

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

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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2024年8月29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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 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	7
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	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	14
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	15
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	15
§5 托管人报告	15
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真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§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	51,009,410.28份	
基金合同存续期	自本集合计划合同变更生效日起存续期至2024年12月31日	
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	5,824,909.91份	45,184,500.37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”“本基金”或“信达价值精选”。

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。

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	王小飞
	联系电话	010-83252700	021-60637103
	电子邮箱	wanying@cindasc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95321	021-60637228
传真		010-83252871	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		北京市西城区宣武门西大街 甲127号金隅大厦B座8层	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	张金良

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	北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座8层

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 (2024年01月01日-2024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	42,266.98	341,932.53
本期利润	37,630.95	217,969.08
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0050
本期加权平均净值利润率	0.63%	0.50%
本期基金份额净值增长率	0.59%	0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-80,824.61	-1,463,072.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0139	-0.0324
期末基金资产净值	5,744,085.30	44,557,306.61
期末基金份额净值	0.9861	0.9861
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.64%	-11.60%

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

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	-0.61%	0.17%	-1.20%	0.24%	0.59%	-0.07%
过去三个月	0.12%	0.19%	-0.17%	0.36%	0.29%	-0.17%
过去六个月	0.59%	0.18%	2.48%	0.44%	-1.89%	-0.26%
过去一年	0.26%	0.21%	-2.04%	0.43%	2.30%	-0.22%
过去三年	-12.42%	0.57%	-11.30%	0.52%	-1.12%	0.05%
自基金合同生效起至今	-11.64%	0.54%	-11.16%	0.53%	-0.48%	0.01%

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	-0.61%	0.17%	-1.20%	0.24%	0.59%	-0.07%
过去三个月	0.12%	0.19%	-0.17%	0.36%	0.29%	-0.17%
过去六个月	0.59%	0.18%	2.48%	0.44%	-1.89%	-0.26%
过去一年	0.26%	0.21%	-2.04%	0.43%	2.30%	-0.22%
过去三年	-12.42%	0.57%	-11.30%	0.52%	-1.12%	0.05%
自基金合同生效起至今	-11.60%	0.54%	-10.66%	0.52%	-0.94%	0.02%

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



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”或“公司”）成立于2007年，系由中国信达资产管理股份有限公司为主要发起人设立的股份有限公司。公司注册地为北京，在北京、上海、广东、深圳等全国多个省、自治区、直辖市设有100余家分支机构，经过多年发展，公司具备了较为齐全的经营资质，致力于发展成为一家资产质量优良、专业能力突出、业务特色鲜明、具备差异化竞争优势的综合类证券公司。2023年2月1日，信达证券在上海证券交易所主板上市交易（证券代码：601059）。

信达证券主要业务板块包括证券经纪业务、证券自营业务、投资银行业务和资产管理业务等，并通过控股子公司信达期货有限公司、信风投资管理有限公司、信达创新投资有限公司、信达澳亚基金管理有限公司和信达国际控股有限公司（通过信达证券的控股平台信达证券（香港）控股有限公司持有）分别从事期货业务、私募股权投资基金业务、另类投资业务、公募基金管理业务和境外业务。

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2022年5月9日，旗下7只存量产品已全部完成公募化改造，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”“信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划”“信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划”“信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划”“信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划”和“信达现金宝货币型集合资产管理计划”。

截至本中期报告送出之日，信达证券资产管理子公司设立申请已获得中国证监会受理并收到了第一次正式反馈意见。对此，信达证券积极进行答复。信达证券将以筹备设立资管子公司为契机，力争通过鲜明的投资风格、科学的投资管理模式、完备的风险控制体系、规范的操作流程，不断优化服务意识和质量，为客户提供高质高效的保值增值服务。

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		

程媛媛	本基金的基金经理、 基金经理	2022- 11-24	-	7	程媛媛，CFA，北京大学经济学、管理学双学士，清华大学管理学硕士。2017年5月加入信达证券，历任研究员、投资经理。担任研究员期间，深度覆盖消费和周期行业，擅长抓“落难王子”的业绩拐点。坚持价值投资理念，深度研究公司基本面，并对企业股权价值进行评估，选择股价安全边际较大的时机买入。着眼于股票长期价值的实现，并持续比较各种标的的机会成本，力争做出较优的决策。已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。现任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经理（自2022年11月24日起任职）、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划基金经理（自2022年11月24日起任职）。
徐华	本基金的基金经理、 基金经理	2023- 04-12	-	15	徐华，经济学硕士，毕业于南开大学金融学系，15年固收投研经验。2021年6月加入信达证券资产管理部。曾任申万宏源资产管理事业部业务九总部副总经理、渤海证券研究所债券研究员。擅长宏观经济和大类资产配置分析，对货币、债券、可转债、基金、金融衍生品

					等品种均有深入理解和研究，经历多个完整经济和债市牛熊周期，能够较好把握市场的趋势节奏，并具备较强的证券选择能力。已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。现任信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2022年10月13日起任职）、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2022年10月13日起任职）、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经理（自2023年4月12日起任职）。
--	--	--	--	--	---

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”为根据本集合计划管理人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”分别指根据本集合计划管理人决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证券监督管理委员会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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法》《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、中国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

本集合计划管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本集合计划管理人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，无任何异常关联交易及与禁止交易对手间的交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本集合计划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，未发现本集合计划有可能导致不公平和利益输送的异常交易，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

2024 年上半年，在复杂多变的国内外经济环境下，A 股市场整体走势震荡承压，主要指数和行业板块之间分化明显。从指数角度，上证指数下跌 0.25%，深证成指下跌 7.1%，创业板指下跌 10.99%，在几个核心指数方面，上证 50 指数表现最强，上半年上涨 2.95%，沪深 300 指数小幅上涨 0.89%。行业角度，代表高股息的银行、煤炭和公用事业上涨均超过 10%，计算机、商贸零售、社会服务、医药、房地产、传媒等行业下跌幅度较大，均超 15%。债市方面，2024 年上半年，债市整体呈现牛市格局，利率债和信用债收益率整体下行。截至 6 月 30 日，1 年、3 年、5 年、7 年、10 年国债收益率较年初分别下行 54BP、49BP、42BP、43BP、35BP，AA+评级的 3 年中票、5 年中票、3 年城投债、5 年城投债、7 年城投债收益率较年初分别下行 62BP、81BP、64BP、74BP、85BP。

上半年，股票方面，管理人主要配置基本面优质、估值较低的个股，债券方面，管理人主要配置中短久期、中高评级的信用债，并根据市场行情的变化灵活调整股债比例。

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0.9861元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.59%，同期业绩比较基准收益率为2.48%；截至报告期末信达价值精选B基金份额净值为0.9861元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.59%，同期业绩比较基准收益率为2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前瞻性看，债市方面，当前经济仍面临有效需求不足，地产下行压力仍大，货币政策保持偏宽松，7 月末央行下调 OMO 和 MLF 政策利率，且后续仍有可能进一步降息，为债券利率的下行打开了空间，此外，实体经济融资需求不足，化债背景下资产荒格局预计仍将持续，上述因素支撑债市中期走强，债市收益率曲线仍然易下难上，但是，同时需要关注央行借入国债卖出、重要会议可能推出的增量政策、政府债供给压力和机构止盈等因素可能带来的冲击或者扰动，若债市发生调整且幅度较大，将迎来较好配置机会。

展望未来的权益市场，二十届三中全会公报提出“坚定不移实现全年经济社会发展目标”，央行也随之下调 OMO、LPR 利率，随后财政政策加力支持大规模设备更新和消费品以旧换新，扩大支持范围、提升中央承担比例、同时支持消费，政策对内需弱现实反应迅速，或预示后续进度力度均有可能超预期。但在政策实质性转向且达到一定力度之前，预计经济和市场仍将维持之前的趋势。在宏观政策切实转向且达到一定的力度之前，我们会控制好风险资产的仓位，等待实质性的信贷政策和财政政策拐点出现后，再加仓风险资产。

总体看，我们认为 2024 年经济基本面是逐步修复的过程，相应的资产定价也是再平衡的过程，整体继续看好国内债券的配置价值，A 股有望有阶段性、结构性的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划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。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订集合计划估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、集合计划从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或集合计划估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划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。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

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实施利润分配。

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基金份额持有人数量不足200人的情形。

2023年12月1日至2024年2月21日，本集合计划连续五十二个工作日资产净值低于五千万万元。2024年2月22日，本集合计划的资产净值已恢复五千万万元以上。

2024年3月4日至2024年5月29日，本集合计划连续五十八个工作日资产净值低于五千万万元。2024年5月30日，本集合计划的资产净值已恢复至五千万万元以上。

§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基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金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，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2024年06月30日	2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	105,989.56	841,665.68
结算备付金		357,399.76	544,760.59
存出保证金		13,861.67	9,255.83
交易性金融资产	6.4.7.2	29,977,482.85	31,119,516.50
其中：股票投资		8,725,162.00	5,932,158.68
基金投资		-	-
债券投资		21,252,320.85	25,187,357.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,000,200.00	16,898,361.21
应收清算款		150,110.03	46,705.79
应收股利		-	-
应收申购款		119.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		50,605,163.86	49,460,265.60
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	149,990.61
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,964.55	25,072.39

应付托管费		4,160.77	4,178.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		382.07	2,209.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	274,264.56	237,292.96
负债合计		303,771.95	418,744.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	51,009,410.28	50,025,711.39
未分配利润	6.4.7.8	-708,018.37	-984,190.05
净资产合计		50,301,391.91	49,041,521.34
负债和净资产总计		50,605,163.86	49,460,265.60

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，本集合计划份额净值 0.9861 元，本集合计划总份额 51,009,410.28 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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		490,759.65	-1,413,829.94
1.利息收入		105,958.08	89,745.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,069.42	15,007.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		91,888.66	74,737.94
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		513,401.05	-1,283,618.87
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-340,168.46	-1,713,945.04
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	687,497.48	189,206.31
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	166,072.03	241,119.86
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-128,599.48	-219,956.08
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	-	-
减：二、营业总支出		235,159.62	205,922.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	146,482.90	137,494.72
2.托管费	6.4.10.2.2	24,413.74	22,915.88
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		60.08	852.94
其中：卖出回购金融资产 支出		60.08	852.94
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		779.10	646.73
8.其他费用	6.4.7.19	63,423.80	44,011.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		255,600.03	-1,619,752.01
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		255,600.03	-1,619,752.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		255,600.03	-1,619,752.01

6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	50,025,711.39	-984,190.05	49,041,521.34
二、本期期初净资产	50,025,711.39	-984,190.05	49,041,521.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	983,698.89	276,171.68	1,259,870.57
（一）、综合收益总额	-	255,600.03	255,600.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	983,698.89	20,571.65	1,004,270.54
其中：1.基金申购款	9,161,060.70	-122,598.34	9,038,462.36
2.基金赎回款	-8,177,361.81	143,169.99	-8,034,191.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	51,009,410.28	-708,018.37	50,301,391.91
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,336,483.14	924,810.77	50,261,293.91
二、本期期初净资产	49,336,483.14	924,810.77	50,261,293.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,278,711.59	-1,775,277.89	503,433.70
（一）、综合收益总额	-	-1,619,752.01	-1,619,752.01
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,278,711.59	-155,525.88	2,123,185.71
其中：1.基金申购款	26,245,695.82	-24,680.16	26,221,015.66
2.基金赎回款	-23,966,984.23	-130,845.72	-24,097,829.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	51,615,194.73	-850,467.12	50,764,727.61

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的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。信达证券于2024年2月26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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告》，本集合计划自合同变更生效日起延长存续期至2024年12月31日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的有关规定和《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（更新）》的约定，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2024年8月30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》及其更新、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）和中国证监会、中国证券投资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2024年1月1日至2024年6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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6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》《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）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 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行计量，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生工具公允价值变动产生的利得或损失直接计入当期损益。本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必

要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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) 对于内地投资者持有的基金类别，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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	105,989.56
等于：本金	105,935.79
加：应计利息	53.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	105,989.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	8,935,552.84	-	8,725,162.00	-210,390.84	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	20,916,395.42	272,832.85	21,252,320.85	63,092.58
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,916,395.42	272,832.85	21,252,320.85	63,092.58
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	29,851,948.26	272,832.85	29,977,482.85	-147,298.26	

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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	20,000,200.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,200.00	-

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末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	229,510.76
其中：交易所市场	229,510.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,753.80
合计	274,264.56

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,155,508.26	6,155,508.26

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-330,598.35	-330,598.35
本期末	5,824,909.91	5,824,909.91

6.4.7.7.2 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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,870,203.13	43,870,203.13
本期申购	9,161,060.70	9,161,060.70
本期赎回（以“-”号填列）	-7,846,763.46	-7,846,763.46
本期末	45,184,500.37	45,184,500.37

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 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
上年度末	1,231,128.10	-1,352,193.61	-121,065.51
本期期初	1,231,128.10	-1,352,193.61	-121,065.51
本期利润	42,266.98	-4,636.03	37,630.95
本期基金份额交易产生的变动数	-65,270.57	67,880.52	2,609.95
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-65,270.57	67,880.52	2,609.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,208,124.51	-1,288,949.12	-80,824.61

6.4.7.8.2 信达价值精选B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(信达价值精选B)			
上年度末	-1,745,331.87	882,207.33	-863,124.54
本期期初	-1,745,331.87	882,207.33	-863,124.54
本期利润	341,932.53	-123,963.45	217,969.08
本期基金份额交易产生的变动数	-59,673.63	77,635.33	17,961.70
其中：基金申购款	-416,705.83	294,107.49	-122,598.34
基金赎回款	357,032.20	-216,472.16	140,560.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,463,072.97	835,879.21	-627,193.76

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	4,450.88
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	9,531.90
其他	86.64
合计	14,069.42

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	35,063,074.50
减：卖出股票成本总额	35,347,368.41
减：交易费用	55,874.55
买卖股票差价收入	-340,168.46

6.4.7.10.2 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。

6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	392,758.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	294,739.11
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	687,497.48

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,920,069.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	58,831,498.41
减：应计利息总额	783,815.17
减：交易费用	10,016.83
买卖债券差价收入	294,739.11

6.4.7.12.3 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——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

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

本集合计划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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 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。

6.4.7.15.2 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——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	166,072.03
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	166,072.03

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-128,599.48
——股票投资	-236,726.33
——债券投资	108,126.85
——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	-128,599.48

6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	4,972.24
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
汇划手续费	70.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	63,423.80

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

截至财务报表批准报出日，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内，不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。

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、集合计划销售机构
中国建设银行股份有限公司	集合计划托管人
信达期货有限公司	集合计划管理人的全资子公司

注：此处列示与本集合计划有重大利害关系的各个关联方。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
信达证券 股份有限 公司	73,440,172.56	100.00%	276,887,106.38	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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
信达证券 股份有限 公司	99,142,018.58	100.00%	70,366,818.39	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	上年度可比期间
-------	----	---------

称	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
信达证券 股份有限 公司	1,215,551,000.00	100.00%	918,500,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

无。

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 2024年01月01日至2024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 股份有限 公司	52,532.80	100.00%	229,510.76	100.00%
关联方名 称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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 股份有限 公司	134,536.92	100.00%	149,821.81	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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,482.90	137,494.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	40,818.82	48,710.51
应支付基金管理人的净管理费	105,664.08	88,784.21

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，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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,413.74	22,915.88

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，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023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	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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	2,510,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

信达价值精选B

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023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	-	-
报告期初持有的基金份额	5,324,813.63	5,324,813.63
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	5,324,813.63	5,324,813.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.78%	11.79%

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

信达价值精选B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信达期货有限公司	26,025,025.03	51.02%	26,025,025.03	52.02%

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设	105,989.56	4,450.88	564,367.64	4,731.90

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

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

本报告期内，本集合计划通过二级市场投资于本集合计划管理人的关联方招商证券股份有限公司发行的证券。前述投资行为通过二级市场开展，交易价格公允，不存在利益输送的情况。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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未持有流通受限证券。

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未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

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、全员原则、适应性原则、合理性原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的风险管理体系，建立了董事会——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——大集合业务部多层次决策体系，按照授权原则有效控制风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险主要是指本集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划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，造成集合计划资产损失的风险。本集合计划的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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,447,718.41	2,646,853.26
合计	3,447,718.41	2,646,853.26

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。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	17,331,189.07	17,807,851.65
AAA以下	473,413.37	1,594,204.96
未评级	-	3,138,447.95
合计	17,804,602.44	22,540,504.56

6.4.13.2.5 按长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长期信用评级列示的资产支持证券投资。

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，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（包括中小板、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。

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。

本集合计划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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与集合计划合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本集合计划主要投资于集合计划合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

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

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。本集合计划投资种类包括交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本集合计划的基金管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币 资金	105,989.56	-	-	-	-	-	105,989.56
结算	357,399.76	-	-	-	-	-	357,399.76

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 2024 年中期报告

备付金							
存出保证金	13,861.67	-	-	-	-	-	13,861.67
交易性金融资产	2,335,914.66	-	7,224,256.41	11,692,149.78	-	8,725,162.00	29,977,482.85
买入返售金融资产	20,000,200.00	-	-	-	-	-	20,000,200.00
应收清算款	-	-	-	-	-	150,110.03	150,110.03
应收申购款	-	-	-	-	-	119.99	119.99
资产总计	22,813,365.65	-	7,224,256.41	11,692,149.78	-	8,875,392.02	50,605,163.86
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,964.55	24,964.55
应付托管费	-	-	-	-	-	4,160.77	4,160.77
应交税费	-	-	-	-	-	382.07	382.07
其他负债	-	-	-	-	-	274,264.56	274,264.56
负债总计	-	-	-	-	-	303,771.95	303,771.95
利率敏感度缺口	22,813,365.65	-	7,224,256.41	11,692,149.78	-	8,571,620.07	50,301,391.91
上年度末 2023 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							
货币资金	841,665.68	-	-	-	-	-	841,665.68
结算备付金	544,760.59	-	-	-	-	-	544,760.59
存出保证	9,255.83	-	-	-	-	-	9,255.83

金							
交易性金融资产	6,138,567.99	9,495,244.40	4,878,020.48	4,480,540.68	194,984.27	5,932,158.68	31,119,516.50
买入返售金融资产	16,900,000.00	-	-	-	-	-	16,900,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	46,705.79	46,705.79
资产总计	24,434,250.09	9,495,244.40	4,878,020.48	4,480,540.68	194,984.27	5,978,864.47	49,461,904.39
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	149,990.61	149,990.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,072.39	25,072.39
应付托管费	-	-	-	-	-	4,178.74	4,178.74
应交税费	-	-	-	-	-	2,209.56	2,209.56
其他负债	-	-	-	-	-	237,292.96	237,292.96
负债总计	-	-	-	-	-	418,744.26	418,744.26
利率敏感度缺口	24,434,250.09	9,495,244.40	4,878,020.48	4,480,540.68	194,984.27	5,560,120.21	49,043,160.13

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	-170,232.19	-20,264.74
	市场利率下降25个基点	170,858.96	20,291.75

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	8,725,162.00	17.35	5,932,158.68	12.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	21,252,320.85	42.25	25,187,357.82	51.36
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	29,977,482.85	59.60	31,119,516.50	63.46

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	14,250,511.78	10,831,618.14
第二层次	15,726,971.07	20,287,898.36
第三层次	-	-
合计	29,977,482.85	31,119,516.50

6.4.14.2.2 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。

本集合计划本报告期末无第三层次公允价值变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	8,725,162.00	17.24
	其中：股票	8,725,162.00	17.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,252,320.85	42.00
	其中：债券	21,252,320.85	42.00
	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	20,000,200.00	39.52
	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	463,389.32	0.92
8	其他各项资产	164,091.69	0.32
9	合计	50,605,163.86	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	246,936.00	0.49
B	采矿业	1,612,439.00	3.21
C	制造业	4,734,982.00	9.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	481,904.00	0.96

E	建筑业	54,618.00	0.11
F	批发和零售业	30,364.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	237,038.20	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	334,132.80	0.66
J	金融业	953,226.00	1.90
K	房地产业	22,806.00	0.05
L	租赁和商务服务业	8,484.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,232.00	0.02
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	8,725,162.00	17.35

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	601899	紫金矿业	24,700	433,979.00	0.86
2	000333	美的集团	6,600	425,700.00	0.85
3	600547	山东黄金	13,000	355,940.00	0.71
4	600036	招商银行	8,300	283,777.00	0.56
5	600988	赤峰黄金	16,300	266,342.00	0.53
6	601058	赛轮轮胎	17,000	238,000.00	0.47

7	002714	牧原股份	5,300	231,080.00	0.46
8	002322	理工能科	13,300	213,066.00	0.42
9	600023	浙能电力	28,300	201,213.00	0.40
10	600176	中国巨石	18,100	200,005.00	0.40
11	600066	宇通客车	7,400	190,920.00	0.38
12	600309	万华化学	2,200	177,892.00	0.35
13	601088	中国神华	3,900	173,043.00	0.34
14	002078	太阳纸业	12,100	168,795.00	0.34
15	000858	五粮液	1,200	153,648.00	0.31
16	601838	成都银行	9,900	150,381.00	0.30
17	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.29
18	600989	宝丰能源	8,300	143,839.00	0.29
19	600011	华能国际	14,500	139,490.00	0.28
20	600690	海尔智家	4,800	136,224.00	0.27
21	600938	中国海油	3,900	128,700.00	0.26
22	000651	格力电器	3,100	121,582.00	0.24
23	000528	柳工	9,800	109,662.00	0.22
24	300750	宁德时代	600	108,018.00	0.21
25	603993	洛阳钼业	12,600	107,100.00	0.21
26	300896	爱美客	580	99,818.00	0.20
27	300274	阳光电源	1,540	95,526.20	0.19
28	601318	中国平安	2,300	95,128.00	0.19
29	002648	卫星化学	5,000	89,900.00	0.18
30	000338	潍柴动力	5,300	86,072.00	0.17
31	000100	TCL科技	19,710	85,147.20	0.17
32	600276	恒瑞医药	2,200	84,612.00	0.17
33	300124	汇川技术	1,500	76,950.00	0.15
34	601689	拓普集团	1,300	69,693.00	0.14
35	601288	农业银行	15,000	65,400.00	0.13
36	000425	徐工机械	9,100	65,065.00	0.13
37	002371	北方华创	200	63,978.00	0.13

38	600809	山西汾酒	300	63,264.00	0.13
39	600031	三一重工	3,800	62,700.00	0.12
40	603225	新凤鸣	4,000	62,360.00	0.12
41	601919	中远海控	3,900	60,411.00	0.12
42	600019	宝钢股份	9,000	59,850.00	0.12
43	300760	迈瑞医疗	200	58,182.00	0.12
44	600406	国电南瑞	2,300	57,408.00	0.11
45	601816	京沪高铁	10,000	53,700.00	0.11
46	600919	江苏银行	7,000	52,010.00	0.10
47	002415	海康威视	1,600	49,456.00	0.10
48	601233	桐昆股份	3,000	47,880.00	0.10
49	688036	传音控股	620	47,454.80	0.09
50	600795	国电电力	7,700	46,123.00	0.09
51	600761	安徽合力	2,000	43,280.00	0.09
52	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.08
53	601985	中国核电	3,900	41,574.00	0.08
54	601766	中国中车	5,500	41,305.00	0.08
55	603179	新泉股份	1,000	39,240.00	0.08
56	600028	中国石化	6,100	38,552.00	0.08
57	600188	兖矿能源	1,500	34,095.00	0.07
58	601857	中国石油	3,300	34,056.00	0.07
59	601799	星宇股份	300	33,612.00	0.07
60	600018	上港集团	5,800	33,524.00	0.07
61	601166	兴业银行	1,900	33,478.00	0.07
62	300308	中际旭创	240	33,091.20	0.07
63	601398	工商银行	5,700	32,490.00	0.06
64	601988	中国银行	6,900	31,878.00	0.06
65	600887	伊利股份	1,200	31,008.00	0.06
66	601688	华泰证券	2,500	30,975.00	0.06
67	601138	工业富联	1,100	30,140.00	0.06
68	603501	韦尔股份	300	29,811.00	0.06

69	601211	国泰君安	2,000	27,100.00	0.05
70	000725	京东方 A	6,300	25,767.00	0.05
71	600030	中信证券	1,400	25,522.00	0.05
72	000400	许继电气	700	24,087.00	0.05
73	600660	福耀玻璃	500	23,950.00	0.05
74	688076	诺泰生物	300	23,484.00	0.05
75	600233	圆通速递	1,500	23,475.00	0.05
76	688008	澜起科技	400	22,864.00	0.05
77	601668	中国建筑	4,300	22,833.00	0.05
78	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.04
79	601186	中国铁建	2,600	22,282.00	0.04
80	603605	珀莱雅	200	22,198.00	0.04
81	002916	深南电路	200	21,154.00	0.04
82	600845	宝信软件	660	21,073.80	0.04
83	600436	片仔癀	100	20,717.00	0.04
84	600016	民生银行	5,400	20,466.00	0.04
85	601633	长城汽车	800	20,240.00	0.04
86	601328	交通银行	2,600	19,422.00	0.04
87	603786	科博达	300	19,245.00	0.04
88	002001	新 和 成	1,000	19,200.00	0.04
89	688253	英诺特	500	19,055.00	0.04
90	003006	百亚股份	800	18,960.00	0.04
91	600079	人福医药	1,100	18,887.00	0.04
92	002601	龙佰集团	1,000	18,570.00	0.04
93	003816	中国广核	4,000	18,520.00	0.04
94	600886	国投电力	1,000	18,240.00	0.04
95	300181	佐力药业	1,200	18,144.00	0.04
96	002139	拓邦股份	1,700	18,054.00	0.04
97	600050	中国联通	3,800	17,860.00	0.04
98	603871	嘉友国际	980	17,336.20	0.03
99	002053	云南能投	1,400	16,926.00	0.03

100	002984	森麒麟	700	16,863.00	0.03
101	000166	申万宏源	3,800	16,378.00	0.03
102	000975	山金国际	1,000	16,290.00	0.03
103	300790	宇瞳光学	1,200	16,200.00	0.03
104	600009	上海机场	500	16,125.00	0.03
105	300679	电连技术	400	16,092.00	0.03
106	002906	华阳集团	600	16,056.00	0.03
107	300498	温氏股份	800	15,856.00	0.03
108	300673	佩蒂股份	1,200	15,744.00	0.03
109	002475	立讯精密	400	15,724.00	0.03
110	600926	杭州银行	1,200	15,660.00	0.03
111	605305	中际联合	600	15,474.00	0.03
112	601225	陕西煤业	600	15,462.00	0.03
113	000157	中联重科	2,000	15,360.00	0.03
114	600115	中国东航	3,800	15,238.00	0.03
115	603558	健盛集团	1,500	14,925.00	0.03
116	000786	北新建材	500	14,830.00	0.03
117	002697	红旗连锁	3,200	14,816.00	0.03
118	600893	航发动力	400	14,620.00	0.03
119	002463	沪电股份	400	14,600.00	0.03
120	003000	劲仔食品	1,200	14,460.00	0.03
121	301193	家联科技	900	14,364.00	0.03
122	002311	海大集团	300	14,115.00	0.03
123	600048	保利发展	1,600	14,016.00	0.03
124	601601	中国太保	500	13,930.00	0.03
125	603369	今世缘	300	13,860.00	0.03
126	603288	海天味业	400	13,788.00	0.03
127	002028	思源电气	200	13,380.00	0.03
128	600426	华鲁恒升	500	13,320.00	0.03
129	300791	仙乐健康	520	13,104.00	0.03
130	601728	中国电信	2,100	12,915.00	0.03

131	600566	济川药业	400	12,684.00	0.03
132	002422	科伦药业	400	12,132.00	0.02
133	688561	奇安信	500	11,810.00	0.02
134	600219	南山铝业	3,000	11,430.00	0.02
135	300502	新易盛	100	10,555.00	0.02
136	000538	云南白药	200	10,230.00	0.02
137	601600	中国铝业	1,300	9,919.00	0.02
138	601669	中国电建	1,700	9,503.00	0.02
139	600029	南方航空	1,600	9,424.00	0.02
140	601658	邮储银行	1,800	9,126.00	0.02
141	600489	中金黄金	600	8,880.00	0.02
142	300394	天孚通信	100	8,842.00	0.02
143	001979	招商蛇口	1,000	8,790.00	0.02
144	300408	三环集团	300	8,757.00	0.02
145	300783	三只松鼠	400	8,748.00	0.02
146	002847	盐津铺子	200	8,554.00	0.02
147	002027	分众传媒	1,400	8,484.00	0.02
148	600578	京能电力	2,600	8,424.00	0.02
149	600803	新奥股份	400	8,320.00	0.02
150	603568	伟明环保	400	8,232.00	0.02
151	600760	中航沈飞	200	8,020.00	0.02
152	300633	开立医疗	200	7,916.00	0.02
153	600026	中远海能	500	7,805.00	0.02
154	601916	浙商银行	2,800	7,728.00	0.02
155	601169	北京银行	1,300	7,592.00	0.02
156	600901	江苏租赁	1,500	7,575.00	0.02
157	600398	海澜之家	800	7,392.00	0.01
158	300628	亿联网络	200	7,354.00	0.01
159	601319	中国人保	1,400	7,210.00	0.01
160	601010	文峰股份	4,000	6,800.00	0.01
161	300979	华利集团	100	6,085.00	0.01

162	301082	久盛电气	160	1,732.80	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,491,658.00	3.04
2	601288	农业银行	1,296,353.00	2.64
3	601899	紫金矿业	1,159,471.00	2.36
4	300750	宁德时代	1,104,141.00	2.25
5	000333	美的集团	894,032.00	1.82
6	300896	爱美客	805,599.00	1.64
7	601088	中国神华	738,292.00	1.51
8	600309	万华化学	731,761.00	1.49
9	600887	伊利股份	648,516.00	1.32
10	601318	中国平安	641,651.00	1.31
11	600036	招商银行	641,063.00	1.31
12	002714	牧原股份	605,774.00	1.24
13	000568	泸州老窖	556,428.00	1.13
14	601225	陕西煤业	530,005.00	1.08
15	601601	中国太保	529,818.00	1.08
16	002475	立讯精密	528,840.00	1.08
17	600176	中国巨石	514,450.00	1.05
18	002371	北方华创	484,318.00	0.99
19	601058	赛轮轮胎	459,664.00	0.94
20	600938	中国海油	453,407.00	0.92

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	600519	贵州茅台	2,326,791.00	4.74
2	601288	农业银行	1,349,723.00	2.75
3	300750	宁德时代	995,803.00	2.03
4	601899	紫金矿业	886,212.00	1.81
5	000333	美的集团	797,791.00	1.63
6	601088	中国神华	794,860.00	1.62
7	601225	陕西煤业	755,773.00	1.54
8	002475	立讯精密	752,556.00	1.53
9	300896	爱美客	672,099.00	1.37
10	600887	伊利股份	610,529.00	1.24
11	002371	北方华创	609,113.00	1.24
12	002714	牧原股份	596,173.00	1.22
13	688111	金山办公	551,695.80	1.12
14	601318	中国平安	525,050.00	1.07
15	000568	泸州老窖	523,961.00	1.07
16	600309	万华化学	522,459.00	1.07
17	601601	中国太保	495,862.00	1.01
18	601138	工业富联	418,378.00	0.85
19	600030	中信证券	416,846.00	0.85
20	600150	中国船舶	412,529.00	0.84

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	38,377,098.06
卖出股票收入（成交）总额	35,063,074.50

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	3,447,718.41	6.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,279,252.66	24.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	5,525,349.78	10.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,252,320.85	42.25

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	110059	浦发转债	44,340	4,889,609.90	9.72
2	115828	23海通15	30,000	3,091,353.04	6.15
3	240506	24招证G1	30,000	3,075,446.96	6.11
4	188969	21诚通17	30,000	3,065,781.70	6.09
5	163544	20宏泰01	30,000	3,046,670.96	6.06

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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本集合计划在投资股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

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

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

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

1、海通证券股份有限公司：

(1) 2024年第一季度，上海证监局对海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）采取了责令改正的行政监管措施。具体如下：

① 对境外子公司合规管理和风险管理不到位，未健全覆盖境外子公司的风险指标体系；未督促境外子公司有效处置风险指标超限额的情形；未按规定就境外子公司相关议案进行集体讨论；未对境外子公司部分董事、高级管理人员开展离任审计或离任审查。

② 场外期权业务相关内部控制不健全，未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度；未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法。场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。

③ 未清晰划分另类投资子公司业务范围；未及时处理另类投资子公司有关人员兼任利益冲突职务的行为。

(2) 海通证券于2024年4月12日收到中国证监会《立案告知书》，因在相关主体违反限制性规定转让中核钛白2023年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，根据《中华人

民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，3月13日，中国证监会决定对海通证券进行立案。

4月19日，海通证券以自己名义按照中信中证的报价指令认购中核钛白非公开发行股票，客观上帮助中信中证及其客户取得股票收益，使得定增套利行为得以实现，海通证券收到中国证监会行政处罚事先告知书。

4月30日，海通证券收到中国证监会《行政处罚决定书》，其中对海通证券违反限制性规定转让股票的违法行为，责令改正，给予警告，没收违法所得789,445,21元。

(3) 4月30日，广东证监局对海通证券采取了责令改正的监管措施。具体为：海通证券作为格力地产股份有限公司债券“21格地02”“22格地02”的主承销商和受托管理人，未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查；在“22格地02”期后事项核查中，未对存货可变现净值的评估进行持续关注和尽职调查；未制作咨询审计机构工作底稿；未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告；对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时。

2、招商证券股份有限公司

2024年第一季度，深圳证监局对招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）采取了责令增加内部合规检查次数的监管措施。具体为多名员工曾存在借用他人证券账户长期交易股票、私下接受客户委托交易股票、委托他人炒股等违法违规行为，违法违规行为主要集中在2021年以前。

对于前述事项，管理人认为对发行主体的经营和偿债能力无重大影响，后续管理人将对前述发行主体进行持续关注。

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	13,861.67
2	应收清算款	150,110.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	119.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	164,091.69

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	110059	浦发转债	4,889,609.90	9.72
2	127045	牧原转债	473,413.37	0.94
3	113052	兴业转债	162,326.51	0.32

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	42	138,688.33	0.00	0.00%	5,824,909.91	100.00%
信达价值精选B	327	138,178.90	31,350,808.20	69.38%	13,833,692.17	30.62%

合计	369	138,236.88	31,350,808.20	61.46%	19,658,602.08	38.54%
----	-----	------------	---------------	--------	---------------	--------

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	-	-
	信达价值精选B	800,397.02	1.77%
	合计	800,397.02	1.57%

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	-
	信达价值精选B	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	信达价值精选A	-
	信达价值精选B	10~50
	合计	10~50

§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	-
本报告期期初基金份额总额	6,155,508.26	43,870,203.13
本报告期基金总申购份额	-	9,161,060.70
减：本报告期基金总赎回份额	330,598.35	7,846,763.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	5,824,909.91	45,184,500.37
-------------	--------------	---------------

§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

本报告期内，本集合计划管理人无重大人事变动。

本报告期内，本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及其更新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）负责本集合计划审计事务，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本集合计划本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本集合计划本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 比例		量的比 例	
信达 证券	2	73,440,172.56	100.00%	52,532.80	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	99,142,018. 58	100.00%	1,215,551.00 0.00	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置混合型集合资产管理计划暂停申购、定期定额投资公告	中国证监会的指定媒介	2024-02-22
2	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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会的指定媒介	2024-02-26
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恢复申购、定期定额投资公告	中国证监会的指定媒介	2024-03-15
4	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投资关联方发行证券的公告	中国证监会的指定媒介	2024-03-27
5	信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果（2024年第一季度）的公告	中国证监会的指定媒介	2024-03-27
6	信达证券股份有限公司关于旗下	中国证监会的指定媒介	2024-06-26

参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果（2024 年第二季度）的公告		
---	--	--

§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	2024/01/01-2024/06/30	26,025,025.03	0.00	0.00	26,025,025.03	51.02%
产品特有风险							
<p>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，可能面临巨额赎回情况，可能导致：（1）如果集合计划出现巨额赎回，集合计划在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回，将对投资者的赎回办理进度造成影响；（2）管理人为应对巨额赎回被迫抛售资产，则可能使集合计划资产净值受到不利影响，影响集合计划的投资运作和收益水平；（3）巨额赎回后，集合计划资产规模过小，可能导致部分资产投资比例被动超标、投资受限等而不得不被动调整，从而无法有效实现资产管理合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

11.2.1 报告期其他信息公告情况

2024/6/28 关于信达证券股份有限公司旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告

11.2.2 其他

本集合计划原定存续期限至 2024 年 3 月 1 日，为更好地服务本集合计划的投资者，在切实保护现有份额持有人利益的前提下，本集合计划管理人根据相关法律法规的规定及《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》的约定，经与托管人协商一致，将本计划延长存续期限至 2024 年 12 月 31 日。

§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及其更新
- 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及其更新

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

8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

北京市西城区宣武门西大街甲 127 号金隅大厦 B 座 8 层

12.3 查阅方式

1、投资者可在办公时间到管理人办公场所免费查阅

2、登录管理人网站查阅基金产品相关信息 www.cindasc.com

3、拨打管理人客户服务电话垂询：95321

信达证券股份有限公司

二〇二四年八月三十日