

金信价值精选灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期：2021 年 3 月 29 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。本年度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 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告.....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	16
§ 5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§ 7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§ 8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 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.....	64

8.7 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.....	64
8.8 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.....	64
8.9 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.....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
9.3 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的情况.....	67
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	68
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	68
§ 10 开放式基金份额变动.....	69
§ 11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
11.2 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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
12.1 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.....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§ 13 备查文件目录.....	76
13.1 备查文件目录.....	76
13.2 存放地点.....	76
13.3 查阅方式.....	76

§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 9 月 1 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	108,742,626.18 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	97,292,613.09 份	11,450,013.09 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	本基金的投资策略主要有以下九个方面： 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。 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。 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。 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。 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面因素，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。 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。 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。 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。 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。
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	陆志俊
	联系电话	0755-82510502	95559
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	luzj@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前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jxfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年	
	金信价值精选 混合 A	金信价值精 选混合 C	金信价值精 选混合 A	金信价值精 选混合 C	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	-1,651,246.12	1,273,430.33	2,340,274.03	1,250,470.23	-3,704,392.60	-620,194.32
本期 利 润	3,770,123.81	1,057,180.19	2,719,360.37	898,807.60	-3,669,647.95	-590,937.74
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0934	0.1061	0.2303	0.1155	-0.3939	-0.3735
本 期 加 权 平 均	8.21%	9.58%	32.23%	15.59%	-56.29%	-55.50%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	54.44%	54.28%	50.22%	51.09%	-43.38%	-43.09%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	3,893,663.40	571,902.77	-3,267,451.77	-2,600,777.45	-4,822,087.66	-1,073,392.10
期末可供分配基金份额利润	0.0400	0.0499	-0.2607	-0.2528	-0.4833	-0.4809

期末基金资产净值	116,630,736.88	13,854,311.40	9,726,808.19	8,070,213.66	5,154,969.03	1,158,726.72
期末基金份额净值	1.1988	1.2100	0.7762	0.7843	0.5167	0.5191
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	19.88%	21.00%	-22.38%	-21.57%	-48.33%	-48.09%

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；

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

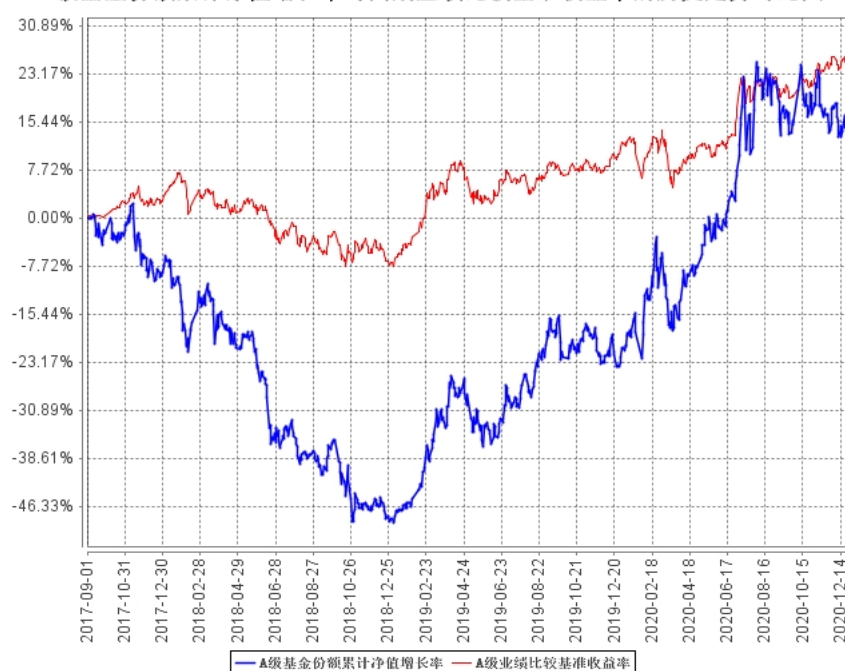
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.29%	1.51%	7.31%	0.50%	-3.02%	1.01%
过去六个月	14.23%	1.74%	12.56%	0.67%	1.67%	1.07%
过去一年	54.44%	1.81%	15.20%	0.71%	39.24%	1.10%
过去三年	31.38%	1.70%	24.86%	0.66%	6.52%	1.04%
自基金合同生效起至今	19.88%	1.66%	28.27%	0.64%	-8.39%	1.02%

金信价值精选混合 C

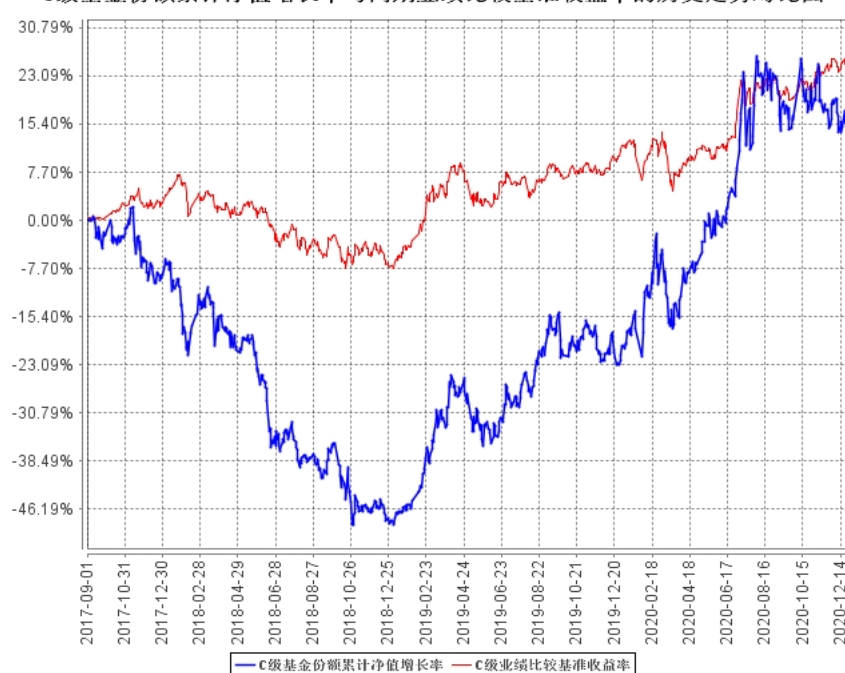
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.27%	1.51%	7.31%	0.50%	-3.04%	1.01%
过去六个月	14.17%	1.74%	12.56%	0.67%	1.61%	1.07%
过去一年	54.28%	1.81%	15.20%	0.71%	39.08%	1.10%
过去三年	32.65%	1.70%	24.86%	0.66%	7.79%	1.04%
自基金合同生效起至今	21.00%	1.66%	28.27%	0.64%	-7.27%	1.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

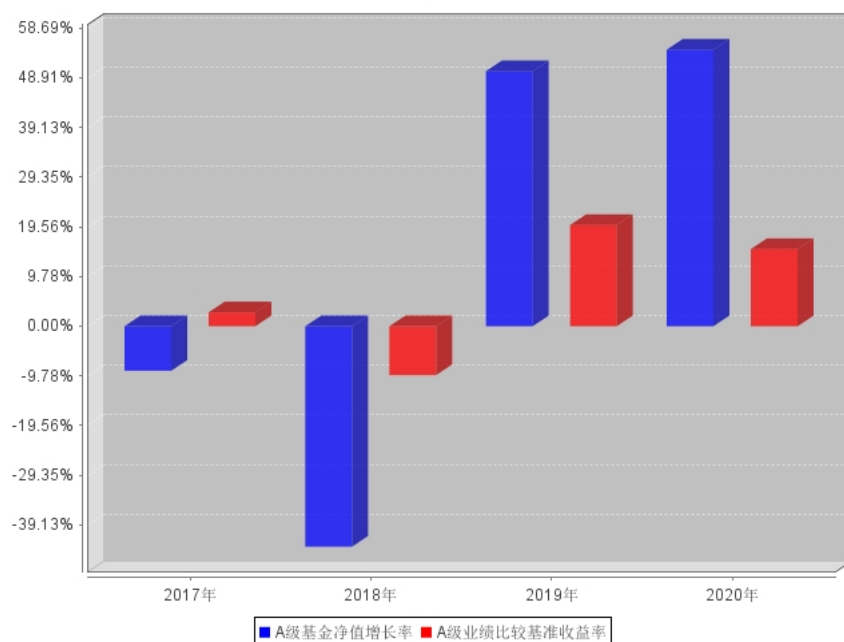


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效，2017 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金的基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效，截至 2020 年 12 月 31 日，本基金成立已满 3 年。自合同生效起，本基金无利润分配事项。

§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 15 只开放式基金和 2 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		
周谧	本基金基金经理	2020 年 12 月 11 日	—	11	男，中国人民大学应用数学硕士，具有基金从业资格。先后任职于中再资产管理股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金创新投资有限公司、深圳铸成投资有限公司及财富证券有限责任公司。现任金信基金基金经理。
吴清宇	本基金基金经理	2018 年 12 月 28 日	2020 年 12 月 16 日	9	男，北京大学经济学硕士。先后任职于融通基金管理有限公司、德邦证券股份有限公司、中国人保资产管理有限公司。现任金信基金管理有限公司基金经理。

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”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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，本项不适用。

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管理办法》和《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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）等有关法律法规的规定，针对股票、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，制定了《金信基金管理有限公司公平交易制度》、《金信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理制度》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，本项不适用。

4.3.3 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

2020 年，中国以及全世界都受到疫情的困扰：经济下行、出差旅行以及集会受限，人们的工作和生活受到较大困扰，收入也因此下滑。而资本市场的表现却是截然相反，三大指数全面上行，创业板指甚至涨幅达到 65%，以此上涨水平来看，这绝对是一个大牛市。但是 2020 年的资本市场又是一个充满分化和结构性的市场，创成长指数涨幅高达 98.65%，而上证指数涨幅仅有 13.87%。

2020 年的市场仍然紧扣着科技和消费两个主题展开，上半年表现较好的主要是消费电子、食品饮料、医疗类板块，进入下半年消费电子等科技类股票表现较差，而随着光伏和新能源汽车的政策以及产销量快速增长的趋势逐步明晰，上述板块以及食品饮料板块表现较好。

价值精选在上半年准确找准了消费电子的节奏，随后出现了宽幅震荡，在 12 月份时在持仓中换入了半导体、新能源、医药等证券，并取得了一定的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末金信价值精选混合 A 基金份额净值为 1.1988 元，本报告期基金份额净值增长率为 54.44%；截至本报告期末金信价值精选混合 C 基金份额净值为 1.2100 元，本报告期基金份额净值增长率为 54.28%；同期业绩比较基准收益率为 15.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，市场情况将更加复杂，基金抱团更加紧密并且估值分化更加的极端，一些小盘股看似性价比比较合理但是却无人问津，如何在两者之间进行平衡是需要特别注意的问题。2021 年的开局只是对这一问题的尝试性应对，虽然效果不好，但是我们会吸取教训重新开始，希望投资者能够给予理解和耐心。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行了定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制和事后完善纠偏的方式，加强对公司产品日常投资运作的管理和监控，保证投资符合既定的投资决策程序和业务流程，基金投资组合及个股投资比例符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露的信息的真实性、准确性和完整性，重视媒体监督和投资者关系管理。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红

与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度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年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21404 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了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“金信价值精选混合发起式基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了金信价值精选混合发起式基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于金信价值精选混合发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	金信价值精选混合发起式基金的基金管理人金信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估金信价值精选混合

	发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用)并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算金信价值精选混合发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督金信价值精选混合发起式基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对金信价值精选混合发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致金信价值精选混合发起式基金不能持续经营。

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	朱珉洁
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	501,201.84	580,108.54
结算备付金		1,367,633.13	651,626.36
存出保证金		102,315.03	38,045.31
交易性金融资产	7.4.7.2	128,174,919.66	15,283,654.21
其中：股票投资		120,775,659.66	14,433,144.21
基金投资		-	-
债券投资		7,399,260.00	850,510.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,062,659.49	1,326,852.63
应收利息	7.4.7.5	162,859.37	18,987.75
应收股利		-	-
应收申购款		56,701.44	229,622.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		132,428,289.96	18,128,897.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		803,964.88	-
应付赎回款		751,567.26	196,802.09
应付管理人报酬		108,167.32	14,461.61
应付托管费		16,225.08	2,169.25
应付销售服务费		1,214.43	638.02
应付交易费用	7.4.7.7	231,989.38	87,755.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	30,113.33	30,049.14
负债合计		1,943,241.68	331,875.42
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	108,742,626.18	22,821,445.19
未分配利润	7.4.7.10	21,742,422.10	-5,024,423.34
所有者权益合计		130,485,048.28	17,797,021.85
负债和所有者权益总计		132,428,289.96	18,128,897.27

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，金信价值精选混合 A 基金份额净值 1.1988 元，基金份额总额 97,292,613.09 份；金信价值精选混合 C 基金份额净值 1.2100 元，基金份额总额 11,450,013.09 份。金信价值精选混合份额总额合计为 108,742,626.18 份。

7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		6,539,653.39	4,366,022.01
1.利息收入		152,819.27	61,205.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,336.88	8,184.39
债券利息收入		69,788.56	18,295.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		61,693.83	34,726.20
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		694,700.98	4,145,507.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	593,180.51	4,046,054.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	22,107.77	-1,635.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	30,019.42
股利收益	7.4.7.16	79,412.70	71,068.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,205,119.79	27,423.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	487,013.35	131,885.12

列)			
减：二、费用		1,712,349.39	747,854.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	563,135.88	141,509.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	84,470.42	21,226.44
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	10,928.75	5,743.05
4. 交易费用	7.4.7.19	980,290.48	541,187.81
5. 利息支出		40,419.31	6,300.75
其中：卖出回购金融资产支出		40,419.31	6,300.75
6. 税金及附加		0.08	108.07
7. 其他费用	7.4.7.20	33,104.47	31,778.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,827,304.00	3,618,167.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,827,304.00	3,618,167.97

7.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,821,445.19	-5,024,423.34	17,797,021.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,827,304.00	4,827,304.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	85,921,180.99	21,939,541.44	107,860,722.43
其中：1. 基金申购款	193,186,170.52	36,091,682.63	229,277,853.15
2. 基金赎回款	-107,264,989.53	-14,152,141.19	-121,417,130.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	108,742,626.18	21,742,422.10	130,485,048.28

金净值)			
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,209,175.51	-5,895,479.76	6,313,695.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,618,167.97	3,618,167.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,612,269.68	-2,747,111.55	7,865,158.13
其中：1. 基金申购款	61,564,190.22	-16,188,955.38	45,375,234.84
2. 基金赎回款	-50,951,920.54	13,441,843.83	-37,510,076.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	22,821,445.19	-5,024,423.34	17,797,021.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 殷克胜	_____ 殷克胜	_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 2021 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期

末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	501,201.84	580,108.54
定期存款	—	—
其中:存款期限 1 个月以内	—	—
存款期限 1-3 个月	—	—
存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	—	—
合计:	501,201.84	580,108.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	115,645,325.60	120,775,659.66	5,130,334.06
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	7,398,295.20	7,399,260.00
	银行间市场	—	—
	合计	7,398,295.20	7,399,260.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—

其他	-	-	-
合计	123,043,620.80	128,174,919.66	5,131,298.86
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,506,780.14	14,433,144.21	-73,635.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	850,695.00	850,510.00
	银行间市场	-	-
	合计	850,695.00	850,510.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	15,357,475.14	15,283,654.21	-73,820.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	243.79	118.93
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	528.00	173.58
应收债券利息	162,850.68	18,774.29
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-813.70	-97.97
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	50.60	18.92
合计	162,859.37	18,987.75

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	231,989.38	87,755.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	231,989.38	87,755.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	113.33	49.14
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	30,000.00
合计	30,113.33	30,049.14

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

金信价值精选混合 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,531,527.15	12,531,527.15
本期申购	104,882,581.28	104,882,581.28
本期赎回（以“-”号填列）	-20,121,495.34	-20,121,495.34
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	97,292,613.09	97,292,613.09

金额单位：人民币元

金信价值精选混合 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,289,918.04	10,289,918.04
本期申购	88,303,589.24	88,303,589.24
本期赎回（以“-”号填列）	-87,143,494.19	-87,143,494.19
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	11,450,013.09	11,450,013.09

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

金信价值精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,267,451.77	462,732.81	-2,804,718.96
本期利润	-1,651,246.12	5,421,369.93	3,770,123.81
本期基金份额交易产生的变动数	8,812,361.29	9,560,357.65	18,372,718.94
其中：基金申购款	8,552,445.95	11,480,969.36	20,033,415.31
基金赎回款	259,915.34	-1,920,611.71	-1,660,696.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,893,663.40	15,444,460.39	19,338,123.79

单位：人民币元

金信价值精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,600,777.45	381,073.07	-2,219,704.38
本期利润	1,273,430.33	-216,250.14	1,057,180.19
本期基金份额交易产生的变动数	1,899,249.89	1,667,572.61	3,566,822.50
其中：基金申购款	6,638,360.22	9,419,907.10	16,058,267.32
基金赎回款	-4,739,110.33	-7,752,334.49	-12,491,444.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	571,902.77	1,832,395.54	2,404,298.31

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,686.29	2,764.24
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	8,900.07	4,916.89
其他	750.52	503.26
合计	21,336.88	8,184.39

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	346,447,054.92	206,070,864.65
减：卖出股票成本总额	345,853,874.41	202,024,810.18
买卖股票差价收入	593,180.51	4,046,054.47

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	22,107.77	-1,635.00
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	22,107.77	-1,635.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020 年12月31日	2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,100,032.43	622,116.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,028,231.00	601,755.00
减：应收利息总额	49,693.66	21,996.49
买卖债券差价收入	22,107.77	-1,635.00

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
----	--------	-------------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	30,019.42

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	79,412.70	71,068.68
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	79,412.70	71,068.68

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,205,119.79	27,423.71
——股票投资	5,203,969.99	27,643.71
——债券投资	1,149.80	-220.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	5,205,119.79	27,423.71

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
----	--	---

基金赎回费收入	487,013.35	131,885.12
合计	487,013.35	131,885.12

注：

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	980,290.48	541,187.81
银行间市场交易费用	—	—
交易基金产生的费用	—	—
其中：申购费	—	—
赎回费	—	—
合计	980,290.48	541,187.81

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	—	—
证券出借违约金	—	—
银行费用	3,104.47	1,778.38
合计	33,104.47	31,778.38

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

深圳市卓越创业投资有限责任公司	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	563,135.88	141,509.54
其中：支付销售机构的客户维护费	62,540.57	29,020.76

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,470.42	21,226.44

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。

7.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	-	2,836.54	2,836.54
合计	-	2,836.54	2,836.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	-	799.68	799.68
合计	-	799.68	799.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费费率为 0.10%。销售服务费计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金份额销售服务费每日计提，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注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 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未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

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

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	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 9 月 1 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	100,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	100,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0900%

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	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 9 月 1 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	100,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	100,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.4400%

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

金信价值精选混合 A				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	45.3500%	-	-

注：安徽国元信托投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	501,201.84	11,686.29	580,108.54	2,764.24

注：本基金的银行活期存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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的证券。

7.4.10.8 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作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	10.76	10.76	3,144	33,829.44	33,829.44	—
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	—
300894	火星机器人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	14.07	36.97	381	5,360.67	14,085.57	—
300907	康平科技	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	—
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	15.38	24.26	463	7,120.94	11,232.38	—
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	—
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股流通受限	20.08	37.33	230	4,618.40	8,585.90	—

300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股流通受限	4.97	8.94	960	4,771.20	8,582.40	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	18.78	31.94	262	4,920.36	8,368.28	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流通受限	16.05	31.58	264	4,237.20	8,337.12	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流通受限	30.26	47.87	158	4,781.08	7,563.46	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流通受限	24.35	33.06	209	5,089.15	6,909.54	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流通受限	39.74	60.44	111	4,411.14	6,708.84	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	10.76	10.76	350	3,766.00	3,766.00	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。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的预防和控制；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防控措施。

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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 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（2019 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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》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比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 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 0.14%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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							
银行存款	501,201.84	-	-	-	-	-	501,201.84
结算备付金	1,367,633.13	-	-	-	-	-	1,367,633.13
存出保证金	102,315.03	-	-	-	-	-	102,315.03
交易性金融资产	7,399,260.00	-	-	-	-	120,775,659.66	128,174,919.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,062,659.49	2,062,659.49
应收利息	-	-	-	-	-	162,859.37	162,859.37
应收申购款	-	-	-	-	-	56,701.44	56,701.44
资产总计	9,370,410.00	-	-	-	-	123,057,879.96	132,428,289.96
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	803,964.88	803,964.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	751,567.26	751,567.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108,167.32	108,167.32
应付托管费	-	-	-	-	-	16,225.08	16,225.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,214.43	1,214.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	231,989.38	231,989.38
其他负债	-	-	-	-	-	30,113.33	30,113.33
负债总计	-	-	-	-	-	1,943,241.68	1,943,241.68
利率敏感度缺口	9,370,410.00	-	-	-	-	121,114,638.28	130,485,048.28
上年度末 2019 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							

银行存款	580,108.54	-	-	-	-	580,108.54
结算备付金	651,626.36	-	-	-	-	651,626.36
存出保证金	38,045.31	-	-	-	-	38,045.31
交易性金融资产	850,510.00	-	-	-	14,433,144.21	15,283,654.21
应收证券清算款	-	-	-	-	1,326,852.63	1,326,852.63
应收利息	-	-	-	-	18,987.75	18,987.75
应收申购款	-	-	-	-	229,622.47	229,622.47
资产总计	2,120,290.21	-	-	-	16,008,607.06	18,128,897.27
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	196,802.09	196,802.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	14,461.61	14,461.61
应付托管费	-	-	-	-	2,169.25	2,169.25
应付销售服务费	-	-	-	-	638.02	638.02
应付交易费用	-	-	-	-	87,755.31	87,755.31
其他负债	-	-	-	-	30,049.14	30,049.14
负债总计	-	-	-	-	331,875.42	331,875.42
利率敏感度缺口	2,120,290.21	-	-	-	15,676,731.64	17,797,021.85

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 12 月 31 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 5.67% (2019 年 12 月 31 日：4.78%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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%；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%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	120,775,659.66	92.56	14,433,144.21	81.10
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	120,775,659.66	92.56	14,433,144.21	81.10

7.4.13.4.3.2 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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	7,494,524.50	875,825.13
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-7,494,524.50	-875,825.13

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 120,594,238.57 元，属于第二层次的余额为 7,580,681.09 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 14,433,144.21 元，第二层次 850,510.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	120,775,659.66	91.20
	其中：股票	120,775,659.66	91.20
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	7,399,260.00	5.59
	其中：债券	7,399,260.00	5.59
	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	1,868,834.97	1.41
8	其他各项资产	2,384,535.33	1.80
9	合计	132,428,289.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	101,888,451.52	78.08
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	12,858.12	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	11,138,727.24	8.54
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	409,514.44	0.31
J	金融业	3,722,744.00	2.85
K	房地产业	8,368.28	0.01
L	租赁和商务服务业	3,583,797.00	2.75
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	11,199.06	0.01
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	120,775,659.66	92.56

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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	002850	科达利	122,004	11,467,155.96	8.79
2	002930	宏川智慧	570,924	11,138,727.24	8.54
3	600460	士兰微	301,300	7,532,500.00	5.77
4	300073	当升科技	112,024	7,264,756.40	5.57
5	603236	移远通信	37,953	7,094,933.82	5.44
6	601865	福莱特	168,600	6,727,140.00	5.16
7	603678	火炬电子	80,900	5,849,070.00	4.48
8	600183	生益科技	176,400	4,967,424.00	3.81
9	600887	伊利股份	109,440	4,855,852.80	3.72
10	600276	恒瑞医药	40,700	4,536,422.00	3.48
11	688298	东方生物	22,289	4,524,667.00	3.47
12	300296	利亚德	681,495	4,334,308.20	3.32
13	600586	金晶科技	623,600	4,053,400.00	3.11
14	300232	洲明科技	419,900	3,951,259.00	3.03
15	601318	中国平安	42,800	3,722,744.00	2.85
16	600267	海正药业	221,000	3,653,130.00	2.80
17	002027	分众传媒	363,100	3,583,797.00	2.75
18	603986	兆易创新	18,000	3,555,000.00	2.72
19	600584	长电科技	77,292	3,290,320.44	2.52
20	300568	星源材质	100,188	3,032,690.76	2.32
21	002080	中材科技	105,000	2,538,900.00	1.95
22	688311	盟升电子	17,330	2,077,867.00	1.59
23	002475	立讯精密	27,275	1,530,673.00	1.17
24	300572	安车检测	35,900	1,467,592.00	1.12

25	002371	北方华创	7,438	1,344,344.12	1.03
26	688106	金宏气体	38,206	1,161,462.40	0.89
27	300212	易华录	9,300	285,045.00	0.22
28	300476	胜宏科技	12,201	263,175.57	0.20
29	000625	长安汽车	11,800	258,184.00	0.20
30	300274	阳光电源	1,800	130,104.00	0.10
31	300918	南山智尚	9,599	111,472.89	0.09
32	300925	法本信息	2,293	105,753.20	0.08
33	300926	博俊科技	3,494	37,595.44	0.03
34	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.02
35	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.02
36	002594	比亚迪	100	19,430.00	0.01
37	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
38	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
39	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
40	605500	森林包装	762	14,980.92	0.01
41	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
42	300894	火星号	381	14,085.57	0.01
43	003020	立方制药	374	12,858.12	0.01
44	300907	康平科技	473	12,700.05	0.01
45	002384	东山精密	470	12,220.00	0.01
46	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.01
47	300902	国安达	463	11,232.38	0.01
48	003027	同兴环保	279	11,199.06	0.01
49	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
50	603659	璞泰来	85	9,553.15	0.01
51	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.01
52	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
53	300917	特发服务	262	8,368.28	0.01
54	300922	天秦装备	264	8,337.12	0.01
55	300910	瑞丰新材	158	7,563.46	0.01
56	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
57	300911	亿田智能	209	6,909.54	0.01
58	300908	仲景食品	111	6,708.84	0.01
59	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002930	宏川智慧	12,944,985.94	72.74
2	300296	利亚德	12,904,515.00	72.51
3	002241	歌尔股份	12,443,211.00	69.92
4	603236	移远通信	12,114,123.00	68.07
5	002429	兆驰股份	10,257,657.00	57.64
6	300476	胜宏科技	10,013,699.00	56.27
7	002850	科达利	9,942,792.00	55.87
8	300740	御家汇	9,591,317.40	53.89
9	300433	蓝思科技	9,405,961.40	52.85
10	000725	京东方 A	9,349,405.00	52.53
11	002475	立讯精密	9,272,662.60	52.10
12	600584	长电科技	9,127,842.91	51.29
13	300073	当升科技	9,026,589.91	50.72
14	300677	英科医疗	8,990,086.00	50.51
15	300136	信维通信	8,330,025.58	46.81
16	603659	璞泰来	7,769,537.39	43.66
17	002216	三全食品	7,421,640.64	41.70
18	000636	风华高科	7,300,539.00	41.02
19	600438	通威股份	7,151,476.08	40.18
20	601012	隆基股份	7,097,471.15	39.88
21	600460	士兰微	7,000,248.20	39.33
22	300750	宁德时代	6,296,238.00	35.38
23	300502	新易盛	6,224,018.00	34.97
24	600183	生益科技	6,204,230.00	34.86
25	601865	福莱特	6,021,593.22	33.83
26	600887	伊利股份	5,991,165.00	33.66
27	603630	拉芳家化	5,883,690.00	33.06
28	002866	传艺科技	5,853,898.00	32.89
29	300415	伊之密	5,762,928.00	32.38
30	002384	东山精密	5,632,982.00	31.65
31	000910	大亚圣象	5,414,750.24	30.43

32	601318	中国平安	5,320,734.00	29.90
33	603626	科森科技	5,186,758.20	29.14
34	603678	火炬电子	5,097,360.00	28.64
35	002726	龙大肉食	4,542,068.88	25.52
36	300568	星源材质	4,465,039.00	25.09
37	300232	洲明科技	4,422,695.00	24.85
38	300450	先导智能	4,273,079.00	24.01
39	300068	南都电源	4,225,884.00	23.74
40	600276	恒瑞医药	4,166,569.00	23.41
41	000100	TCL 科技	4,044,860.00	22.73
42	002434	万里扬	3,951,745.14	22.20
43	688298	东方生物	3,925,965.27	22.06
44	603986	兆易创新	3,923,745.00	22.05
45	002938	鹏鼎控股	3,909,573.00	21.97
46	600004	白云机场	3,860,380.00	21.69
47	600267	海正药业	3,852,221.00	21.65
48	002027	分众传媒	3,816,181.00	21.44
49	600586	金晶科技	3,791,205.00	21.30
50	300671	富满电子	3,677,867.00	20.67
51	002206	海利得	3,600,242.00	20.23
52	300572	安车检测	3,400,484.00	19.11
53	002702	海欣食品	3,069,855.00	17.25
54	688006	杭可科技	2,996,376.14	16.84
55	300015	爱尔眼科	2,633,596.00	14.80
56	002008	大族激光	2,457,342.00	13.81
57	300014	亿纬锂能	2,404,953.00	13.51
58	000425	徐工机械	2,386,629.00	13.41
59	300168	万达信息	2,379,464.27	13.37
60	002080	中材科技	2,261,196.00	12.71
61	603019	中科曙光	2,157,963.00	12.13
62	300122	智飞生物	2,105,730.00	11.83
63	688311	盟升电子	1,941,212.96	10.91
64	600029	南方航空	1,939,892.00	10.90
65	000977	浪潮信息	1,924,268.00	10.81
66	603538	美诺华	1,899,555.00	10.67
67	002049	紫光国微	1,873,533.00	10.53

68	688388	嘉元科技	1,853,706.58	10.42
69	300676	华大基因	1,825,106.00	10.26
70	600763	通策医疗	1,817,102.00	10.21
71	002970	锐明技术	1,769,568.00	9.94
72	603127	昭衍新药	1,738,019.00	9.77
73	300438	鹏辉能源	1,723,243.50	9.68
74	002551	尚荣医疗	1,651,293.00	9.28
75	603679	华体科技	1,651,094.00	9.28
76	603890	春秋电子	1,541,574.20	8.66
77	600867	通化东宝	1,508,671.00	8.48
78	002019	亿帆医药	1,470,172.00	8.26
79	002607	中公教育	1,447,958.00	8.14
80	300363	博腾股份	1,421,526.00	7.99
81	603259	药明康德	1,302,298.00	7.32
82	002959	小熊电器	1,266,660.00	7.12
83	002371	北方华创	1,255,919.00	7.06
84	300294	博雅生物	1,247,854.00	7.01
85	688106	金宏气体	1,170,856.15	6.58
86	601336	新华保险	1,144,638.00	6.43
87	000538	云南白药	1,056,528.00	5.94
88	300347	泰格医药	1,054,384.00	5.92
89	300078	思创医惠	1,027,125.00	5.77
90	300274	阳光电源	985,461.00	5.54
91	300188	美亚柏科	959,260.00	5.39
92	300725	药石科技	952,859.28	5.35
93	002368	太极股份	933,329.00	5.24
94	603383	顶点软件	920,743.44	5.17
95	300639	凯普生物	879,949.00	4.94
96	000661	长春高新	875,213.00	4.92
97	002481	双塔食品	856,157.00	4.81
98	600196	复星医药	854,340.00	4.80
99	603486	科沃斯	837,941.11	4.71
100	600446	金证股份	829,126.00	4.66
101	603612	索通发展	790,736.00	4.44
102	601231	环旭电子	764,912.18	4.30
103	300806	斯迪克	738,655.00	4.15

104	601615	明阳智能	738,644.00	4.15
105	600436	片仔癀	729,293.00	4.10
106	300482	万孚生物	723,990.00	4.07
107	300207	欣旺达	723,031.00	4.06
108	002798	帝欧家居	722,068.00	4.06
109	300357	我武生物	709,561.00	3.99
110	000951	中国重汽	704,570.00	3.96
111	002918	蒙娜丽莎	693,854.00	3.90
112	000858	五粮液	691,370.00	3.88
113	300035	中科电气	653,703.00	3.67
114	300776	帝尔激光	647,530.00	3.64
115	002876	三利谱	647,105.00	3.64
116	601186	中国铁建	644,780.09	3.62
117	300212	易华录	639,641.00	3.59
118	300244	迪安诊断	638,813.00	3.59
119	300182	捷成股份	633,871.00	3.56
120	002459	晶澳科技	606,057.00	3.41
121	002897	意华股份	602,630.00	3.39
122	603185	上机数控	598,186.00	3.36
123	300763	锦浪科技	590,923.00	3.32
124	300010	豆神教育	576,899.00	3.24
125	600872	中炬高新	555,816.00	3.12
126	000401	冀东水泥	544,997.00	3.06
127	000063	中兴通讯	543,089.00	3.05
128	300308	中际旭创	512,758.00	2.88
129	002405	四维图新	511,350.00	2.87
130	300227	光韵达	504,578.00	2.84
131	688005	容百科技	502,607.81	2.82
132	002463	沪电股份	475,770.00	2.67
133	603208	江山欧派	466,424.00	2.62
134	603993	洛阳钼业	406,553.00	2.28
135	002185	华天科技	403,305.00	2.27
136	300033	同花顺	392,667.00	2.21
137	300759	康龙化成	377,315.00	2.12
138	300314	戴维医疗	357,803.00	2.01

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。

8.4.2 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	002241	歌尔股份	12,245,369.02	68.81
2	300433	蓝思科技	10,007,318.09	56.23
3	300476	胜宏科技	9,895,048.41	55.60
4	000725	京东方 A	9,876,260.10	55.49
5	002429	兆驰股份	8,924,038.85	50.14
6	600438	通威股份	8,885,198.66	49.93
7	300677	英科医疗	8,572,488.32	48.17
8	601012	隆基股份	8,229,564.83	46.24
9	603659	璞泰来	8,209,620.43	46.13
10	002216	三全食品	8,195,264.77	46.05
11	300740	御家汇	7,715,113.79	43.35
12	300296	利亚德	7,261,217.59	40.80
13	300750	宁德时代	7,227,696.30	40.61
14	300415	伊之密	7,051,207.80	39.62
15	002475	立讯精密	6,982,258.42	39.23
16	000636	风华高科	6,538,713.22	36.74
17	300136	信维通信	6,481,220.50	36.42
18	600584	长电科技	5,972,245.79	33.56
19	000910	大亚圣象	5,661,066.06	31.81
20	002866	传艺科技	5,586,184.35	31.39
21	002384	东山精密	5,496,372.01	30.88
22	300502	新易盛	5,365,265.54	30.15
23	603630	拉芳家化	5,270,172.68	29.61
24	603626	科森科技	5,113,772.25	28.73
25	300450	先导智能	4,697,252.64	26.39
26	603236	移远通信	4,228,351.06	23.76
27	000425	徐工机械	4,127,293.09	23.19
28	000100	TCL 科技	4,073,859.12	22.89
29	002434	万里扬	3,995,002.52	22.45
30	300068	南都电源	3,784,023.00	21.26
31	002206	海利得	3,707,621.13	20.83
32	600004	白云机场	3,694,852.00	20.76

33	002726	龙大肉食	3,604,267.90	20.25
34	002938	鹏鼎控股	3,514,637.02	19.75
35	000977	浪潮信息	3,294,224.90	18.51
36	300073	当升科技	3,144,529.24	17.67
37	688006	杭可科技	3,003,465.52	16.88
38	300671	富满电子	2,926,876.63	16.45
39	300015	爱尔眼科	2,826,714.84	15.88
40	002008	大族激光	2,769,743.37	15.56
41	002702	海欣食品	2,731,018.80	15.35
42	300014	亿纬锂能	2,424,198.20	13.62
43	300168	万达信息	2,404,485.50	13.51
44	603019	中科曙光	2,267,328.68	12.74
45	300122	智飞生物	2,196,905.01	12.34
46	300363	博腾股份	2,185,040.36	12.28
47	300676	华大基因	2,163,261.39	12.16
48	600763	通策医疗	2,043,300.68	11.48
49	600029	南方航空	1,900,825.00	10.68
50	002049	紫光国微	1,887,841.73	10.61
51	603127	昭衍新药	1,850,475.61	10.40
52	603890	春秋电子	1,844,837.27	10.37
53	603538	美诺华	1,844,105.00	10.36
54	002607	中公教育	1,828,158.55	10.27
55	002970	锐明技术	1,824,258.10	10.25
56	600887	伊利股份	1,665,388.59	9.36
57	300438	鹏辉能源	1,650,764.52	9.28
58	002930	宏川智慧	1,607,540.44	9.03
59	002551	尚荣医疗	1,596,194.80	8.97
60	603679	华体科技	1,584,441.59	8.90
61	600867	通化东宝	1,569,122.08	8.82
62	000661	长春高新	1,562,720.12	8.78
63	002019	亿帆医药	1,544,993.58	8.68
64	603259	药明康德	1,525,987.84	8.57
65	600585	海螺水泥	1,512,287.40	8.50
66	688388	嘉元科技	1,477,972.90	8.30
67	300572	安车检测	1,473,392.00	8.28
68	601318	中国平安	1,444,877.00	8.12
69	002959	小熊电器	1,400,419.45	7.87
70	002123	梦网集团	1,390,327.66	7.81

71	002798	帝欧家居	1,331,280.00	7.48
72	603208	江山欧派	1,305,600.14	7.34
73	600183	生益科技	1,283,390.29	7.21
74	300568	星源材质	1,275,134.40	7.16
75	600196	复星医药	1,273,212.31	7.15
76	300347	泰格医药	1,180,695.91	6.63
77	002850	科达利	1,160,241.68	6.52
78	601336	新华保险	1,153,350.00	6.48
79	300294	博雅生物	1,126,530.68	6.33
80	002463	沪电股份	1,099,305.65	6.18
81	300602	飞荣达	1,082,765.78	6.08
82	300725	药石科技	1,080,367.18	6.07
83	603486	科沃斯	1,041,318.83	5.85
84	300188	美亚柏科	980,424.00	5.51
85	000538	云南白药	977,313.62	5.49
86	300751	迈为股份	964,881.29	5.42
87	600436	片仔癀	953,929.80	5.36
88	002368	太极股份	921,769.99	5.18
89	600446	金证股份	910,624.00	5.12
90	300078	思创医惠	900,351.00	5.06
91	300639	凯普生物	891,696.60	5.01
92	300207	欣旺达	883,011.34	4.96
93	300274	阳光电源	870,417.85	4.89
94	603383	顶点软件	860,447.70	4.83
95	601231	环旭电子	854,370.08	4.80
96	002481	双塔食品	838,779.47	4.71
97	601138	工业富联	817,434.29	4.59
98	300806	斯迪克	812,393.40	4.56
99	002918	蒙娜丽莎	803,538.02	4.52
100	300482	万孚生物	796,970.89	4.48
101	300763	锦浪科技	775,291.32	4.36
102	000951	中国重汽	769,015.40	4.32
103	300035	中科电气	752,427.00	4.23
104	601615	明阳智能	746,026.63	4.19
105	000858	五粮液	705,599.24	3.96
106	300357	我武生物	705,228.24	3.96
107	300244	迪安诊断	687,197.52	3.86
108	000671	阳光城	682,248.00	3.83

109	603612	索通发展	657,283.58	3.69
110	601186	中国铁建	629,340.00	3.54
111	000063	中兴通讯	629,237.64	3.54
112	300776	帝尔激光	625,910.00	3.52
113	002876	三利谱	623,387.74	3.50
114	603185	上机数控	602,733.63	3.39
115	300182	捷成股份	592,416.98	3.33
116	002897	意华股份	586,011.75	3.29
117	002459	晶澳科技	554,196.50	3.11
118	600872	中炬高新	548,818.00	3.08
119	600340	华夏幸福	541,944.00	3.05
120	002832	比音勒芬	538,097.76	3.02
121	300010	豆神教育	534,263.21	3.00
122	002507	涪陵榨菜	530,243.00	2.98
123	000401	冀东水泥	515,864.00	2.90
124	300308	中际旭创	515,064.00	2.89
125	300227	光韵达	465,636.06	2.62
126	688005	容百科技	456,938.70	2.57
127	002185	华天科技	452,133.19	2.54
128	603993	洛阳钼业	438,064.00	2.46
129	002405	四维图新	430,650.00	2.42
130	002596	海南瑞泽	406,334.97	2.28
131	300033	同花顺	404,570.00	2.27
132	600276	恒瑞医药	403,782.89	2.27
133	300759	康龙化成	377,412.00	2.12

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。

8.4.3 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	446,992,419.87
卖出股票收入（成交）总额	346,447,054.92

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。

8.5 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	7,399,260.00	5.67
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	7,399,260.00	5.67

8.6 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	019627	20 国债 01	74,000	7,399,260.00	5.67

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	102,315.03
2	应收证券清算款	2,062,659.49
3	应收股利	—
4	应收利息	162,859.37
5	应收申购款	56,701.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,384,535.33

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中未有存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,163	83,656.59	74,181,502.02	76.25%	23,111,111.07	23.75%
金 信 价 值 精 选 混合 C	2,050	5,585.37	995,400.90	8.69%	10,454,612.19	91.31%
合计	3,213	33,844.58	75,176,902.92	69.13%	33,565,723.26	30.87%

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。

9.2 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	—	—
	金信价值精选混合 C	660,252.50	5.7700%
	合计	660,252.50	0.6100%

分类基金中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。

9.3 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的情况

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
	金信价值精选混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开	金信价值精选混合 A	—

放式基金	金信价值精选混合 C	—
	合计	—

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

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，本项不适用。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金基金合同成立于 2017 年 9 月 1 日，截止本报告期末基金合同成立已超过三年，无发起式资金持有份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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 9 月 1 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	12,531,527.15	10,289,918.04
本报告期基金总申购份额	104,882,581.28	88,303,589.24
减:本报告期基金总赎回份额	20,121,495.34	87,143,494.19
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	97,292,613.09	11,450,013.09

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人 2020 年 4 月 28 日公告，督察长段卓立先生因个人原因于 2020 年 4 月 27 日离任，由公司总经理殷克胜先生任代督察长。

本基金管理人 2020 年 9 月 16 日公告，副总经理邵若昊先生因个人原因于 2020 年 9 月 14 日离任。

本基金管理人 2020 年 9 月 26 日公告，金信基金管理有限公司自 2020 年 9 月 25 日起聘任王几高先生为公司督察长，新任督察长任职之日起，本公司总经理殷克胜先生不再代任督察长一职。

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。

11.3 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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 4 年。本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 30,000 元。

11.6 管理人、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，深圳证监局对我司进行了检查并对公司和相关人员出具了监管措施。我司已按照法律法规和监管要求及时完成整改。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
安信证券	2	526,060,257.25	66.40%	374,164.03	66.40%	—
万联证券	1	155,874,225.60	19.67%	110,873.42	19.67%	—
光大证券	2	110,184,588.31	13.91%	78,373.11	13.91%	—
太平洋证券	2	177,360.00	0.02%	126.17	0.02%	—

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

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，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资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评价，并根据评价的结果按制度经相关部门及公司领导审核后选择席位：

- 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。

11.7.2 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	
	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
安信证券	10,536,595.50	100.00%	630,400,000.00	77.52%	—	—
万联证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	182,800,000.00	22.48%	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—

11.8 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	金信基金管理有限公司旗下 11 只基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 1 月 21 日
2	金信基金管理有限公司修改旗下 11 只证券投资基金基金合同的公告	公司网站、中国证券报	2020 年 3 月 12 日
3	金信基金管理有限公司修改旗下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公告	公司网站、中国证券报	2020 年 3 月 17 日
4	金信基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 3 月 25 日
5	金信基金管理有限公司旗下 12 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 4 月 21 日
6	金信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 4 月 28 日
7	金信基金管理有限公司关于变更客服热线的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 5 月 14 日
8	金信基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	公司网站	2020 年 6 月 17 日
9	金信基金管理有限公司旗下 12 只基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 7 月 21 日
10	金信基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的澄清声明	公司网站	2020 年 8 月 13 日
11	金信基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的补充澄清声明	公司网站	2020 年 8 月 26 日
12	金信基金管理有限公司旗下 12 只基金 2020 年中期报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 8 月 26 日
13	金信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 9 月 16 日
14	金信基金管理有限公司督察长变更公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券	2020 年 9 月 26 日

		日报、上海证券报	
15	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2020 年 10 月 28 日
16	金信基金管理有限公司关于个别媒体发布不实信息的澄清声明	公司网站	2020 年 11 月 14 日
17	关于金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 12 日
18	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 4 次更新）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 16 日
19	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（A 份额）产品资料概要更新（2020 年第 2 号）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 16 日
20	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（C 份额）产品资料概要更新（2020 年第 2 号）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 16 日
21	关于金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 18 日
22	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 5 次更新）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 18 日
23	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（A 份额）产品资料概要更新（2020 年第 3 号）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 18 日
24	金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（C 份额）产品资料概要更新（2020 年第 3 号）	公司网站、中国证券报	2020 年 12 月 18 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200901-20201231	0.00	49,312,895.54	0.00	49,312,895.54	45.35%
	2	20200901-20200908	0.00	40,700,040.70	40,700,040.70	0.00	0.00%
	3	20200824-20200831, 20200909-20201231	0.00	24,868,606.48	0.00	24,868,606.48	22.87%
个人	1	20200101-20200823	5,000,000.00	0.00	0.00	5,000,000.00	4.60%
	2	20200115-20200819	4,000,227.39	0.00	0.00	4,000,227.39	3.68%

产品特有风险

1、大额赎回风险

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：

（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；

（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；

（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；

（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；

（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。

2、大额申购风险

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

金信基金管理有限公司

2021 年 3 月 29 日