

# 金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:金信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2024 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	金信价值精选混合	
基金主代码	005117	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 09 月 01 日	
基金管理人	金信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	146,584,794.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
下属分级基金的交易代码	005117	005118
报告期末下属分级基金的份 额总额	69,299,847.94 份	77,284,946.43 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用价值投资策略对市场进行投资，在控制组合净值波动率的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下九个方面：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、大类资产配置策略 在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段，并将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定大类资产之间的配置比例。</li> <li>2、股票投资策略 本基金将从定性和定量两方面入手，选取有良好增值潜力的上市公司股票构建股票投资组合。</li> <li>3、债券投资策略 本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。</li> <li>4、可转换债券及可交换债券投资策略 本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资。</li> <li>5、资产支持证券等品种投资策略 本基金将深入分析市场利率等基本因素，并辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值，以合理价格买入并持有。</li> </ol>

	<p>6、权证投资策略： 本基金以权证的市值价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，追求基金资产稳定的当期收益。</p> <p>7、中小企业私募债券投资策略 本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。</p> <p>8、国债期货投资策略 基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、流动性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>9、股指期货投资策略 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益、中高风险特征的基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王几高	方圆
	联系电话	0755-82510502	95559
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-900-8336	95559
传真		0755-82510305	021-62701216
注册地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603 深圳市福田区益田路 6001 号太平 金融大厦 1502 室	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518038	200336
法定代表人		殷克胜	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jxfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金信基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大厦 8 层

## § 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）	
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
本期已实现收益	-3,169,066.15	-3,115,128.74
本期利润	-16,912,548.42	-17,718,452.36
加权平均基金份额本期利润	-0.2341	-0.2186
本期加权平均净值利润率	-21.49%	-23.35%
本期基金份额净值增长率	-18.79%	-18.83%
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	-781,778.31	-11,644,487.93
期末可供分配基金份额利润	-0.0113	-0.1507
期末基金资产净值	68,518,069.63	65,640,458.50
期末基金份额净值	0.9887	0.8493
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	-1.13%	-0.41%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 金信价值精选混合 A 净值表现

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	-9.39%	1.39%	-1.23%	0.24%	-8.16%	1.15%
过去三个月	-10.22%	1.44%	-0.17%	0.36%	-10.05%	1.08%
过去六个月	-18.79%	1.76%	2.50%	0.44%	-21.29%	1.32%
过去一年	-17.26%	1.50%	-2.05%	0.43%	-15.21%	1.07%
过去三年	-17.66%	1.42%	-11.49%	0.52%	-6.17%	0.90%
自基金合同生效起至今	-1.13%	1.56%	15.20%	0.59%	-16.33%	0.97%

##### 金信价值精选混合 C 净值表现

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	-9.40%	1.39%	-1.23%	0.24%	-8.17%	1.15%
过去三个月	-10.25%	1.44%	-0.17%	0.36%	-10.08%	1.08%
过去六个月	-18.83%	1.76%	2.50%	0.44%	-21.33%	1.32%
过去一年	-17.34%	1.50%	-2.05%	0.43%	-15.29%	1.07%
过去三年	-17.79%	1.42%	-11.49%	0.52%	-6.30%	0.90%
自基金合同生效起至今	-0.41%	1.56%	15.20%	0.59%	-15.61%	0.97%

#### 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



金信价值精选混合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  
(2017年09月01日-2024年06月30日)



金信价值精选混合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  
(2017年09月01日-2024年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，金信基金管理有限公司旗下管理 20 只开放式证券投资基金和 1 只资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨超	投资部执行董事兼基金经理、研究总监	2021-05-11	-	17 年	安徽大学理学学士，天津财经大学金融学专业硕士，南开大学金融学专业博士。2006 年开始先后曾任鹏华基金研究员，高级研究员，长城证券资深分析师，首席分析师，金融研究所负责人。于 2021 年 3 月加入金信基金，现任金信基金投资部执行董事兼基金经理、研究总监。
赵浩然	本基金的基金经理	2022-10-31	-	13 年	南开大学化学学士、天津大学化学硕士。2011 年开始先后任职于中航证券股份有限公司、长城证券股份有限公司。2022 年 8 月加入金信基金，现任金信基金基金经理。
谭智汭	本基金的基金经理助理	2023-08-07	-	5 年	复旦大学生物化学与分子生物学硕士。曾任明达资产医药研究员、华润三九产业链专员，华德国际医药研究员。现任金信基金管理有限公司基金助理兼研究员。

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；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“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相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，组合在持仓结构上继续聚焦于医疗健康板块，重点方向依然是医疗器械，创新药等。由于上半年整体风格明显是红利价值及大市值公司占优，消费、科技成长及中小市值整体表现显著落后。医疗健康板块多数个股属于消费或科技成长性质，并且中小市值成长股也比较多，因上半年医药生物板块整体表现不佳，组合落后于沪深 300。

虽然今年上半年医疗健康板块继续受到市场风格、流动性等因素的影响，表现落后，但中长期维度看好国内医疗健康产业的发展前景，尤其是医疗器械、创新药的长期机会。一方面从需求维度，随着老龄化的发展，行业需求持续稳定增长问题不大，另一方面国内在医疗器械及创新药领域的进步也非常明显。一些重要创新型医疗器械产品已经逐步追上国际先进水平，甚至部分领域取得全球领先地位。我国创新药企业在国际市场竞争力近些年也在持续提升，一些优秀的公司重磅品种获得海外生物医药巨头的认可，并达成重要战略合作协议，潜在总金额也是动辄达数十亿乃至百亿人民币，创新出海逐步进入到收获阶段。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金信价值精选混合 A 基金份额净值为 0.9887 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.79%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%；截至报告期末金信价值精选混合 C 基金份额净值为 0.8493 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.83%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，我国 GDP 同比增长 5%，宏观经济整体稳定运行。1 季度，我国经济开局良好，实际 GDP 同比增长 5.3%，修复好于市场预期。2 季度，GDP 同比增长 4.7%，环比略有下降。从结构上看，呈现生产强于投资、强于消费的状态。工业和制造业对经济支撑偏强，出口稳定在较高位，消费对经济增长的支撑减弱。

股票市场方面，在经历过 1 季度的剧烈波动之后，2 季度市场展现出一定韧性。从结构上来看，红利价值及大盘风格整体占优，而中小成长风格表现较弱。

虽然目前依然是红利风格占优，但从历史经验看，市场风格因素对市场的影响往往都是阶段性，长期依然看好国内消费及科技成长板块的发展潜力。

从经济层面来看，一方面下半年进出口拉动的不确定性增加，消费也有可能继续维持低位，要实现经济增长目标存在一定压力。但另一方面，在面对复杂的内外经济环境，国内政策仍然有发力空间。预计下半年的财政支持经济的力度有望强于上半年。并且，预计下半年美元有望结束加息周期，人民币压力也有望缓解，国内货币政策也会有更大的发力空间。因此对全年经济保持平稳增长依然有信心。

从股票市场层面来看，对下半年的表现会更加积极乐观一些。一方面，红利价值板块在低利率背景下，依然有较强的支撑，另一方面科技成长及消费板块，很多细分行业及个股经过充分调整后，已经具备极高的投资性价比。此外，很多支持科技发展及促进居民消费的产业及行业政策也会进一步提振市场信心。因此，看好下半年的股票市场表现，尤其是科技成长及部分消费行业更值得期待。

展望 2024 年下半年，一方面从股票市场整体来看，经过上半年的调整，市场也有望企稳回升，进入上升通道的概率也在逐步增加。另一方面，医药行业估值水平依然处于历史较低水平，随着医药企业逐步走出集采及疫情等因素的扰动，行业盈利有望恢复稳健增长。此外，从政策层面来看，对创新药及创新医疗器械，也在陆续出台一些支持政策，因此看好生物医药行业在下半年的投资机会。在目前时间点，生物医药行业已经具备比较高的投资性价比，因此，组合会继续将重点放在医疗健康板块，尤其是医疗器械，创新药等方向，同时对于其他科技成长，消费复苏领域我们也会保持关注择机精选标的进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所

持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现持有人数或基金资产净值预警的情形。

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

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

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

#### 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

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

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,301,244.06	6,892,048.99
结算备付金		73,984.22	504,692.47
存出保证金		39,207.32	78,407.23
交易性金融资产	6.4.7.2	130,559,340.80	179,273,575.34
其中：股票投资		124,668,773.40	173,201,175.02
基金投资		-	-
债券投资		5,890,567.40	6,072,400.32
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	-	-
应收清算款		870,267.58	2,181,474.52
应收股利		-	-
应收申购款		22,723.36	271,946.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		134,866,767.34	189,202,145.05
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		421,400.28	1,201,105.72
应付赎回款		10,026.21	40,747.33
应付管理人报酬		116,511.17	165,038.34
应付托管费		17,476.68	24,755.75
应付销售服务费		5,747.08	8,493.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.13	0.48
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	137,075.66	284,653.71
负债合计		708,239.21	1,724,795.13
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	146,584,794.37	166,566,410.24
未分配利润	6.4.7.12	-12,426,266.24	20,910,939.68
净资产合计		134,158,528.13	187,477,349.92
负债和净资产总计		134,866,767.34	189,202,145.05

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 146,584,794.37 份。其中金信价值精选混合 A 基金份额净值 0.9887 元，基金份额总额 69,299,847.94 份；金信价值精选混合 C 基金份额净值 0.8493 元，基金份额总额 77,284,946.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：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 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-33,633,771.01	-5,252,535.82
1. 利息收入		10,073.60	18,568.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,073.60	18,568.26
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,309,162.01	7,700,964.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,101,932.73	6,541,499.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	115,052.33	71,900.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,677,718.39	1,087,564.82
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-28,346,805.89	-12,981,678.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号	6.4.7.21	12,123.29	9,609.53

填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		997,229.77	657,373.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	768,498.66	512,203.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,274.85	76,830.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	37,672.99	12,822.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.25	0.33
8. 其他费用	6.4.7.23	75,782.02	55,516.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-34,631,000.78	-5,909,909.27
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-34,631,000.78	-5,909,909.27
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-34,631,000.78	-5,909,909.27

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：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	166,566,410.24	20,910,939.68	187,477,349.92
二、本期期初净资产	166,566,410.24	20,910,939.68	187,477,349.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,981,615.87	-33,337,205.92	-53,318,821.79
（一）、综合收益总额	-	-34,631,000.78	-34,631,000.78
（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）	-19,981,615.87	1,293,794.86	-18,687,821.01
其中：1. 基金申购款	3,368,159.33	-183,845.45	3,184,313.88
2. 基金赎回款	-23,349,775.20	1,477,640.31	-21,872,134.89
（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	146,584,794.37	-12,426,266.24	134,158,528.13
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	65,667,377.11	15,855,905.68	81,523,282.79



二、本期期初净资产	65,667,377.11	15,855,905.68	81,523,282.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	86,898,778.67	-1,508,570.71	85,390,207.96
（一）、综合收益总额	-	-5,909,909.27	-5,909,909.27
（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）	86,898,778.67	19,577,212.08	106,475,990.75
其中：1. 基金申购款	91,579,567.97	20,986,203.50	112,565,771.47
2. 基金赎回款	-4,680,789.30	-1,408,991.42	-6,089,780.72
（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）	-	-15,175,873.52	-15,175,873.52
四、本期期末净资产	152,566,155.78	14,347,334.97	166,913,490.75

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：

殷克胜	朱斌	陈瑾
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券或票据)、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允

许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；本基金每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人金信基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况，2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税 [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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《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号文《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号文《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》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

(d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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	3,301,244.06
等于：本金	3,301,004.85
加：应计利息	239.21
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	3,301,244.06

#### 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	154,594,500.86	-	124,668,773.40	-29,925,727.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,780,910.63	89,407.40	5,890,567.40	20,249.37
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,780,910.63	89,407.40	5,890,567.40	20,249.37
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	160,375,411.49	89,407.40	130,559,340.80	-29,905,478.09	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 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	62,484.78
其中：交易所市场	62,484.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,590.88
合计	137,075.66

#### 6.4.7.10 实收基金

##### 金信价值精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	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	77,164,125.10	77,164,125.10
本期申购	294,711.70	294,711.70
本期赎回（以“-”号填列）	-8,158,988.86	-8,158,988.86
本期末	69,299,847.94	69,299,847.94

##### 金信价值精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	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	89,402,285.14	89,402,285.14
本期申购	3,073,447.63	3,073,447.63
本期赎回（以“-”号填列）	-15,190,786.34	-15,190,786.34
本期末	77,284,946.43	77,284,946.43

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

##### 金信价值精选混合 A

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
上年度末	9,591,521.39	7,182,015.75	16,773,537.14
本期期初	9,591,521.39	7,182,015.75	16,773,537.14
本期利润	-3,169,066.15	-13,743,482.27	-
			16,912,548.42

本期基金份额交易产生的变动数	-583,058.64	-59,708.39	-642,767.03
其中：基金申购款	23,895.70	1,697.28	25,592.98
基金赎回款	-606,954.34	-61,405.67	-668,360.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,839,396.60	-6,621,174.91	-781,778.31

## 金信价值精选混合 C

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
上年度末	-2,578,068.78	6,715,471.32	4,137,402.54
本期期初	-2,578,068.78	6,715,471.32	4,137,402.54
本期利润	-3,115,128.74	-14,603,323.62	-
			17,718,452.36
本期基金份额交易产生的变动数	768,726.49	1,167,835.40	1,936,561.89
其中：基金申购款	-204,019.92	-5,418.51	-209,438.43
基金赎回款	972,746.41	1,173,253.91	2,146,000.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,924,471.03	-6,720,016.90	-
			11,644,487.93

## 6.4.7.13 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	7,516.83
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	2,020.59
其他	536.18
合计	10,073.60

注：“其他”为结算保证金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 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	154,690,263.47
减：卖出股票成本总额	161,478,052.05
减：交易费用	314,144.15
买卖股票差价收入	-7,101,932.73

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 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	51,571.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,480.63
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	115,052.33

##### 6.4.7.15.2 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	949,655.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	878,154.37
减：应计利息总额	8,002.53
减：交易费用	17.68
买卖债券差价收入	63,480.63

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 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	1,677,718.39
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	1,677,718.39

## 6.4.7.20 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	-28,346,805.89
——股票投资	-28,358,995.26
——债券投资	12,189.37
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-28,346,805.89

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	12,123.29
合计	12,123.29

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

## 6.4.7.23 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	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,191.14
合计	75,782.02

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金无分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金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

本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金信基金管理有限公司（“金信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
宋思颖	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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 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管理费	768,498.66	512,203.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	112,841.23	24,175.72
应支付基金管理人的净管理费	655,657.43	488,028.12

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金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。

本基金管理人按照与基金销售机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

##### 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	115,274.85	76,830.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C	合计
金信基金	-	10,262.10	10,262.10
合计	-	10,262.10	10,262.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C	合计
金信基金	-	10,648.21	10,648.21
合计	-	10,648.21	10,648.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起第 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

## 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

本基金本报告期内与上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

## 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自有资金投资本基金的情况

金信价值精选混合 C

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（2017 年 09 月 01 日）持有的基金份额	100,000.00	100,000.00
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本报告期内基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

#### 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

##### 金信价值精选混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 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
安徽国元信托有限责任公司	49,312,895.54	33.6412%	49,312,895.54	29.6055%
杨超	16,513.01	0.0113%	16,513.01	0.0099%

##### 金信价值精选混合 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 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
宋思颖	-	-	660,252.50	0.3964%

注：宋思颖、杨超、安徽国元信托有限责任公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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
交通银行股份有限公司	3,301,244.06	7,516.83	25,074,256.5	17,134.46

			2	
--	--	--	---	--

注：本基金的银行活期存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 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

本基金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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密

监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种



修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

#### 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	3,301,244.06	-	-	-	-	-	3,301,244.06
结算备付金	73,984.22	-	-	-	-	-	73,984.22
存出保证金	39,207.32	-	-	-	-	-	39,207.32
交易性金融资产	5,890,567.40	-	-	-	-	124,668,773.40	130,559,340.80
应收清算款	-	-	-	-	-	870,267.58	870,267.58
应收申购款	-	-	-	-	-	22,723.36	22,723.36
资产总计	9,305,003.00	-	-	-	-	125,561,764.34	134,866,767.34
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	421,400.28	421,400.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,026.21	10,026.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,511.17	116,511.17
应付托管费	-	-	-	-	-	17,476.68	17,476.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,747.08	5,747.08
应交税费	-	-	-	-	-	2.13	2.13
其他负债	-	-	-	-	-	137,075.66	137,075.66

负债总计	-	-	-	-	-	708,239.21	708,239.21
利率敏感度缺口	9,305,003.00	-	-	-	-	124,853,525.13	134,158,528.13
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	6,892,048.99	-	-	-	-	-	6,892,048.99
结算备付金	504,692.47	-	-	-	-	-	504,692.47
存出保证金	78,407.23	-	-	-	-	-	78,407.23
交易性金融资产	-	-	6,072,400.32	-	-	173,201,175.02	179,273,575.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	271,946.50	271,946.50
应收清算款	-	-	-	-	-	2,181,474.52	2,181,474.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,475,148.69	-	6,072,400.32	-	-	175,654,596.04	189,202,145.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,747.33	40,747.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,038.34	165,038.34
应付托	-	-	-	-	-	24,755.75	24,755.75

管费							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,201,105.72	1,201,105.72
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,493.80	8,493.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.48	0.48
其他负债	-	-	-	-	-	284,653.71	284,653.71
负债总计	-	-	-	-	-	1,724,795.13	1,724,795.13
利率敏感度缺口	7,475,148.69	-	6,072,400.32	-	-	173,929,800.91	187,477,349.92

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.39%（2023 年 12 月 31 日：3.24%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%；本基金每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	124,668,773.40	92.93	173,201,175.02	92.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	124,668,773.40	92.93	173,201,175.02	92.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	8,596,691.33	6,314,588.99
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-8,596,691.33	-6,314,588.99

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	124,668,773.40	173,201,175.02
第二层次	5,890,567.40	6,072,400.32
第三层次	-	-
合计	130,559,340.80	179,273,575.34

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	124,668,773.40	92.44
	其中：股票	124,668,773.40	92.44

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,890,567.40	4.37
	其中：债券	5,890,567.40	4.37
	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	3,375,228.28	2.50
8	其他各项资产	932,198.26	0.69
9	合计	134,866,767.34	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	-	-
C	制造业	107,718,594.97	80.29
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	4,219,226.00	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,329,970.00	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	201,942.00	0.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,296,982.43	6.18
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	902,058.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,668,773.40	92.93

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688580	伟思医疗	212,800	5,694,528.00	4.24
2	300003	乐普医疗	359,000	5,327,560.00	3.97
3	300760	迈瑞医疗	16,900	4,916,379.00	3.66
4	688062	迈威生物	169,000	4,890,860.00	3.65
5	688271	联影医疗	43,000	4,717,100.00	3.52
6	688338	赛科希德	204,688	4,431,495.20	3.30
7	002001	新和成	220,000	4,224,000.00	3.15
8	688389	普门科技	259,000	4,211,340.00	3.14
9	688108	赛诺医疗	469,000	4,192,860.00	3.13
10	688550	瑞联新材	176,800	4,099,992.00	3.06
11	300439	美康生物	429,000	3,929,640.00	2.93
12	688056	莱伯泰科	151,000	3,346,160.00	2.49
13	002020	京新药业	319,000	3,339,930.00	2.49
14	603885	吉祥航空	303,000	3,329,970.00	2.48
15	300396	迪瑞医疗	139,000	2,823,090.00	2.10
16	300677	英科医疗	99,000	2,654,190.00	1.98
17	001316	润贝航科	73,000	2,285,630.00	1.70
18	688166	博瑞医药	61,000	2,135,000.00	1.59
19	688677	海泰新光	50,000	1,961,500.00	1.46
20	002422	科伦药业	64,000	1,941,120.00	1.45
21	301087	可孚医疗	56,000	1,898,400.00	1.42
22	688382	益方生物	240,000	1,735,200.00	1.29
23	603658	安图生物	36,000	1,658,520.00	1.24
24	300146	汤臣倍健	120,000	1,626,000.00	1.21
25	688356	键凯科技	27,000	1,587,060.00	1.18
26	688626	翔宇医疗	48,374	1,535,390.76	1.14
27	300981	中红医疗	156,967	1,502,174.19	1.12
28	688075	安旭生物	43,000	1,448,670.00	1.08
29	688131	皓元医药	72,800	1,392,664.00	1.04
30	688358	祥生医疗	52,000	1,350,440.00	1.01
31	300633	开立医疗	33,000	1,306,140.00	0.97
32	688073	毕得医药	39,000	1,161,420.00	0.87
33	301363	美好医疗	38,000	1,102,000.00	0.82
34	002810	山东赫达	90,000	1,060,200.00	0.79
35	300246	宝莱特	169,000	1,022,450.00	0.76
36	002932	明德生物	60,000	1,008,600.00	0.75
37	688236	春立医疗	71,000	1,006,780.00	0.75
38	688179	阿拉丁	99,949	966,506.83	0.72

39	688426	康为世纪	50,000	930,000.00	0.69
40	605266	健之佳	35,280	915,516.00	0.68
41	688212	澳华内镜	22,000	880,220.00	0.66
42	603020	爱普股份	129,000	860,430.00	0.64
43	688298	东方生物	31,000	841,650.00	0.63
44	688265	南模生物	39,000	812,760.00	0.61
45	301239	普瑞眼科	22,600	798,458.00	0.60
46	603367	辰欣药业	56,000	780,640.00	0.58
47	002223	鱼跃医疗	20,000	752,000.00	0.56
48	688046	药康生物	69,000	705,180.00	0.53
49	300452	山河药辅	60,000	681,600.00	0.51
50	688301	奕瑞科技	5,880	677,552.40	0.51
51	688085	三友医疗	39,000	659,100.00	0.49
52	301520	万邦医药	15,000	620,700.00	0.46
53	600587	新华医疗	39,000	613,860.00	0.46
54	688526	科前生物	40,000	587,600.00	0.44
55	688314	康拓医疗	30,000	564,600.00	0.42
56	688293	奥浦迈	18,000	562,860.00	0.42
57	600479	千金药业	52,000	528,840.00	0.39
58	300529	健帆生物	19,000	516,990.00	0.39
59	002432	九安医疗	12,000	486,480.00	0.36
60	002817	黄山胶囊	90,000	480,600.00	0.36
61	688114	华大智造	10,000	474,100.00	0.35
62	600195	中牧股份	60,000	449,400.00	0.33
63	301333	诺思格	13,000	436,930.00	0.33
64	301033	迈普医学	11,000	430,210.00	0.32
65	603566	普莱柯	30,000	407,400.00	0.30
66	688510	航亚科技	21,000	386,610.00	0.29
67	688098	申联生物	90,000	375,300.00	0.28
68	300347	泰格医药	7,600	369,360.00	0.28
69	301096	百诚医药	6,000	348,480.00	0.26
70	600216	浙江医药	30,000	329,400.00	0.25
71	688559	海目星	10,000	328,900.00	0.25
72	002727	一心堂	20,000	301,800.00	0.22
73	301166	优宁维	11,000	297,000.00	0.22
74	300358	楚天科技	39,000	290,160.00	0.22
75	000963	华东医药	10,000	278,100.00	0.21
76	600645	中源协和	17,000	273,700.00	0.20
77	300725	药石科技	10,000	267,700.00	0.20
78	603439	贵州三力	20,000	255,200.00	0.19
79	300203	聚光科技	25,000	252,250.00	0.19
80	002675	东诚药业	20,000	245,200.00	0.18
81	300042	朗科科技	12,000	242,280.00	0.18



82	688161	威高骨科	12,000	237,840.00	0.18
83	688621	阳光诺和	5,500	234,850.00	0.18
84	301230	泓博医药	10,400	234,208.00	0.17
85	300430	诚益通	15,000	226,200.00	0.17
86	300653	正海生物	11,000	223,850.00	0.17
87	300453	三鑫医疗	35,000	223,650.00	0.17
88	300199	翰宇药业	20,000	217,000.00	0.16
89	688692	达梦数据	900	201,942.00	0.15
90	000529	广弘控股	32,000	188,160.00	0.14
91	002294	信立泰	7,000	186,410.00	0.14
92	688133	泰坦科技	11,620	183,363.60	0.14
93	688428	诺诚健华	20,000	162,200.00	0.12
94	688317	之江生物	11,017	158,754.97	0.12
95	688068	热景生物	5,715	147,618.45	0.11
96	688117	圣诺生物	6,000	147,240.00	0.11
97	301015	百洋医药	6,000	141,180.00	0.11
98	301393	昊帆生物	3,000	127,410.00	0.09
99	300326	凯利泰	30,000	114,000.00	0.08
100	301267	华夏眼科	5,000	103,600.00	0.08
101	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.07

## 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	603885	吉祥航空	4,131,176.00	2.20
2	300439	美康生物	4,067,994.00	2.17
3	002001	新和成	3,906,720.00	2.08
4	688382	益方生物	3,213,171.26	1.71
5	301363	美好医疗	2,927,649.00	1.56
6	688166	博瑞医药	2,906,826.61	1.55
7	688266	泽璟制药	2,834,200.85	1.51
8	688338	赛科希德	2,786,260.27	1.49
9	688108	赛诺医疗	2,758,233.84	1.47
10	300003	乐普医疗	2,756,010.00	1.47
11	688271	联影医疗	2,533,609.74	1.35
12	001316	润贝航科	2,450,121.00	1.31
13	300981	中红医疗	2,449,601.11	1.31
14	688197	首药控股	2,275,794.50	1.21
15	002432	九安医疗	2,245,025.00	1.20
16	688356	键凯科技	2,139,350.04	1.14

17	301087	可孚医疗	2,068,375.00	1.10
18	688253	英诺特	2,047,065.95	1.09
19	301520	万邦医药	1,986,087.74	1.06
20	688062	迈威生物	1,961,957.25	1.05

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	301363	美好医疗	9,702,982.00	5.18
2	688253	英诺特	7,960,865.26	4.25
3	688271	联影医疗	6,779,834.86	3.62
4	301520	万邦医药	4,807,862.00	2.56
5	603658	安图生物	4,319,425.00	2.30
6	688550	瑞联新材	3,973,057.17	2.12
7	688108	赛诺医疗	3,501,055.84	1.87
8	688266	泽璟制药	3,379,750.55	1.80
9	300396	迪瑞医疗	3,261,410.00	1.74
10	300358	楚天科技	3,158,196.00	1.68
11	300601	康泰生物	2,871,010.40	1.53
12	688351	微电生理	2,838,351.75	1.51
13	688197	首药控股	2,824,208.64	1.51
14	688799	华纳药厂	2,566,962.49	1.37
15	603707	健友股份	2,551,754.00	1.36
16	301230	泓博医药	2,525,680.00	1.35
17	300723	一品红	2,477,874.00	1.32
18	603885	吉祥航空	2,254,493.27	1.20
19	688389	普门科技	2,223,596.10	1.19
20	688213	思特威	2,114,420.74	1.13

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	141,304,645.69
卖出股票收入（成交）总额	154,690,263.47

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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	5,890,567.40	4.39
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,890,567.40	4.39

## 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	019709	23 国债 16	58,000	5,890,567.40	4.39

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金本报告期末投资股指期货。

## 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

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	39,207.32
2	应收清算款	870,267.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,723.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	932,198.26

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金信价值精选混合 A	760	91,184.01	64,913,547.30	93.6705%	4,386,300.64	6.3295%
金信价值精选混合 C	1,679	46,030.34	72,574,101.53	93.9046%	4,710,844.90	6.0954%
合计	2,360	62,112.20	137,487,648.83	93.7939%	9,097,145.54	6.2061%

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金信价值精选混合 A	175,330.55	0.2530%
	金信价值精选混合 C	378.01	0.0005%
	合计	175,708.56	0.1199%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 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	金信价值精选混合 A	0~10
	金信价值精选混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式 基金	金信价值精选混合 A	10~50
	金信价值精选混合 C	0
	合计	10~50

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立于 2017 年 9 月 1 日，截至本报告期末本基金已成立超过三年。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	金信价值精选混合 A	金信价值精选混合 C
基金合同生效日（2017 年 09 月 01 日）基金 份额总额	9,000,259.20	1,101,072.96
本报告期期初基金份额总额	77,164,125.10	89,402,285.14
本报告期基金总申购份额	294,711.70	3,073,447.63
减：本报告期基金总赎回份额	8,158,988.86	15,190,786.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	69,299,847.94	77,284,946.43

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
国投证券	2	170,766,827.28	57.69%	125,668.66	57.69%	-
太平洋证券	3	125,228,081.88	42.31%	92,155.27	42.31%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金交易费用管理规定》的有关规定，我公司制定了合作证券公司的选择标准和程序：

#### A: 选择标准

- (1) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- (2) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- (3) 公司内部管理规范，合规风控能力和交易等服务力能较强，能满足基金操作的保密要求；
- (4) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息。

#### B: 选择流程

公司投资、研究部门定期对合作证券公司服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果征求有关人员意见，经公司领导审批后选择合作的证券公司：

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

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
国投证券	849,542.35	68.44%	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	391,775.53	31.56%	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年年度第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-01-20
2	金信基金管理有限公司旗下 18 只基金 2023 年年度第 4 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊	2024-01-20
3	金信基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台、账户查询平台的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊	2024-03-05
4	金信精选成长混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-03-30
5	金信基金管理有限公司旗下 18 只基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊	2024-03-30
6	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年年度第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-04-20
7	金信基金管理有限公司旗下 20	中国证监会基金电子披露网站	2024-04-20



	只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	及基金管理人网站、规定报刊	
8	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊	2024-06-14

## § 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	20240101-20240630	49,312,895.54	0.00	0.00	49,312,895.54	33.6412%
产品特有风险							
<p>1、大额赎回风险</p> <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>2、大额申购风险</p> <p>若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

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

## 12.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室

深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

## 12.3 查阅方式

本基金管理人公司网站，网址：[www.jxfunds.com.cn](http://www.jxfunds.com.cn)。

金信基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日