金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

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：2019年3月26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2019年3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2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	12,209,175.51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	9,977,056.69份	2,232,118.82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，并将依据经济周期所处阶段，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综合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 本基金以权证的市场价值分析为基础，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，构建最优分析体系，对国债期货和现货的流动性、波动水平、基差、持有成本、收益率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。

金信价值精选混合A	金信价值精选混合C

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	段卓立	陆志俊
	联系电话	0755-82510502	95559
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	huzq@bankcomm.com
客户服务电话		400-866-2866	95559
传真		0755-82510305	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§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	2018年		2017年9月1日(基金合同生效日)-2017年12月31日		2016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	-3,704,392.60	-620,194.32	-646,729.81	-82,884.52	-	-
本期利润	-3,669,647.95	-590,937.74	-792,491.90	-102,368.30	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2939	-0.3735	-0.0876	-0.0882	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.4833	-0.4809	-0.0875	-0.0878	-	-
期末基金资产净值	5,154,969.03	1,158,726.72	8,271,662.66	1,116,505.13	-	-
期末基金份额净值	0.5167	0.5191	0.9125	0.9122	-	-

注：1.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；

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

3.期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

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

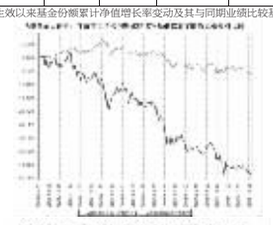
金信价值精选混合A

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	-19.70%	2.04%	-4.94%	0.82%	-14.76%	1.22%
过去六个月	-22.15%	1.70%	-5.16%	0.74%	-16.99%	0.96%
过去一年	-43.38%	1.72%	-8.59%	0.67%	-34.79%	1.05%
自基金合同生效起至今	-48.33%	1.61%	-6.57%	0.60%	-41.76%	1.01%

金信价值精选混合C

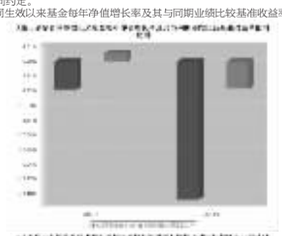
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.38%	2.04%	-4.94%	0.82%	-14.44%	1.22%
过去六个月	-21.76%	1.70%	-5.16%	0.74%	-16.60%	0.96%
过去一年	-43.09%	1.72%	-8.59%	0.67%	-34.50%	1.05%
自基金合同生效起至今	-48.09%	1.61%	-6.57%	0.60%	-41.52%	1.01%

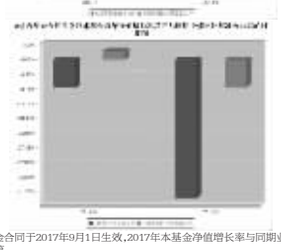
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的基金合同于2017年9月1日生效，建仓期为自基金合同生效之日起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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





注：本基金的基金合同于2017年9月1日生效，截至2018年12月31日，本基金成立未满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管理资产规模超过48.06亿元，旗下管理10只开放式基金和12只专户理财投资组合。

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		
刘格俊	本基金基金经理	2017年9月1日	2018年12月28日	16	男，北京大学经济学士，中国科学院金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于招商基金、景顺长城基金、英大证券资产管理部。现任金信基金投资决策委员会委员、基金经理。
吴清宇	本基金基金经理	2018年12月28日	-	7	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。

4.2 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，以及投权、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。

4.3.3 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，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

2018年A股震荡下跌，上证指数下跌-24.59%，沪深300指数下跌-25.32%，创业板指数下跌-28.65%，市场整体偏弱。中国经济在去杠杆、中美贸易摩擦、棚改货币化退出等因素的影响下GDP增速也在逐季下滑，其中不达预期和业绩下滑的股票在弱市中跌幅较大。本基金上半年股票仓位变化不大，股票配置相对均衡，重点关注估值合理、业绩稳定增长的公司。

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0.5167元，本报告期基金份额净值增长率为-43.38%；截至本报告期末金信价值精选混合C基金份额净值为0.5191元，本报告期基金份额净值增长率为-43.09%；同期业绩比较基准收益率为-8.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年第4季度以来，市场经历了先跌反弹再收跌的过程，宏观面上经济仍然延续了2018年以来的下跌压力，PMI、社融等数据进一步走低。但值得注意的是，此次中央高层对经济的下滑引起了足够的关注。从国务院常务会议到中央经济工作会议，均对托底经济进行了充分的讨论及部署，预计后续有望出台减税、降费以及增加财政支出等方式进行对冲。我们认为自2018年以来的这一波下跌是典型的由于经济基本面恶化导致的下跌，因此后续军允跌回稳的行业亦有望出现在中央迎周期调节的行业或者本身周期与经济不相关的行业中。根据这一逻辑，我们看好特高压、5G、光伏、轨交、基建、养猪等行业，对此，本基金在2018年末也进行了相关板块与个股的调整。

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。

本基金未报告期内，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收益分配基准日每份基金份额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相应类别的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；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于基金费用的不同，本基金各类基金份额在可供分配利润上有所不同，本基金同一类别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，报告期本基金无利润分配事项。

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

本基金为发起式基金，截至2018年12月31日，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金净值的限制性条款暂不适用本基金。

§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

2018年度，基金托管人在金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年度，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

2018年度，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(2019)第20072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	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“金信价值精选混合基金”）的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018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。 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”)发布的有关规定及在财务会计专业实务操作指南，公允反映了金信价值精选混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018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	金信价值精选混合基金的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基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，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	陈麟 陈薇薇
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2019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：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	71,794.61	612,996.52
结算备付金		100,794.67	151,189.71
存出保证金		6,680.76	6,058.16
交易性金融资产	7.4.7.2	3,988,138.13	6,990,064.45
其中：股票投资		3,636,598.13	6,990,064.45
基金投资		-	-
债券投资		351,540.00	-
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	2,100,000.00	1,700,000.00
应收证券清算款		129,522.49	-
应收利息	7.4.7.5	9,703.91	-907.14
应收股利		-	-
应收申购款		10,379.68	4,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,417,014.25	9,463,401.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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		-	9,054.52
应付赎回款		9,559.24	-
应付管理人报酬		5,498.33	7,990.80
应付托管费		824.77	1,198.62
应付销售服务费		101.22	92.47
应付交易费用	7.4.7.7	7,334.94	10,177.50
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	80,000.00	46,720.00
负债合计		103,318.50	75,233.91
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	12,209,175.51	10,289,247.35
未分配利润	7.4.7.10	-5,895,479.76	-901,079.56
所有者权益合计		6,313,695.75	9,388,167.79
负债和所有者权益合计		6,417,014.25	9,463,401.70

注：1.报告截止日2018年12月31日，基金份额总额12,209,175.51份，其中金信价值精选混合型发起式证券投资基金A类份额9,977,056.69份，基金份额净值0.5167元；金信价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金C类份额2,232,118.82份，基金份额净值0.5191元。

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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入		-4,017,116.79	-770,312.66
1.利息收入		36,448.20	21,769.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,688.53	2,342.67
债券利息收入		5,512.61	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,247.06	19,426.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,133,366.22	-627,002.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,174,345.27	-631,802.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	520.00	-
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	-	-
股利收益	7.4.7.16	40,459.05	4,800.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	64,001.23	-165,245.87
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	15,800.00	166.33
减:二、费用		243,468.90	124,547.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	76,076.78	32,600.52
2. 托管费	7.4.10.2.2	11,411.61	4,890.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,069.45	370.31
4. 交易费用	7.4.7.19	74,024.68	39,246.62
5. 利息支出		16.38	-
其中：卖出回购金融资产支出		16.38	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	80,870.00	47,440.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,260,585.69	-894,860.20
减:所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,260,585.69	-894,860.20

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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	10,289,247.35	-901,079.56	9,388,167.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,260,585.69	-4,260,585.69
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）	1,919,928.16	-733,814.51	1,186,113.65
其中：1.基金申购款	6,490,598.98	-2,550,237.17	3,940,361.81
2.基金赎回款	-4,570,670.82	1,816,422.66	-2,754,248.16
五、期末所有者权益（基金净值）	12,209,175.51	-5,895,479.76	6,313,695.75

项目	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017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）	10,101,332.16	-	10,101,332.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-894,860.20	-894,860.20
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）	187,915.19	-6,219.36	181,695.83
其中：1.基金申购款	239,758.44	-7,889.89	231,868.55
2.基金赎回款	-51,843.25	1,670.53	-50,172.72
五、期末所有者权益（基金净值）	10,289,247.35	-901,079.56	9,388,167.79

注：本报告期内及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：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的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	76,076.78	32,600.52
其中：支付销售机构的客户维护费	2,160.86	145.72

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1.00%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 × 1.00%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,411.61	4,890.09

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 × 0.15%/ 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018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	-	776.16	776.16
合计	-	776.16	776.16

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017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	-	351.56	351.56
合计	-	351.56	351.56

注：支付基金销售机构的C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给金信基金，再由金信基金计算并支付给各基金销售机构。本基金A类基金份额不计提销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金资产净值 X 0.10%/ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2018年1月1日至2018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	-	100,000.00
期初持有的基金份额	-	100,000.00
期末持有的基金份额	-	100,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.82%

项目	上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017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	-	100,000.00
期初持有的基金份额	-	100,000.00
期末持有的基金份额	-	100,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.97%

7.4.8.4.2 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

注：于本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年9月1日(基金合同生效日)至2017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	71,794.61	1,747.30	612,996.52	1,651.20

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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余额。

7.4.10 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2018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3,636,598.13元，属于第二层次余额为351,540.00元，无属于第三层次的余额。(2017年12月31日：第一层次6,042,145.25元，属于第二层次的余额为947,919.20元，无属于第三层次的余额)。

(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2018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(2017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