

# 财信价值精选混合型发起式证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:财信基金管理有限公司

基金托管人:东方财富证券股份有限公司

报告送出日期:2026 年 07 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人东方财富证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月29日起至2026年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 财信价值精选混合发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 027270                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金运作方式     | 开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2026 年 04 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 12,220,515.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略       | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资策略（含港股通标的股票）</p> <p>本基金主要采用“自上而下”和“自下而上”相结合的研究方式，筛选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度包括但不限于：治理结构与管理层（例如：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层等）、行业集中度及行业地位（例如：具备独特的核心竞争优势，如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等）、公司业绩表现（例如：业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等）。</p> <p>（2）存托凭证投资策略</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |               |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|                 | <p>对于存托凭证的投资，本基金将依照境内上市交易的股票，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选优质上市公司；并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>主要包含：（1）久期策略；（2）收益率曲线策略；（3）个券选择策略；（4）信用策略；（5）可转换债券和可交换债券投资策略。</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>主要包含：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；（4）信用衍生品投资策略。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。</p> <p>6、参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人合法权益。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手，包括整个证券行业的发展现状，发展趋势，具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况，从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |               |
| 业绩比较基准          | 中证 500 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债-新综合全价（总值）指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |               |
| 风险收益特征          | <p>本基金是混合型基金，预期收益和预期风险理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |               |
| 基金管理人           | 财信基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |               |
| 基金托管人           | 东方财富证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 财信价值精选混合发起式 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 财信价值精选混合发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 027270                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 027271        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 12,102,026.48 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 118,488.52 份  |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 04 月 29 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------------------|---------------|
|                 | 财信价值精选混合发起式 A                                   | 财信价值精选混合发起式 C |
| 1. 本期已实现收益      | -214,490.25                                     | -2,396.23     |
| 2. 本期利润         | -792,240.17                                     | -4,829.12     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0677                                         | -0.0668       |
| 4. 期末基金资产净值     | 11,291,396.79                                   | 110,475.64    |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9330                                          | 0.9324        |

注：1、上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。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

财信价值精选混合发起式 A 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 自基金合同生<br>效起至今 | -6.70%     | 0.45%         | 5.33%          | 1.17%                 | -12.03% | -0.72% |

财信价值精选混合发起式 C 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 自基金合同生<br>效起至今 | -6.76%     | 0.45%         | 5.33%          | 1.17%                 | -12.09% | -0.72% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

财信价值精选混合发起式A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年04月29日-2026年06月30日)



财信价值精选混合发起式C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年04月29日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经<br>理期限 |      | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|----------------------------|----|
|    |    | 任职日期            | 离任日期 |                            |    |
|    |    |                 |      |                            |    |

|     |                                   |            |   |      |                                                                                                                                                        |
|-----|-----------------------------------|------------|---|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 罗黎军 | 本基金的基金经理，财信均衡致远混合型发起式证券投资基金的基金经理。 | 2026-04-29 | - | 13 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司国际业务部港股行业研究员，上海五牛股份投资管理有限公司证券投资部研究员，深圳市前海香江金融控股集团有限公司投资管理部研究员，华润元大基金管理有限公司研究部高级研究员、权益投资部基金经理。2024 年 12 月加入财信基金管理有限公司，任基金经理。 |
| 阮航  | 本基金的基金经理。                         | 2026-04-29 | - | 6 年  | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证鹏元资信评估股份有限公司分析师、新疆前海联合基金管理有限公司信用研究部研究员、固定收益部基金经理。2025 年 1 月加入财信基金管理有限公司，任基金经理。                                                      |

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，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对非首任基金经理，“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的相关规定。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照公平交易原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生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超过该证券当日成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度以来，权益市场整体呈现震荡上行走势，但内部结构分化显著，呈现出指数走势偏强、个股表现偏弱的格局，宽基指数依托科技权重标的抬升持续走强，绝大多数传统行业震荡走弱，市场结构性行情特征十分突出。

操作层面，本基金严格遵循价值投资框架，采取了稳健审慎的建仓节奏，以及自上而下与自下而上相结合的选股方式。配置方面，本基金以价值投资为核心投资逻辑，围绕估值合理、业绩稳健、具备核心竞争力的标准筛选优质标的，在建仓过程中坚持先深入研究、后分批布局的原则，稳步推进组合构建。

展望后市，本基金仍将在价值投资框架下，坚持聚焦核心、适度均衡、分散风险的配置思路，不对市场短期波动进行过度博弈，以价值属性突出的优质资产为核心方向，同时结合市场结构性趋势做适度均衡，重点关注盈利确定性强、估值处于合理区间、股息率具备吸引力的优质龙头标的，并根据市场变化及时对组合进行动态调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财信价值精选混合发起式 A 基金份额净值为 0.9330 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.70%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%；截至报告期末财信价值精选混合发起式 C 基金份额净值为 0.9324 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.76%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，存续期未满三年，不适用本项说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目    | 金额(元)        | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|--------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 6,768,805.09 | 59.16         |
|    | 其中：股票 | 6,768,805.09 | 59.16         |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 1,000.03      | 0.01   |
|   | 其中：债券             | 1,000.03      | 0.01   |
|   | 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      | 4,663,302.35  | 40.76  |
| 8 | 其他资产              | 7,552.86      | 0.07   |
| 9 | 合计                | 11,440,660.33 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 339,160.09 元，占资产净值比例 2.97%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 160,910.00   | 1.41         |
| C  | 制造业              | 3,477,536.00 | 30.50        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 766,949.00   | 6.73         |
| E  | 建筑业              | 266,935.00   | 2.34         |
| F  | 批发和零售业           | 45,983.00    | 0.40         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 584,831.00   | 5.13         |
| 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              | 1,017,571.00 | 8.92         |
| K  | 房地产业             | 39,858.00    | 0.35         |
| 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               | 32,496.00    | 0.29         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 36,576.00    | 0.32         |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 6,429,645.00 | 56.39        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
|------|-----------|--------------|

|      |            |      |
|------|------------|------|
| 能源   | 134,112.81 | 1.18 |
| 金融   | 49,750.54  | 0.44 |
| 信息技术 | 155,296.74 | 1.36 |
| 合计   | 339,160.09 | 2.97 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 002293 | 罗莱生活 | 26,500 | 262,085.00 | 2.30         |
| 2  | 600642 | 申能股份 | 27,300 | 238,329.00 | 2.09         |
| 3  | 601886 | 江河集团 | 27,500 | 220,825.00 | 1.94         |
| 4  | 601339 | 百隆东方 | 32,000 | 216,640.00 | 1.90         |
| 5  | 600919 | 江苏银行 | 20,000 | 215,600.00 | 1.89         |
| 6  | 601838 | 成都银行 | 11,500 | 203,550.00 | 1.79         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 2,600  | 196,378.00 | 1.72         |
| 8  | 601939 | 建设银行 | 19,600 | 188,748.00 | 1.66         |
| 9  | 600023 | 浙能电力 | 34,200 | 179,892.00 | 1.58         |
| 10 | 600066 | 宇通客车 | 6,700  | 179,627.00 | 1.58         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)  | 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） | 1,000.03 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -        | -            |
| 9  | 其他        | -        | -            |
| 10 | 合计        | 1,000.03 | 0.01         |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元)  | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|----------|--------------|
| 1  | 118072 | 鼎通转债 | 10    | 1,000.03 | 0.01         |

注：本报告期末仅持有以上债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

## 5.7 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

无。

## 5.8 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权证投资明细

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险。本基金将根据风险管理原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

江河创建集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到大连市城市管理局处罚。

成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚。

浙江浙能电力股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家能源局公开谴责。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资，投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | -        |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | 2,057.26 |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 5,495.60 |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 7,552.86 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688072 | 拓荆科技 | 166,400.00     | 1.46         | 停牌       |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 | 财信价值精选混合发起式 A | 财信价值精选混合发起式 C |
|---------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2026 年 04 月 29 日）基金份额总额 | 10,827,060.99 | 22,510.06     |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额           | 1,281,326.43  | 124,451.66    |

|                                            |               |            |
|--------------------------------------------|---------------|------------|
| 减：基金合同生效日起至报告期<br>期末基金总赎回份额                | 6,360.94      | 28,473.20  |
| 基金合同生效日起至报告期期<br>末基金拆分变动份额（份额减少<br>以“-”填列） | -             | -          |
| 报告期期末基金份额总额                                | 12,102,026.48 | 118,488.52 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                                             | 财信价值精选混合发起式 A | 财信价值精选混合发起式 C |
|---------------------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2026 年 04 月<br>29 日）管理人持有的本基金份<br>额 | 10,000,400.00 | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期<br>末买入/申购总份额                  | 0             | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期<br>末卖出/赎回总份额                  | 0             | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基<br>金份额                        | 10,000,400.00 | -             |
| 报告期期末持有的本基金份额<br>占基金总份额比例（%）                | 82.63         | -             |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|------|
| 1  | 基金成立 | 2026-04-29 | 10,000,400.00 | 10,000,000.00 | 0    |
| 合计 |      |            | 10,000,400.00 | 10,000,000.00 |      |

注：1、交易份额包含认购期利息转份额 400.00 份。  
2、管理人于 2026 年 4 月 24 日发起认购，本基金于 2026 年 4 月 29 日成立。

§ 8 报告期末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<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额<br>承诺持有<br>期限   |
|-----------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|----------------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,400.00 | 81.83%               | 10,000,400.00 | 81.83%               | 自基金合<br>同生效日<br>起不少于 |

|             |               |        |               |        |                  |
|-------------|---------------|--------|---------------|--------|------------------|
|             |               |        |               |        | 3 年              |
| 基金管理人高级管理人员 | 43,573.96     | 0.36%  | -             | -      | -                |
| 基金经理等人员     | 620,056       | 5.07%  | -             | -      | -                |
| 基金管理人股东     | -             | -      | -             | -      | -                |
| 其他          | -             | -      | -             | -      | -                |
| 合计          | 10,664,029.96 | 87.26% | 10,000,400.00 | 81.83% | 自基金合同生效日起不少于 3 年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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              | 20260429-20260630       | 10,000,400.00 | -    | -    | 10,000,400.00 | 81.83% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                |                |                         |               |      |      |               |        |
| 报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。<br>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。 |                |                         |               |      |      |               |        |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予财信价值精选混合型发起式证券投资基金注册募集的文件
- (二) 《财信价值精选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《财信价值精选混合型发起式证券投资基金托管协议》
- (四) 《财信价值精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- (五) 财信基金管理有限公司开放式基金业务规则

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 10.2 存放地点

湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301

## 10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

基金管理人网站：<https://mfund.hnchasing.com>

财信基金管理有限公司  
二〇二六年七月二十一日