# 金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 半年度报告摘要

2019年6月30日

**基金管理人:金信基金管理有限公司**
**基金托管人:广州农村商业银行股份有限公司**
**送出日期:2019年8月24日**

### §1 重要提示

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。本半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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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2019年1月1日起至6月30日止。

### §2 基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 金信多策略精选混合 |
| 基金主代码 | 004223 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年6月8日 |
| 基金管理人 | 金信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 广州农村商业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 112,466,009.95份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争为基金份额持有人创造收益和长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要有以下六个方面:<br>1、资产配置策略<br>本基金将综合分析各方面因素,通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况的分析,进行资产配置及组合的构建。并根据各类资产风险收益特征的相对变化,动态调整各资产类别的投资比例。<br>2、股票投资策略<br>在不同市场环境下,本基金将灵活运用成长、主题、定向增发、动量等多种投资策略。<br>3、固定收益类投资策略<br>本基金将在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。<br>4、资产支持证券投资策略<br>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、提前偿还率等多种影响资产支持证券定价的基本面因素,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。<br>5、衍生品投资策略<br>1)股指期货和国债期货投资策略<br>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和国债期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。<br>2)权证投资策略<br>本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。<br>6、中小企业私募债投资策略<br>本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系,对个券进行信用分析,在信用风险可控的前提下,追求合理回报。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。 |

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 | 广州农村商业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段卓立 | 卿苗 |
| | 联系电话 | 0755-82510502 | 020-28019512 |
| | 电子邮箱 | jubao@jxfunds.com.cn | qingmiao@grcbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-866-2866 | 95313 |
| 传真 | | 0755-82510305 | 020-28019340 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jxfunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室 |

### §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

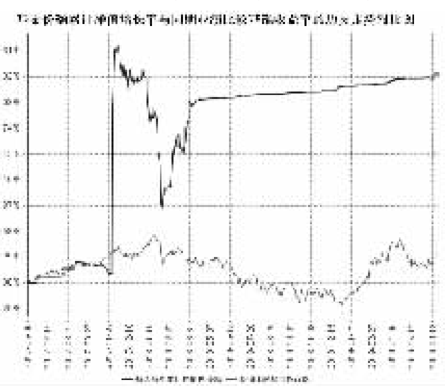
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 14,986,799.02 |
| 本期利润 | 14,257,504.12 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0180 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.44% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0215 |
| 期末基金资产净值 | 117,783,942.28 |
| 期末基金份额净值 | 1.0473 |

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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.76% | 0.12% | 3.16% | 0.65% | -2.40% | -0.53% |
| 过去三个月 | 1.58% | 0.08% | -0.33% | 0.84% | 1.91% | -0.76% |
| 过去六个月 | 2.44% | 0.06% | 15.80% | 0.85% | -13.36% | -0.79% |
| 过去一年 | 4.15% | 0.05% | 7.07% | 0.84% | -2.92% | -0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.18% | 2.17% | 8.22% | 0.69% | 50.96% | 1.48% |

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



### §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管理资产规模超过58.91亿元,旗下管理11只开放式公募基金和12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 | | |
| 唐雷 | 本基金基金经理 | 2017年6月8日 | - | 12 | 武汉大学物理学理学学士、北京大学光华管理学院工商管理硕士。先后任职于民生加银基金、安信证券资产管理部。现担任金信基金基金经理。 |

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,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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》、《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《金信多策略精选灵活配置混合型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,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的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

2019年初债券市场在央行降准1个百分点的刺激下继续上涨。随后PMI数据和社融、贷款数据超市场预期,去杠杆政策开始加码,债券市场出现明显调整。5月初央行对中小银行实施较低存款准备金率,债券市场开始好转。包商银行事件后部分结构化资管产品回购违约、中小银行存单发行困难,央行力保资金面整体充裕,推动债券市场继续上涨。

我们主要投资高等级银行存单,增强组合流动性;同时精选个券,降低组合信用风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0473元;本报告期基金份额净值增长率为2.44%,业绩比较基准收益率为15.80%。

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3季度,全球经济存在放缓压力,美联储未来降息概率较高,全球或将进入降息潮。国内经济下行压力较大,制造业投资受制于贸易战前景不明、盈利下滑;房地产政策难见放松迹象;基建托底程度有限。中美贸易战持续反复,且向科技、金融等领域扩散,出口受到制约。包商银行事件打破同业刚兑,未来中小银行同业业务将逐步收缩,信用分层加剧。中美十年期国债利率上半年走势分化明显,国债利差从年初的51BP上行至6月底的123BP。如美联储降息,国内货币政策将获得更高的主动性,预计未来国内资金面状况总体偏宽裕。

未来我们将采取灵活的大类资产配置策略,通过把握不同市场的阶段性机会来提升组合收益。

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,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的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,投资者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。若投资者不选择,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,本基金于2019年2月1日实施2019年第1次收益分配,以2019年1月29日可分配收益为基准,每10份基金份额派发红利0.5200元;本基金于2019年3月4日实施2019年第2次收益分配,以2019年2月27日可分配收益为基准,每10份基金份额派发红利0.3360元.

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,未出现对本基金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:广州农村商业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

广州农村商业银行根据法律法规、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。

广州农村商业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。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、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:金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 39,850,184.58 | 4,408,434.04 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 72,068.49 | 34,420.06 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 60,007,000.00 | 965,377,800.00 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 60,007,000.00 | 965,377,800.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 21,560,250.78 | 259,921,549.89 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,744,973.07 | 10,377,609.02 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 50,718.93 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 123,234,476.92 | 1,240,170,531.94 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 5,017,268.01 | 198,433,473.56 |
| 应付管理人报酬 | | 202,383.77 | 4,310,488.63 |
| 应付托管费 | | 20,238.41 | 431,048.84 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 101,995.40 | 84,897.18 |
| 应交税费 | | 0.97 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 108,648.08 | 282,592.92 |
| 负债合计 | | 5,450,534.64 | 203,542,501.13 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 112,466,009.95 | 935,804,655.35 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 5,317,932.33 | 100,823,375.46 |
| 所有者权益合计 | | 117,783,942.28 | 1,036,628,030.81 |
| 负债和所有者权益总计 | | 123,234,476.92 | 1,240,170,531.94 |

注:截止2019年6月30日,本基金份额净值1.0473元,基金份额总额112,466,009.95份。

6.2利润表

会计主体:金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 21,948,622.96 | 5,196,788.18 |
| 1.利息收入 | | 15,231,184.67 | 3,638,993.29 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 120,094.83 | 24,146.28 |
| 债券利息收入 | | 10,849,162.10 | 3,242,767.73 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,261,927.74 | 372,079.28 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 302,744.64 | -23,816.31 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,119,799.00 | 34,018.22 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -1,099,608.42 | -57,834.53 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 282,554.06 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 6.4.7.17 | -729,294.90 | 1,575,948.53 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 6.4.7.18 | 7,143,988.55 | 5,662.67 |
| 减:二、费用 | | 7,691,118.84 | 1,607,070.48 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,412,391.33 | 1,217,244.41 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 641,239.18 | 121,724.42 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.19 | 172,438.68 | 8,593.84 |
| 5.利息支出 | | 350,404.09 | 249,947.05 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 350,404.09 | 249,947.05 |
| 6.税金及附加 | | 0.90 | - |
| 7.其他费用 | 6.4.7.20 | 114,644.66 | 9,560.76 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 14,257,504.12 | 3,589,717.70 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 14,257,504.12 | 3,589,717.70 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30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) | 935,804,655.35 | 100,823,375.46 | 1,036,628,030.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 14,257,504.12 | 14,257,504.12 |
| 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) | -823,338,645.40 | 29,125,919.80 | -794,212,725.60 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,230,950,136.00 | 120,726,197.32 | 1,351,676,333.32 |
| 2.基金赎回款 | -2,054,288,781.40 | -91,600,277.52 | -2,145,889,058.92 |
| 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) | - | -138,888,867.05 | -138,888,867.05 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 112,466,009.95 | 5,317,932.33 | 117,783,942.28 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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) | 161,188.27 | 92,207.74 | 253,396.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 3,589,717.70 | 3,589,717.70 |
| 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) | 708,190,836.23 | 370,404,927.95 | 1,078,595,764.18 |
| 其中:1.基金申购款 | 708,725,800.84 | 370,680,896.39 | 1,079,406,697.23 |
| 2.基金赎回款 | -534,964.61 | -275,968.44 | -810,933.05 |
| 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) | - | -49,573,251.26 | -49,573,251.26 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 708,352,024.50 | 324,513,602.13 | 1,032,865,626.63 |

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:

______段克胜______ ______段克胜______ ____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

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金(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]2228号《关于准予金信多策略精选灵活配置混合型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《金信多策略精选灵活配置混合型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200,094,534.92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609号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年6月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,109,781.27份基金份额,其中认购资金利息折合15,246.35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,基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信多策略精选灵活配置混合型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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、次级债、中心企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、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。本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

6.4.2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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金信多策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

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

根据财政部、国家税务总局财税[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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 广州农村商业银行股份有限公司("广州农商行") | 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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易,无佣金产生。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,412,391.33 | 1,217,244.41 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 1,319,735.63 | 277,453.05 |

注:支付基金管理人金信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 641,239.18 | 121,724.42 |

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2017年6月8日)持有的基金份额 | 98,835.23 | 98,835.23 |
| 期初持有的基金份额 | 14,551,371.58 | 129,205.81 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 6,564,469.54 |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 4,780,000.00 | - |
| 期末持有的基金份额 | 9,771,371.58 | 6,693,675.35 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 8.6883% | 0.9450% |

6.4.8.4.2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。

6.4.8.5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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 广州农村商业银行 | 39,850,184.58 | 58,498.98 | 956,291.34 | 23,028.68 |

注:本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6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。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额76,000,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10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2019年6月30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二层次的余额为60,007,000.00元,无属于第一、第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 。

(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。

### §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(%) |
|---|---|---|---|
| 3 | 固定收益投资 | 60,007,000.00 | 48.69 |
| | 其中:债券 | 60,007,000.00 | 48.69 |
| 6 | 买入返售金融资产 | 21,560,250.78 | 17.50 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,850,184.58 | 32.34 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,817,041.56 | 1.47 |
| 9 | 合计 | 123,234,476.92 | 100.00 |

7.2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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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前十名股票投资明细

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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 | 601857 | 中国石油 | 2,359,611.00 | 0.23 |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 2,359,590.00 | 0.23 |
| 3 | 600019 | 宝钢股份 | 2,349,265.00 | 0.23 |
| 4 | 601766 | 中国中车 | 2,348,959.00 | 0.23 |
| 5 | 601006 | 大秦铁路 | 2,348,707.00 | 0.23 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 2,348,014.00 | 0.23 |
| 7 | 600104 | 上汽集团 | 2,347,843.00 | 0.23 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 2,309,963.00 | 0.22 |
| 9 | 600016 | 民生银行 | 2,309,940.00 | 0.22 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 2,309,868.00 | 0.22 |
| 11 | 601818 | 光大银行 | 2,309,868.00 | 0.22 |
| 12 | 601939 | 建设银行 | 2,309,850.00 | 0.22 |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 2,309,845.00 | 0.22 |
| 14 | 601988 | 中国银行 | 2,309,824.00 | 0.22 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 2,309,777.00 | 0.22 |
| 16 | 601398 | 工商银行 | 2,309,760.00 | 0.22 |
| 17 | 601800 | 中国交建 | 2,309,757.00 | 0.22 |
| 18 | 601390 | 中国中铁 | 2,309,743.00 | 0.22 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 2,309,688.00 | 0.22 |
| 20 | 601088 | 中国神华 | 2,309,640.00 | 0.22 |

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 | 600547 | 山东黄金 | 2,554,584.00 | 0.25 |
| 2 | 601601 | 中国太保 | 2,496,322.00 | 0.24 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 2,429,875.00 | 0.23 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 2,428,252.00 | 0.23 |
| 5 | 601939 | 建设银行 | 2,405,430.00 | 0.23 |
| 6 | 600028 | 中国石化 | 2,404,825.00 | 0.23 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 2,393,090.00 | 0.23 |
| 8 | 600104 | 上汽集团 | 2,380,451.00 | 0.23 |
| 9 | 600019 | 宝钢股份 | 2,380,300.00 | 0.23 |
| 10 | 601229 | 上海银行 | 2,377,254.00 | 0.23 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 2,373,116.00 | 0.23 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 2,370,932.00 | 0.23 |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 2,362,536.00 | 0.23 |
| 14 | 600016 | 民生银行 | 2,361,600.00 | 0.23 |
| 15 | 601818 | 光大银行 | 2,356,532.00 | 0.23 |
| 16 | 601766 | 中国中车 | 2,354,976.00 | 0.23 |
| 17 | 601988 | 中国银行 | 2,353,056.00 | 0.23 |
| 18 | 601169 | 北京银行 | 2,345,260.00 | 0.23 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 2,337,830.00 | 0.23 |
| 20 | 601857 | 中国石油 | 2,323,248.00 | 0.22 |

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 | 60,345,256.00 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 61,465,055.00 |

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 | 9,992,000.00 | 8.48 |
| 3 | 金融债券 | 50,015,000.00 | 42.46 |
| | 其中:政策性金融债 | 50,015,000.00 | 42.46 |
| 10 | 合计 | 60,007,000.00 | 50.95 |

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 | 180209 | 18国开09 | 500,000 | 50,015,000.00 | 42.46 |
| 2 | 019611 | 19国债01 | 100,000 | 9,992,000.00 | 8.48 |

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前十名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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2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。

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

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

本基金在进行国债期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合国债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国债期货的收益性、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。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金报告期末未持有国债期货合约。

7.12投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2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。

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 | 72,068.49 |
| 4 | 应收利息 | 1,744,973.07 |
| 9 | 合计 | 1,817,041.56 |

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

### §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

| 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 |
| 763 | 147,399.75 | 109,771,371.58 | 97.60% | 2,694,638.37 | 2.40% |

注: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期末上市基金前十名持有人

本基金未申请场内上市交易。

8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 63.13 | 0.0000% |

8.4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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

### §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2017年6月8日)基金份额总额 | 200,109,781.27 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 935,804,655.35 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 1,230,950,136.00 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 2,054,288,781.40 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 112,466,009.95 |

### §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、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

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

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受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 | |
| 长江证券 | 2 | 121,810,311.00 | 100.00% | 86,642.53 | 100.00% | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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

a、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

b、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;

c、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

d、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

公司投资、研究部门定期对券商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部门意见,经公司领导审核后选择交易单元:

a、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;

b、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;

c、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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 |
| 长江证券 | 231,822,142.65 | 100.00% | 180,083,000.00 | 100.00% | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019.01.09-2019.03.25 | 0.00 | 720,979,632.30 | 720,979,632.30 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 2019.04.01-2019.04.01 | 145,842,489.06 | 0.00 | 145,842,489.06 | 0.00 | 0.00% |
| | 3 | 2019.01.07-2019.01.07 | 157,989,572.64 | 0.00 | 57,989,572.64 | 100,000,000.00 | 88.92% |
| | 3 | 2019.04.01-2019.06.30 | 157,989,572.64 | 0.00 | 57,989,572.64 | 100,000,000.00 | 88.92% |
| | 4 | 2019.01.01-2019.01.09 | 467,539,330.77 | 0.00 | 467,539,330.77 | 0.00 | 0.00% |
| | 4 | 2019.03.11-2019.04.08 | 467,539,330.77 | 0.00 | 467,539,330.77 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| | | | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 1、大额赎回风险<br>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:<br>(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;<br>(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;<br>(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;<br>(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;<br>(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。<br>2、大额申购风险<br>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。 | | | | | | | |

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

金信基金管理有限公司
2019年8月24日