

# 金信行业优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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
<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	9
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	12
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>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	42
7.12 投资组合报告附注	42

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</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 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
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 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	金信行业优选混合	
基金主代码	002256	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 05 月 10 日	
基金管理人	金信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	144,201,584.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金信行业优选混合发起式 A	金信行业优选混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	002256	020451
报告期末下属分级基金的份 额总额	144,201,524.90 份	59.38 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依托中国高速增长转型为高质量增长的过程，投资于能够支持中国经济长期增长的高景气度行业和领先的上市公司，采用积极主动的分散化投资策略，在严密控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五个方面：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在资产配置将根据宏观经济环境，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，及时确定基金资产在股票、债券、货币市场工具等各类资产上的投资比例，降低投资组合的风险，优化投资收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金股票资产将主要投资于符合时代发展，能为社会发展提供有价值的服务或产品的上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将深入分析市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>5、衍生品投资策略</p>

	<p>1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。</p> <p>2) 权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具。</p> <p>3) 国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>4) 股票期权投资策略</p> <p>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，适当参与股票期权的投资。</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	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王几高	张姗
	联系电话	0755-82510502	400-61-95555
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-900-8336	400-61-95555
传真		0755-82510305	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518038	518040
法定代表人		殷克胜	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理	<a href="http://www.jxfunds.com.cn">http://www.jxfunds.com.cn</a>

人互联网网址	
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）	
	金信行业优选混合发起式 A	金信行业优选混合发起式 C
本期已实现收益	-26,777,861.22	-10.30
本期利润	-51,607,025.44	-18.50
加权平均基金份额本期利润	-0.3509	-0.3116
本期加权平均净值利润率	-24.60%	-21.81%
本期基金份额净值增长率	-18.78%	-18.33%
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	48,181,366.48	20.28
期末可供分配基金份额利润	0.3341	0.3415
期末基金资产净值	199,016,540.63	82.40
期末基金份额净值	1.3801	1.3877
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	71.65%	-17.60%

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

## 金信行业优选混合发起式 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	1.22%	2.33%	-1.23%	0.24%	2.45%	2.09%
过去三个月	-7.78%	2.30%	-0.17%	0.36%	-7.61%	1.94%
过去六个月	-18.78%	2.63%	2.50%	0.44%	-21.28%	2.19%
过去一年	-30.30%	2.26%	-2.05%	0.43%	-28.25%	1.83%
过去三年	-44.28%	2.35%	-11.49%	0.52%	-32.79%	1.83%
自基金合同生效起至今	71.65%	2.11%	12.52%	0.57%	59.13%	1.54%

## 金信行业优选混合发起式 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	1.34%	2.33%	-1.23%	0.24%	2.57%	2.09%
过去三个月	-7.51%	2.30%	-0.17%	0.36%	-7.34%	1.94%
过去六个月	-18.33%	2.64%	2.50%	0.44%	-20.83%	2.20%
自基金合同生效起至今	-17.60%	2.60%	4.01%	0.45%	-21.61%	2.15%

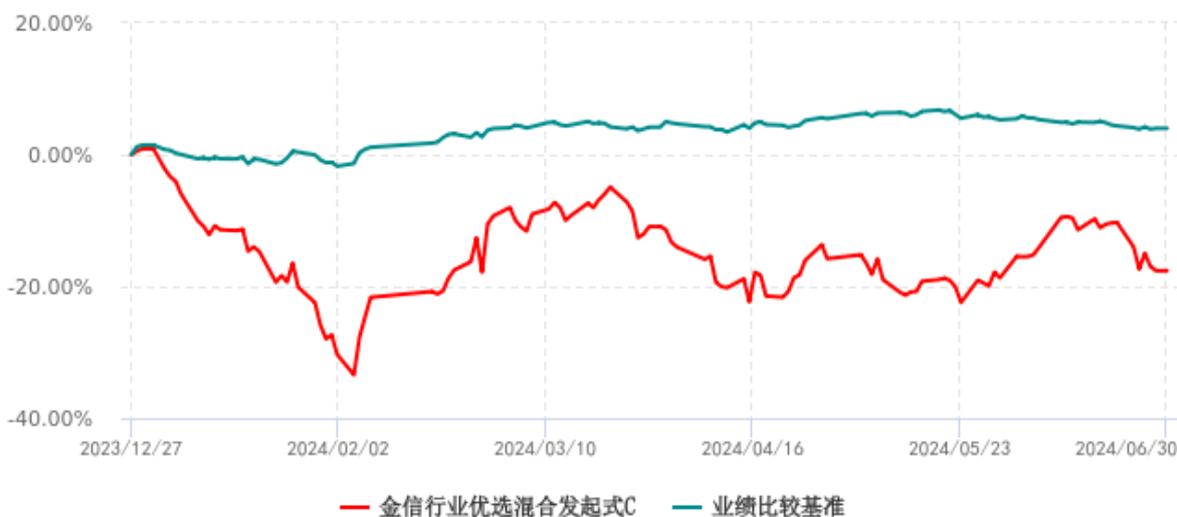
注：1、2019年5月10日（含当日）起，本基金转型为“金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金”，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%；  
2、本基金于2023年12月27日新增C类份额。

## 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

金信行业优选混合发起式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  
(2019年05月10日-2024年06月30日)



金信行业优选混合发起式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  
(2023年12月27日-2024年06月30日)



注：1、本基金自 2019 年 5 月 10 日起，由金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金转型为金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金；  
2、本基金于 2023 年 12 月 27 日新增 C 类份额。

## § 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		
孔学兵	首席投资官（权益）、投资部董事总经理兼基金经理	2020-09-29	-	26 年	东南大学工业管理工程学士、工商管理硕士。1996 年开始先后曾任南京证券股份有限公司自营投资经理、资管投资主办；富安达基金管理有限公司董事、投资管理部总监、基金经理；中融基金管理有限公司权益投资部总监、董事总经理。2020 年 2 月加入金信基金，现任金信基金首席投资官、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”为根据公司决定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定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。

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

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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《金信行业优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 上半年，A 股市场进一步震荡下行，陷入流动性和风险偏好持续下行的困难境地。特殊资金对市场的介入，带来市场资金结构变化，引发交易风格全面倒向价值、红利乃至周期类资产阶段性避险，非业绩层面因素对科技成长类资产持续构成估值和风格压制，市场估值体系在结构扭曲中陷入单一化、扁平化，赚钱效应体验较差进一步引发市场悲观情绪的蔓延。

影响股市的因素错综复杂，我们认为当前市场运行的主要挑战在于：1、社会预期不佳且缺乏有力进展，能见度不高，如经济、政策、地缘等；2、A 股微观交易结构遇阻，市场偏向存量博弈，赚钱效应恶化；3、外部非市场化资金的深度干预，可能对市场风格、估值结构和出清进度构成扰动。市场情绪反复在长期预期与短期交易结构之间不停摇摆，并相互交织。

尽管市场环境不佳且整体风格不利于科技成长类资产，基于中长期增长确定性和整体估值性价比考量，2024 上半年本基金依然坚持了以国产替代为内核的整体配置思路。在宏观经济恢复和地缘政治冲突双重考验下，半导体国产替代方向依然展现出整体竞争力和市场份额的不断提升，呈现出较为旺盛的生命力和投资韧性。同时，基于复苏进程和节奏考量，我们在组合结构上进一步增加了 Ai 趋势引领下高性能存储、先进封装等方向资产配置力度。

产业链跟踪表明，全球及国内半导体行业在经历了 2021-2023 年主动去库存进程后，2024 年库存水平已大幅改善，行业有望逐步进入上行周期。Ai 算存一体化趋势和消费电子 Ai 人机交互创新可能是推动半导体行业复苏的重要因素，两者相结合，有望为半导体新周期注入新动能。

半导体国产替代进入深水区，前道关键设备、零部件和材料在先进制程中渗透率仍低，中长期成长空间广阔，成长确定性较高。Ai 引领新技术、新需求，推动国内先进制程突破，助力国产 Ai

生态构建。作为国之重器与国产 Ai 芯片性能提升上游动力源泉，我们坚持看好半导体关键设备、先进存储与封装、消费电子端 Ai 创新等领域，相信其中蕴含较为丰富的结构性机遇。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金信行业优选混合发起式 A 基金份额净值为 1.3801 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.78%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%；截至报告期末金信行业优选混合发起式 C 基金份额净值为 1.3877 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.33%，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

当前市场内外部环境发生深刻变化，国内有效需求不足，内生动能韧性待考，外部环境复杂性严峻性有所上升。展望下半年，宏观审慎之余，也要关注到，有利因素正在逐步累积。近期中央财政扩张与特别国债用途拓展至设备更新/以旧换新等内需侧，思路合乎逻辑，叠加 8 月中报季业绩风险释放，市场情绪应有修复，估值持续承压的科技成长股有较大概率迎来情绪修复。但大级别的底部出现，可能需要市场预期与微观交易层面出现鼓舞人心的进展，或看到更便宜的估值、更合理的结构。

我们认为，外部干预力量的介入越深，对市场风格和估值体系的影响边际越弱，资产价格的痛苦出清过程被人为拉长，但不会影响最终结局，价值规律终将见效，真正优质的科技成长类资产不会在风格压制下陷入一蹶不振。我们倾向于认为，相对于价值红利，成长方向的市场化出清程度已经比较充分，未来向上修复相对较为确定，不确定的是修复路径与斜率。

作为 A 股市场科技成长方向的重要力量，半导体行业，无论是国产替代进程的持续推进，还是 Ai 拉动下全球半导体行业的复苏趋势，均已得到产业链层面和龙头公司业绩数据的较好验证，低迷的股价表现和历史性低位的估值承压，有行业周期波动的因素，更多可能来自市场风格的压制。从提升供应链韧性和产业链安全考量，叠加对中美出口政策不确定性担忧，市场对半导体关键设备、Ai 算存一体等方向的国产化进展关注度有望提升。此外，消费电子 Ai 新机陆续发布带来的人机交互变化，或将极大影响 Ai 端侧应用，未来 3-5 年有可能出现产业链重大变化和供应链重塑机会，值得我们重点关注。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：金信行业优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	4,715,702.99	5,402,659.33
结算备付金		70,647.83	43,178.18
存出保证金		19,514.96	28,628.96
交易性金融资产	6.4.7.2	195,148,088.51	283,325,393.54
其中：股票投资		187,002,565.22	269,937,989.70
基金投资		-	-
债券投资		8,145,523.29	13,387,403.84
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		6,215.02	155,799.96
应收股利		-	-
应收申购款		963,188.37	676,779.39
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		200,923,357.68	289,632,439.36
<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		690,955.67	140.00
应付赎回款		858,196.39	1,711,156.02
应付管理人报酬		207,807.40	372,639.08
应付托管费		34,634.56	62,106.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,140.63	187,889.70
负债合计		1,906,734.65	2,333,931.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.9	144,201,584.28	169,076,008.37
未分配利润	6.4.7.11	54,815,038.75	118,222,499.65
净资产合计		199,016,623.03	287,298,508.02

负债和净资产总计		200,923,357.68	289,632,439.36
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 144,201,584.28 份。其中金信行业优选混合发起式 A 基金份额净值 1.3801 元，基金份额总额 144,201,524.90 份；金信行业优选混合发起式 C 基金份额净值 1.3877 元，基金份额总额 59.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金信行业优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>		-50,073,418.61	50,349,991.94
1. 利息收入		9,768.73	24,250.34
其中：存款利息收入	6.4.7.12	9,768.73	24,250.34
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）		-25,624,082.92	12,274,462.52
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-26,161,946.94	11,439,581.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	64,749.89	284,755.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	473,114.13	550,125.50
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-24,829,172.42	36,453,542.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	370,068.00	1,597,736.66
<b>减：二、营业总支出</b>		1,533,625.33	3,268,007.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,245,018.19	2,729,226.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	207,503.03	454,871.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	1,221.72

其中：卖出回购金融资产支出		-	1,221.72
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		-	0.24
8. 其他费用	6.4.7.22	81,104.11	82,687.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-51,607,043.94	47,081,984.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-51,607,043.94	47,081,984.65
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-51,607,043.94	47,081,984.65

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金信行业优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	169,076,008.37	118,222,499.65	287,298,508.02
二、本期期初净资产	169,076,008.37	118,222,499.65	287,298,508.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,874,424.09	-63,407,460.90	-88,281,884.99
（一）、综合收益总额	-	-51,607,043.94	-51,607,043.94
（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）	-24,874,424.09	-11,800,416.96	-36,674,841.05
其中：1. 基金申购款	70,445,067.91	29,777,676.03	100,222,743.94
2. 基金赎回款	-95,319,492.00	-41,578,092.99	-136,897,584.99
（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	144,201,584.28	54,815,038.75	199,016,623.03
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	199,609,511.51	156,505,933.69	356,115,445.20
二、本期期初净资产	199,609,511.51	156,505,933.69	356,115,445.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-40,495,487.21	-528,038.42	-41,023,525.63
（一）、综合收益总额	-	47,081,984.65	47,081,984.65
（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）	-40,495,487.21	-47,610,023.07	-88,105,510.28

其中：1. 基金申购款	175,499,696.37	166,496,763.72	341,996,460.09
2. 基金赎回款	-215,995,183.58	-214,106,786.79	-430,101,970.37
(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	159,114,024.30	155,977,895.27	315,091,919.57

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

金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金（原名为金信新能源汽车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[2016]447号《关于准予金信新能源汽车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《金信新能源汽车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 31,122,709.37 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(2016)第 361 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 31,130,144.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,435.39 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2019 年 5 月 8 日发布的《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，自 2019 年 5 月 10 日起，金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金转型为金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金。《金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》自同日起生效，原《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效。

根据基金管理人金信基金管理有限公司 2023 年 12 月 26 日《金信基金管理有限公司关于金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额及调整基金份额净值精度并相应修改基金合同和托管协议的公告》的规定，经与本基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 12 月 27 日起本基金增加 C 类份额类别，并对本基金的《基金合同》和《金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》作相应修改。本基金根据申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将本基金的基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；本基金新增加的 C 类基金份额类别，在投资

者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费。在本基金的基金份额分类实施后，本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额，已有的 A 类基金份额类别业务规则保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信新能源汽车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，本基金的原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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指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。股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于新能源汽车主题相关的股票不低于非现金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%，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，现金类资产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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金原业绩比较基准为：中证新能源汽车指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

根据本基金管理人于 2019 年 5 月 8 日发布的《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，以及《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信行业优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，本基金投资范围自 2019 年 5 月 10 日起变更为：投资于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(含国债、地方政府债券、央行票据、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债的纯债部分、可交换债券等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、国债期货和股票期权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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金类资产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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准自 2019 年 5 月 10 日起变更为：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	4,715,702.99
等于：本金	4,715,148.22
加：应计利息	554.77
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	4,715,702.99

## 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	230,352,891.81	-	187,002,565.22	-43,350,326.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,027,446.00	125,523.29	8,145,523.29	-7,446.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,027,446.00	125,523.29	8,145,523.29	-7,446.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	238,380,337.81	125,523.29	195,148,088.51	-43,357,772.59	

## 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	797.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,779.62
其中：交易所市场	34,779.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	115,140.63

**6.4.7.9 实收基金****金信行业优选混合发起式 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	169,075,948.99	169,075,948.99
本期申购	70,445,067.91	70,445,067.91
本期赎回（以“-”号填列）	-95,319,492.00	-95,319,492.00
本期末	144,201,524.90	144,201,524.90

## 金信行业优选混合发起式 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	59.38	59.38
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	59.38	59.38

## 6.4.7.10 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.11 未分配利润

## 金信行业优选混合发起式 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	87,069,513.51	31,152,944.62	118,222,458.13
本期期初	87,069,513.51	31,152,944.62	118,222,458.13
本期利润	-26,777,861.22	-24,829,164.22	-
本期基金份额交易产生的变动数	-12,110,285.81	309,868.85	-
其中：基金申购款	28,131,254.22	1,646,421.81	29,777,676.03
基金赎回款	-40,241,540.03	-1,336,552.96	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,181,366.48	6,633,649.25	54,815,015.73

## 金信行业优选混合发起式 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	30.58	10.94	41.52
本期期初	30.58	10.94	41.52
本期利润	-10.30	-8.20	-18.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	20.28	2.74	23.02
-----	-------	------	-------

#### 6.4.7.12 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	8,849.45
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	749.49
其他	169.79
合计	9,768.73

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.13 股票投资收益

##### 6.4.7.13.1 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	104,555,570.28
减：卖出股票成本总额	130,523,359.09
减：交易费用	194,158.13
买卖股票差价收入	-26,161,946.94

##### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	92,312.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,562.15
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	64,749.89

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	13,434,899.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,229,436.00
减：应计利息总额	233,026.02
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-27,562.15

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.15 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。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18 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	473,114.13
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	473,114.13

#### 6.4.7.19 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	-24,829,172.42
——股票投资	-24,849,842.42
——债券投资	20,670.00
——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	-24,829,172.42

#### 6.4.7.20 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	370,068.00
合计	370,068.00

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.22 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	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,540.99
合计	81,104.11

#### 6.4.7.23 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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	1,245,018.19	2,729,226.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	525,231.77	1,112,673.19
应支付基金管理人的净管理费	719,786.42	1,616,553.76

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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代销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，用以向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	207,503.03	454,871.10

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

1、本基金本报告期内及上年度可比期间均无关联方销售服务费。

2、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 0.60%。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行股份有限公司	4,715,702.99	8,849.45	6,573,528.24	19,718.95

注：本基金的银行活期存款由基金托管人招商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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

		日		类型		单价	位： 股)			
301538	骏鼎达	2024年03月13日	6个月	网下新股限售	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301536	星辰科技	2024年03月20日	6个月	网下新股限售	16.16	32.27	404	6,528.64	13,037.08	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	网下新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	5个交易日	创业板新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	网下新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301565	中仑新材	2024年06月13日	6个月	网下新股限售	11.88	18.98	479	5,690.52	9,091.42	-
301580	爱迪特	2024年06月19日	6个月	网下新股限售	44.95	65.93	129	5,798.55	8,504.97	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	网下新股限售	15.69	18.79	415	6,511.35	7,797.85	-
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	6个月	网下新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	网下新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024年04月	6个月	网下新股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

		月 29 日		限售						
30150 2	华阳 智能	2024 年 01 月 26 日	6 个 月	网下 新股 限售	28.01	37.83	138	3,865.3 8	5,220.54	-
68858 4	上海 合晶	2024 年 02 月 01 日	6 个 月	网下 新股 限售	22.66	15.89	315	7,137.9 0	5,005.35	-

#### 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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行招商银行，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：同)。

#### 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.06%。

#### 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	1 个月以内	1-3	3 个月-1 年	1-5	5 年	不计息	合计

2024 年 06 月 30 日		个 月		年	以 上		
资产							
货币资 金	4,715,702.9 9	-	-	-	-	-	4,715,702.99
结算备 付金	70,647.83	-	-	-	-	-	70,647.83
存出保 证金	19,514.96	-	-	-	-	-	19,514.96
交易性 金融资 产	-	-	8,145,523.29	-	-	187,002,565.2 2	195,148,088.5 1
应收清 算款	-	-	-	-	-	6,215.02	6,215.02
应收申 购款	-	-	-	-	-	963,188.37	963,188.37
资产总 计	4,805,865.7 8	-	8,145,523.29	-	-	187,971,968.6 1	200,923,357.6 8
负债							
应付清 算款	-	-	-	-	-	690,955.67	690,955.67
应付赎 回款	-	-	-	-	-	858,196.39	858,196.39
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	207,807.40	207,807.40
应付托 管费	-	-	-	-	-	34,634.56	34,634.56
其他负 债	-	-	-	-	-	115,140.63	115,140.63
负债总 计	-	-	-	-	-	1,906,734.65	1,906,734.65
利率敏 感度缺 口	4,805,865.7 8	-	8,145,523.29	-	-	186,065,233.9 6	199,016,623.0 3
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	5,402,659.3	-	-	-	-	-	5,402,659.33

金	3						
结算备付金	43,178.18	-	-	-	-	-	43,178.18
存出保证金	28,628.96	-	-	-	-	-	28,628.96
交易性金融资产	-	-	13,387,403.84	-	-	269,937,989.70	283,325,393.54
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	-	-	-	-	-	676,779.39	676,779.39
应收清算款	-	-	-	-	-	155,799.96	155,799.96
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,474,466.47	-	13,387,403.84	-	-	270,770,569.05	289,632,439.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,711,156.02	1,711,156.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	372,639.08	372,639.08
应付托管费	-	-	-	-	-	62,106.54	62,106.54
应付清算款	-	-	-	-	-	140.00	140.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	187,889.70	187,889.70
负债总计	-	-	-	-	-	2,333,931.34	2,333,931.34
利率敏感度缺口	5,474,466.47	-	13,387,403.84	-	-	268,436,637.71	287,298,508.02

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 4.09%（2023 年 12 月 31 日：4.66%），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	187,002,565.22	93.96	269,937,989.70	93.96
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	187,002,565.22	93.96	269,937,989.70	93.96

## 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%	18,990,848.73	12,961,717.66
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-18,990,848.73	-12,961,717.66

## 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	186,892,262.06	269,664,785.28

第二层次	8,145,523.29	13,387,403.84
第三层次	110,303.16	273,204.42
合计	195,148,088.51	283,325,393.54

#### 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	187,002,565.2	93.07
		2	
	其中：股票	187,002,565.2	93.07
		2	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,145,523.29	4.05
	其中：债券	8,145,523.29	4.05
	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	4,786,350.82	2.38
8	其他各项资产	988,918.35	0.49
9	合计	200,923,357.6	100.00
		8	

## 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	177,080,146.95	88.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,368.27	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,906,050.00	4.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	187,002,565.22	93.96

### 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	688012	中微公司	140,000	19,776,400.00	9.94
2	688072	拓荆科技	155,166	18,636,988.26	9.36
3	688525	佰维存储	274,400	17,602,760.00	8.84
4	688037	芯源微	191,800	17,070,200.00	8.58

5	300604	长川科技	600,000	16,302,000.00	8.19
6	300567	精测电子	260,000	14,692,600.00	7.38
7	002409	雅克科技	203,300	12,789,603.00	6.43
8	688409	富创精密	301,920	11,152,924.80	5.60
9	688361	中科飞测	218,200	10,320,860.00	5.19
10	002654	万润科技	913,000	9,906,050.00	4.98
11	002156	通富微电	360,000	8,060,400.00	4.05
12	000021	深科技	520,000	7,862,400.00	3.95
13	688596	正帆科技	200,000	6,600,000.00	3.32
14	603986	兆易创新	53,100	5,077,422.00	2.55
15	301308	江波龙	44,400	4,206,456.00	2.11
16	603283	赛腾股份	51,600	3,942,240.00	1.98
17	688652	京仪装备	49,500	1,934,955.00	0.97
18	688502	茂莱光学	10,300	958,003.00	0.48
19	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.01
20	301536	星辰科技	404	13,037.08	0.01
21	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
22	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
23	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
24	301565	中仑新材	479	9,091.42	0.00
25	301580	爱迪特	129	8,504.97	0.00
26	688709	成都华微	415	7,797.85	0.00
27	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
28	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
29	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
30	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
31	688584	上海合晶	315	5,005.35	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	688525	佰维存储	15,346,174.66	5.34
2	002156	通富微电	10,517,808.00	3.66

3	002409	雅克科技	6,637,395.00	2.31
4	301308	江波龙	5,748,414.58	2.00
5	603283	赛腾股份	5,294,279.00	1.84
6	603986	兆易创新	5,053,107.00	1.76
7	688361	中科飞测	4,590,986.40	1.60
8	688072	拓荆科技	2,876,303.50	1.00
9	688037	芯源微	2,486,650.32	0.87
10	688652	京仪装备	2,438,998.59	0.85
11	688012	中微公司	2,194,323.36	0.76
12	300567	精测电子	2,087,950.00	0.73
13	688409	富创精密	1,241,009.56	0.43
14	688019	安集科技	1,180,519.45	0.41
15	688502	茂莱光学	1,036,588.00	0.36
16	688120	华海清科	655,278.56	0.23
17	000021	深科技	449,550.00	0.16
18	600171	上海贝岭	448,896.00	0.16
19	688596	正帆科技	417,063.99	0.15
20	300820	英杰电气	381,665.00	0.13

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	688120	华海清科	21,857,657.68	7.61
2	300666	江丰电子	17,217,902.00	5.99
3	300260	新莱应材	7,638,199.00	2.66
4	688012	中微公司	7,476,019.54	2.60
5	000021	深科技	6,905,412.00	2.40
6	688596	正帆科技	6,834,699.48	2.38
7	688072	拓荆科技	4,661,703.74	1.62
8	688019	安集科技	4,578,727.87	1.59
9	300604	长川科技	4,150,862.00	1.44
10	002409	雅克科技	3,247,875.00	1.13
11	688502	茂莱光学	2,815,684.51	0.98
12	688409	富创精密	2,637,744.00	0.92
13	002156	通富微电	2,336,504.00	0.81
14	688037	芯源微	2,234,782.00	0.78
15	301308	江波龙	1,681,798.00	0.59

16	688525	佰维存储	1,612,082.00	0.56
17	603283	赛腾股份	1,445,911.00	0.50
18	002654	万润科技	970,630.00	0.34
19	688376	美埃科技	724,572.22	0.25
20	300567	精测电子	512,500.00	0.18

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	72,437,777.03
卖出股票收入（成交）总额	104,555,570.28

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	8,145,523.29	4.09
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	8,145,523.29	4.09

#### 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	019727	23 国债 24	80,000	8,145,523.29	4.09

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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	19,514.96
2	应收清算款	6,215.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	963,188.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	988,918.35

#### 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
金信行业优选混合发起式 A	22,537	6,398.43	2,457,076.69	1.7039%	141,744,448.21	98.2961%
金信行业优选混合发起式 C	1	59.38	0.00	0.0000%	59.38	100.0000%
合计	22,538	6,398.15	2,457,076.69	1.7039%	141,744,507.59	98.2961%

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	金信行业优选混合发起式 A	40,332.53	0.0280%
	金信行业优选混合发起式 C	59.38	100.0000%
	合计	40,391.91	0.0280%

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	金信行业优选混合发起式 A	0
	金信行业优选混合发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金信行业优选混合发起式 A	0
	金信行业优选混合发起式 C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金由“金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金”转型而来，发起式资金持有期已超过三年。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	金信行业优选混合发起式 A	金信行业优选混合发起式 C
基金合同生效日（2019年05月10日）基金份额总额	20,536,777.66	-
本报告期期初基金份额总额	169,075,948.99	59.38
本报告期基金总申购份额	70,445,067.91	-
减：本报告期基金总赎回份额	95,319,492.00	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	144,201,524.90	59.38
-------------	----------------	-------

## § 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	3	76,457,455.3	43.35%	57,029.0	43.68%	-

		2		9		
华创证券	2	55,648,873.13	31.55%	40,951.76	31.36%	-
海通证券	1	27,516,119.27	15.60%	20,249.15	15.51%	-
东兴证券	1	16,768,248.73	9.51%	12,339.70	9.45%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的比例		总额的 比例		的比例		的比例
国投证券	21,229,319.85	100.00%	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	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	金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金 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	金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 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 只基金 2024 年第 1 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	2024-04-20
8	金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品	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	2024-06-18

资料概要更新		
--------	--	--

## § 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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额未有达到或超过 20%的情况。

### 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行业优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、《金信行业优选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金信行业优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