资产管理计划增聘基金经理公告	中国证监会的指定媒介	2021-04-08
2	信达证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会的指定媒介	2021-04-13
3	信达价值精选一年持有期灵活配合配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会的指定媒介	2021-06-22

§ 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	2021-3-1至 2021-3-7	2,510,000.00	-	-	2,510,000.00	5.10%
产品特有风险							
本集合计划在报告期内存在单一投资者持有份额达到或超过集合计划总份额 20%的情况，在特定赎回比例及市场条件下，若集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产，可能导致流动性风险和集合计划净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加方德保险代理销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加京东肯特瑞基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加大连网金基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/03/26 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加北京广源达信基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/04/08 信达价值精选一年持有期灵活配合配置混合型集合资产管理计划增聘基金经理公告

2021/04/13 信达证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告

2021/04/29 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/12 信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/06/22 信达价值精选一年持有期灵活配合配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件
- 2、信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95321

公司网址：<https://www.cindasc.com>

信达证券股份有限公司
二〇二一年八月三十一日