

创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2017年03月27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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。

本报告期自2016年08月30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 | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 | 13 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 16 |
| 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 | 16 |
| §6 审计报告 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 16 |
| §7 年度财务报表 | 18 |
| 7.1 资产负债表 | 18 |
| 7.2 利润表 | 19 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 21 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| §8 投资组合报告 | 46 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 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 | 47 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 51 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 52 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 53 |
| §9 基金份额持有人信息 | 53 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| 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情况 | 54 |
| §10 开放式基金份额变动 | 55 |

| | |
|----------------------------------|----|
| §11 重大事件揭示 | 55 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 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 | 56 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 56 |
| 11.8 其他重大事件 | 56 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| §13 备查文件目录 | 57 |
| 13.1 备查文件目录 | 57 |
| 13.2 存放地点 | 57 |
| 13.3 查阅方式 | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|----------------------|------------|
| 基金名称 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 创金合信鑫价值混合 | |
| 基金主代码 | 003232 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年08月30日 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 800,107,977.84份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003232 | 003233 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 800,087,177.47份 | 20,800.37份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 追求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在资产配置过程中采取"自上而下"的分析框架,基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法,综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素,形成各资产类别预期收益与预期风险的判断,并进而确定股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将采取"自上而下"的行业策略与"自下而上"的公司研究相结合的方式,构建股票组合。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30%+一年期人民币定期存款利率(税后)×70% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基 |

| | | |
|---------------|--|--|
| | 金。 | |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

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 | | 创金合信基金管理有限公司 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 梁绍锋 | 田东辉 |
| | 联系电话 | 0755-23838908 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | liangshaofeng@cjhxfund.com | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-0666 | 95580 |
| 传真 | | 0755-25832571 | 010-68858120 |
| 注册地址 | | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1号A栋201 室 | 北京市西城区金融大街 3号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 | 北京市西城区金融大街 3号A座 |
| 邮政编码 | | 518000 | 100808 |
| 法定代表人 | | 刘学民 | 李国华 |

2.4 信息披露方式

| | |
|-----------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址 | www.cjhxfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 |

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号普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 创金合信基金管理有限公司 | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼 |

§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 | 2016年08月30日-2016年 12月31日 | 2016年08月30日-2016年 12月31日 |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C |
| 本期已实现收益 | 3,636,282.42 | 80.97 |
| 本期利润 | -6,090,574.93 | -171.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0076 | -0.0083 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.76% | -0.83% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.80% | -0.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2016年末 |
| 期末可供分配利润 | -6,090,570.23 | -171.79 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0076 | -0.0083 |
| 期末基金资产净值 | 793,996,607.24 | 20,628.58 |
| 期末基金份额净值 | 0.992 | 0.992 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016年末 | 2016年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.80% | -0.80% |

注：1.上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.期末可供分配利润是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。

4.本基金合同生效日为2016年8月30日，截至报告期末，本基金成立不满一年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

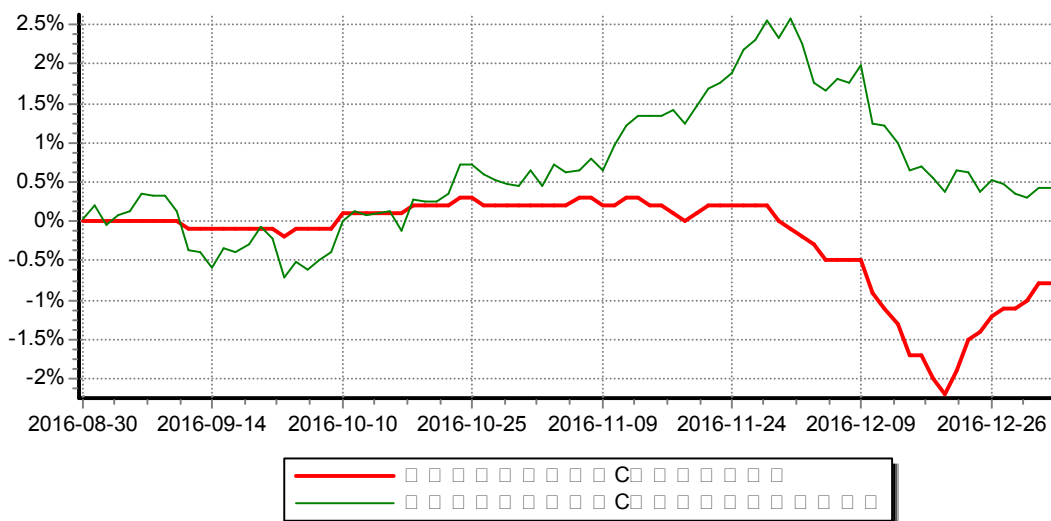
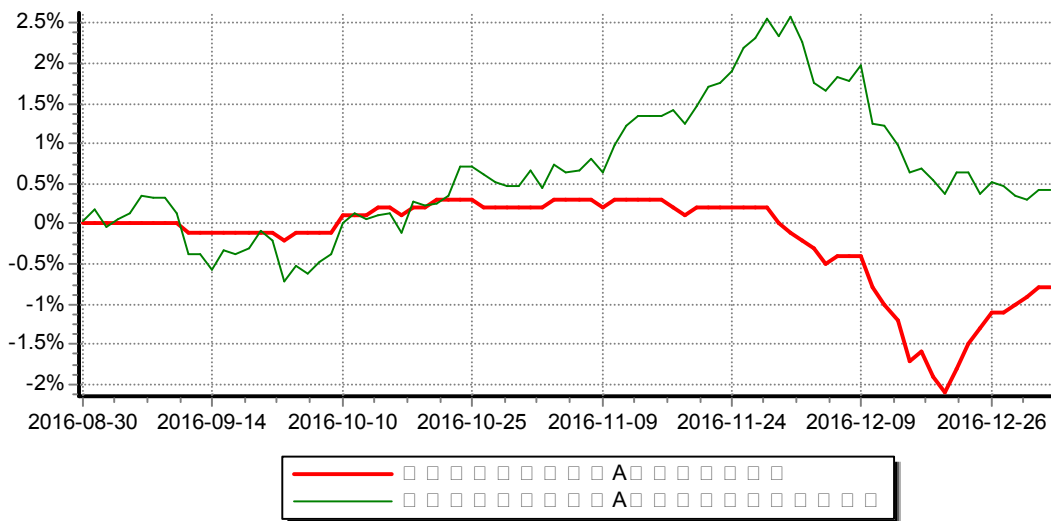
3.2 基金净值表现

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

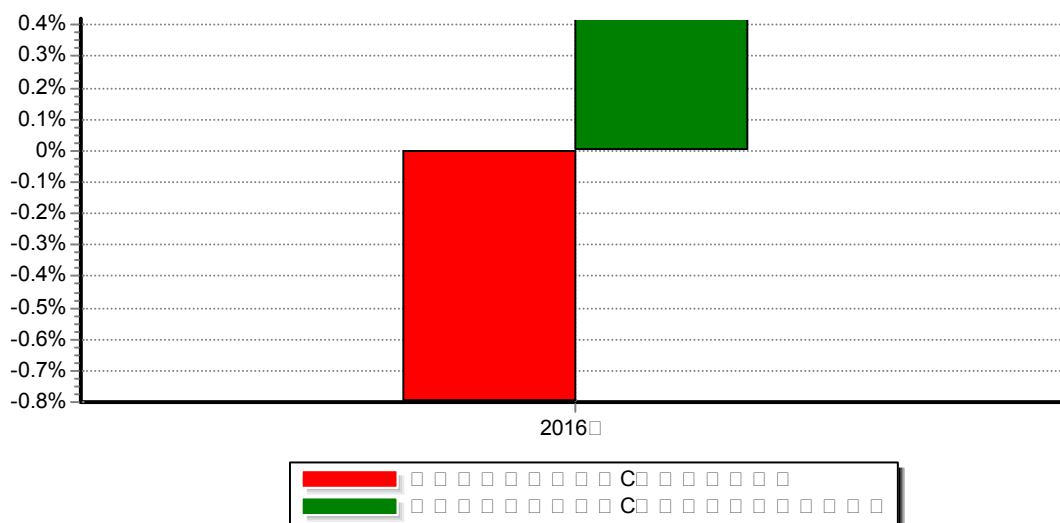
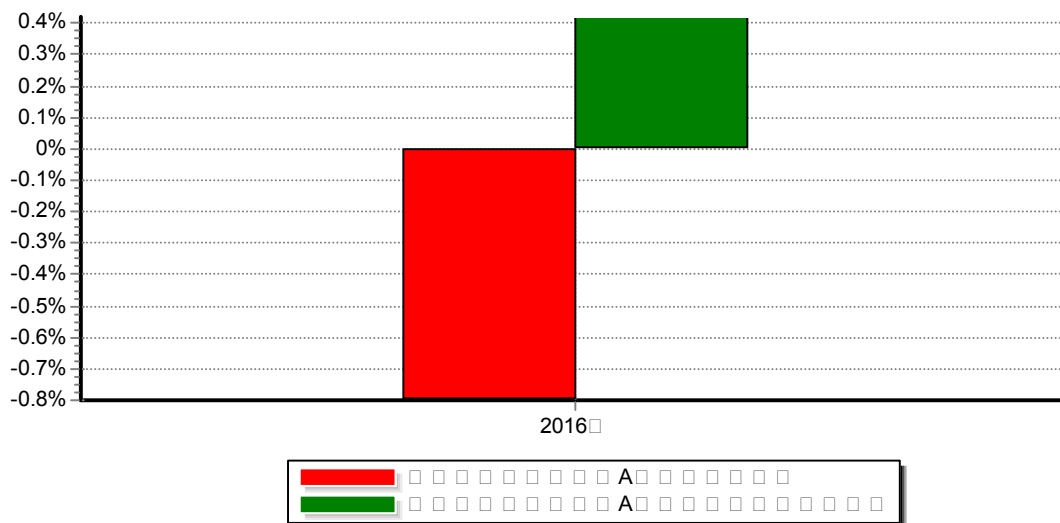
| 阶段 (创金合信鑫价值混合A) | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|--------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.70% | 0.14% | 0.82% | 0.21% | -1.52% | -0.07% |
| 自基金合同生效日起至今(2016年08月30日-2016年12月31日) | -0.80% | 0.12% | 0.42% | 0.21% | -1.22% | -0.09% |

| 阶段 (创金合信鑫价值混合C) | 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 | -0.70% | 0.14% | 0.82% | 0.21% | -1.52% | -0.07% |
| 自基金合同生效日起至今(2016年08月30日-2016年12月31日) | -0.80% | 0.12% | 0.42% | 0.21% | -1.22% | -0.09% |

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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2016年8月30日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投

资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行17只公募基金。截至2016年12月31日，本公司共管理24只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品8只、股票型产品3只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约142.74亿元。

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 | | |
| 张荣 | 基金经理 | 2016年08月30日 | — | 6 | 张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下，把握行业趋势；2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。 |
| 闫一帆 | 基金经理 | 2016年09月20日 | — | 7 | 闫一帆先生，中国国籍，新加坡南洋理工大学金融学硕士。2008年7月就职于国泰君安证券股份有限公司。2011年5月加入永安财产保险股份有限公司投资管理中心任固定收益研究员，2012年10月加入第一创业证券股份有限公司资产管理部任固定收益 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 研究员，负责债券类组合的债券信用研究、组合投资管理等工作。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，历任信用研究主管、投资经理，负责固定收益研究、债券组合管理等工作，现任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内

幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段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投资组合，切实防范利益输送。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差、反向交易进行了专项分析，未发现异常交易情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年成为2014年以来债牛的末期，并在年底开始扭转走熊。主要变化因素在于：第一，2016年经济整体走平，步入L型的底部阶段，而同时大宗商品价格暴涨、以房价为首的资产价格暴涨；第二，5月9日《人民日报》刊登了《开局首季问大势》的权威人士讲话，正式确认了宏观政策从稳增长向防风险、抑泡沫重心转换；第三，在经济走稳、通胀预期抬升的基础上，为防风险、抑泡沫，货币政策最终在下半年开始通过公开市场释放长期限资金，抬升利率水平，并实施将理财纳入MPA考核等宏观审慎措施。在上述因素变化下，同时叠加了流动性危机，年底债市收益率大幅上行，幅度普遍在100-150bp。在债券市场极度紧张时期，央行及时释放流动性，守住系统性风险不发生的底线。2016年本基金采取稳健投资策略，在防范风险的同时为投资者赚取更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年，自基金合同生效日起至报告期末，本基金A类净值增长率为-0.80%，C类净值增长率为-0.80%，同期业绩比较基准增长率为0.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前来看，货币政策可能进一步收紧，但大幅收紧的可能性需要密切关注经济。主要原因在于：第一，防风险、抑泡沫仍是当前货币政策的目标重点，也因此存在进一步收紧的可能；第二，从目前来看，房地产价格的泡沫程度得到初步控制，一二线热点城市房价环比涨幅持续回落，而债市、汇市、股市等领域的泡沫程度不显著，同时表外理财扩张也受到宏观审慎评估体系（简称MPA）约束，因此央行就风险泡沫大幅收紧的必要性还不是很大；第三，年初信贷放量的持续性将是需要密切关注的。如果是实体经济需求强劲所致，那么通胀压力将会较大，货币政策的收紧力度有可能会超出预期。在货币政策收缩的过程中，债券市场难以出现趋势性机会，而在政策步入紧缩后期和经济下行压力重现之前，长债的交易机会也不会明显。经过去年底及今年初的大幅调整，债市总体收益率水平已处于较高的位置，尤其是高评级的配置价值仍是可行的，再度急剧上升的风险不显著。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，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。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。修订完善《信息披露制度》等制度，建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、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

本基金管理人严格按照企业会计准则、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。

本基金管理人在风险控制办公会下设立估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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(2017)第22104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 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"创金合信鑫价值混合基金")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是创金合信鑫价值混合基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和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财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)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。</p> |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和</p> |

| | |
|-----------|---|
| | 作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。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。 |
| 审计意见段 | 我们认为，上述创金合信鑫价值混合基金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，公允反映了创金合信鑫价值混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 曹翠丽 边晓红 |
| 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） |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼 |
| 审计报告日期 | 2017-03-23 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 23,455,763.09 |
| 结算备付金 | | 1,781,727.68 |
| 存出保证金 | | 140,828.89 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,002,919,804.78 |
| 其中：股票投资 | | 45,132,804.78 |
| 基金投资 | | — |
| 债券投资 | | 957,787,000.00 |

| | | |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 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 | | 6,353,206.42 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 20,849,406.38 |
| 应收股利 | | — |
| 应收申购款 | | — |
| 递延所得税资产 | | — |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | — |
| 资产总计 | | 1,055,500,737.24 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016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 | | 260,288,889.56 |
| 应付证券清算款 | | 144,421.25 |
| 应付赎回款 | | — |
| 应付管理人报酬 | | 402,796.77 |
| 应付托管费 | | 134,265.60 |
| 应付销售服务费 | | 3.41 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 194,131.60 |
| 应交税费 | | — |
| 应付利息 | | 190,993.23 |
| 应付利润 | | — |
| 递延所得税负债 | | — |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 128,000.00 |
| 负债合计 | | 261,483,501.42 |
| 所有者权益： | | |

| | | |
|------------|----------|------------------|
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 800,107,977.84 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -6,090,742.02 |
| 所有者权益合计 | | 794,017,235.82 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,055,500,737.24 |

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额总额800,107,977.84份，其中下属A类基金份额800,087,177.47份，C类基金份额20,800.37份。下属A类基金份额净值0.992元，C类基金份额净值0.992元。

2.本财务报表的实际报告期间为2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年08月30日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|------------------|----------|-------------------------------|
| 一、收入 | | -2,250,105.54 |
| 1.利息收入 | | 9,315,366.44 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 494,826.47 |
| 债券利息收入 | | 8,367,659.20 |
| 资产支持证券利息收入 | | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 452,880.77 |
| 其他利息收入 | | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -1,838,364.12 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 1,387,669.49 |
| 基金投资收益 | | — |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -3,314,112.11 |
| 资产支持证券投资收益 | | — |

| | | |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 贵金属投资收益 | | — |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | — |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 88,078.50 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -9,727,110.11 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | — |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 2.25 |
| 减：二、费用 | | 3,840,641.18 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,610,721.39 |
| 2. 托管费 | | 536,907.18 |
| 3. 销售服务费 | | 13.53 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 350,094.99 |
| 5. 利息支出 | | 1,214,504.09 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,214,504.09 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 128,400.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -6,090,746.72 |
| 减：所得税费用 | | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -6,090,746.72 |

注：本财务报表的实际编制报告期间为2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年08月30日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016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） | 800,108,876.94 | — | 800,108,876.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | -6,090,746.72 | -6,090,746.72 |
| 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） | -899.10 | 4.70 | -894.40 |
| 其中：1.基金申购款 | — | — | — |
| 2.基金赎回款 | -899.10 | 4.70 | -894.40 |
| 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） | 800,107,977.84 | -6,090,742.02 | 794,017,235.82 |

注：本财务报表的实际报告期间为2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

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

创金合信鑫价值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[2015]1933号《关于准予创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]1424号《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准，由创金合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《创金合信鑫价值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800,052,876.11元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1129号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为800,108,876.94份基金份额，其中认购资金利息折合56,000.83份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称"中国邮政储蓄银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×30%+一年期人民币定期存款利率(税后)×70%。

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》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年8月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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2016年12月31日的财务状况以及2016年8月30日(基金合同生效日)至2016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

2016年8月30日(基金合同生效日)至2016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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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确认。

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确认，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

本基金的收益分配政策为：1、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；2、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；3、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；4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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[2008]38号《关于进一步规范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)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。
- (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。

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 2016年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 23,455,763.09 |
| 定期存款 | — |
| 其中：存款期限1-3个月 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 23,455,763.09 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2016年12月31日 | | |
|---------------|------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 48,491,752.75 | 45,132,804.78 | -3,358,947.97 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — |
| 债券 | 交易所市场 | 50,258,626.03 | 49,460,000.00 |
| | 银行间市场 | 913,896,536.11 | 908,327,000.00 |
| | 合计 | 964,155,162.14 | 957,787,000.00 |
| 资产支持证券 | — | — | — |
| 基金 | — | — | — |
| 其他 | — | — | — |
| 合计 | 1,012,646,914.89 | 1,002,919,804.78 | -9,727,110.11 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期末未持有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2016年12月31日 |
|------------|----------------|
| 应收活期存款利息 | 3,099.95 |
| 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 | 881.98 |
| 应收债券利息 | 20,845,354.71 |
| 应收买入返售证券利息 | — |

| | |
|------------|---------------|
| 应收申购款利息 | — |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | 69.74 |
| 合计 | 20,849,406.38 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2016年12月31日 |
|-------------|----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 163,157.20 |
| 银行间市场应付交易费用 | 30,974.40 |
| 合计 | 194,131.60 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2016年12月31日 |
|-------------|----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | — |
| 预提费用 | 128,000.00 |
| 合计 | 128,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫价值混合A) | 本期2016年08月30日至2016年12月31日 | |
|--------------------|---------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 800,088,076.57 | 800,088,076.57 |
| 本期申购 | — | — |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -899.10 | -899.10 |
| 本期末 | 800,087,177.47 | 800,087,177.47 |
| 项目 | 基金份额(份) | 账面金额 |

| (创金合信鑫价值混合C) | | |
|---------------|-----------|-----------|
| 基金合同生效日 | 20,800.37 | 20,800.37 |
| 本期申购 | — | — |
| 本期赎回(以“-”号填列) | — | — |
| 本期末 | 20,800.37 | 20,800.37 |

注：1.申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

2. 本基金自2016年8月22日至2016年8月24日止期间公开发售，共募集有效净认购资金800,052,876.10元，其中A类基金募集有效净认购资金为800,032,076.10元，C类基金募集有效净认购资金为20,800.00元。根据《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入56,000.83元在本基金成立后，折算为56,000.83份基金份额(其中A类基金募集期内认购资金产生的利息收入为56,000.46元，折算为56,000.46份基金份额，C类基金募集期内认购资金产生的利息收入为0.37元，折算为0.37份基金份额)，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫价值 混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日 | — | — | — |
| 本期利润 | 3,636,282.42 | -9,726,857.35 | -6,090,574.93 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6.85 | 11.55 | 4.70 |
| 其中：基金申购款 | — | — | — |
| 基金赎回款 | -6.85 | 11.55 | 4.70 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 3,636,275.57 | -9,726,845.80 | -6,090,570.23 |

单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫价值 混合C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|-------|-------|---------|
| | | | |

| | | | |
|----------------|-------|---------|---------|
| 基金合同生效日 | — | — | — |
| 本期利润 | 80.97 | -252.76 | -171.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | — | — | — |
| 其中：基金申购款 | — | — | — |
| 基金赎回款 | — | — | — |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 80.97 | -252.76 | -171.79 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 176,257.90 |
| 定期存款利息收入 | 298,958.33 |
| 其他存款利息收入 | — |
| 结算备付金利息收入 | 19,304.51 |
| 其他 | 305.73 |
| 合计 | 494,826.47 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
| 股票投资收益——买卖股票 差价收入 | 1,387,669.49 |
| 股票投资收益——赎回差价 收入 | — |
| 股票投资收益——申购差价 | — |

| | |
|----|--------------|
| 收入 | |
| 合计 | 1,387,669.49 |

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2016年08月30日至2016年12月31日 |
|------------|---------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 111,687,759.28 |
| 减：卖出股票成本总额 | 110,300,089.79 |
| 买卖股票差价收入 | 1,387,669.49 |

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 2016年08月30日至2016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 | -3,314,112.11 |
| 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 | -3,314,112.11 |

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 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 959,947,717.20 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 951,248,200.65 |
| 减：应收利息总额 | 12,013,628.66 |

| | |
|----------|---------------|
| 买卖债券差价收入 | -3,314,112.11 |
|----------|---------------|

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 88,078.50 |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 88,078.50 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -9,727,110.11 |
| ——股票投资 | -3,358,947.97 |
| ——债券投资 | -6,368,162.14 |
| ——资产支持证券投资 | — |
| ——基金投资 | — |
| ——贵金属投资 | — |
| ——其他 | — |
| 2.衍生工具 | — |
| ——权证投资 | — |
| 3.其他 | — |
| 合计 | -9,727,110.11 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|---------|-------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2.25 |
| 合计 | 2.25 |

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 331,269.99 |
| 银行间市场交易费用 | 18,825.00 |
| 合计 | 350,094.99 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
| 审计费用 | 86,000.00 |
| 信息披露费 | 33,000.00 |
| 帐户维护费 | 9,400.00 |
| 合计 | 128,400.00 |

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，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------|
| 创金合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 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮政储蓄银行”) | 基金托管人 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东 |

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 | |
|--------|-------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 269,715,519.33 | 100.00% |

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 | | | |
|-------|-------------------------------|-------|--------|--------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金 | 期末应付佣金 | 占期末应付佣 |

| | | 总量的比例 | 余额 | 金总额的比例 |
|--------|------------|---------|------------|---------|
| 第一创业证券 | 195,513.85 | 100.00% | 163,157.20 | 100.00% |

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 | |
|--------|-------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 142,711,369.50 | 100.00% |

7.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年08月30日至2016年12月31日 | |
|--------|-------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 3,288,000,000.00 | 100.00% |

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 2016年08月30日至2016年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,610,721.39 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 41.53 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 536,907.18 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，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 | | |
|----------------|-------------------------|------------|------|
| | 2016年08月30日至2016年12月31日 | | |
| | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C | 合计 |
| 创金合信 | — | 1.23 | 1.23 |
| 合计 | - | 1.23 | 1.23 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2016年08月30日至2016年12月31日 | |
|------------------|-------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国邮政储蓄 银行活期存款 | 23,455,763.09 | 176,257.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016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 |
| 601375 | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 新股流通受限 | 4.00 | 4.00 | 26,695 | 106,780.00 | 106,780.00 |
| 3005 | 万里 | 2016-12- | 2017- | 新股流通 | 3.07 | 3.07 | 2,396 | 7,355.72 | 7,355.72 |

| | | | | | | | | | |
|----|---|----|-------|----|--|--|--|--|--|
| 91 | 马 | 30 | 01-10 | 受限 | | | | | |
|----|---|----|-------|----|--|--|--|--|--|

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|------------|
| 000166 | 申万宏源 | 2016-12-21 | 重大事项停牌 | 6.25 | 2017-01-26 | 6.29 | 150,000 | 972,000.00 | 937,500.00 |
| 000750 | 国海证券 | 2016-12-15 | 重大事项停牌 | 6.97 | 2017-01-20 | 6.27 | 130,000 | 1,014,000.00 | 906,100.00 |
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大事项停牌 | 14.60 | | | 57,000 | 991,800.00 | 832,200.00 |

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2016年12月31日止，本基金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260,288,889.56元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|-----------|-------------|------------|--------|---------|---------------|
| 101454027 | 14大唐集MTN001 | 2017-01-03 | 103.85 | 300,000 | 31,155,000.00 |
| 101551038 | 15联通MTN001 | 2017-01-03 | 100.36 | 400,000 | 40,144,000.00 |
| 101558018 | 15陕延油MTN002 | 2017-01-03 | 99.87 | 300,000 | 29,961,000.00 |
| 101565003 | 15粤海MTN001 | 2017-01-03 | 102.36 | 10,000 | 1,023,600.00 |

| | | | | | |
|-----------|-------------------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 101554029 | 15穗地 铁 MTN00 1 | 2017-01-04 | 101.71 | 200,000 | 20,342,000.00 |
| 101558024 | 15华润 药 MTN00 1 | 2017-01-04 | 101.28 | 200,000 | 20,256,000.00 |
| 101565003 | 15粤海 MTN00 1 | 2017-01-04 | 102.36 | 170,000 | 17,401,200.00 |
| 140225 | 14国开 25 | 2017-01-04 | 100.77 | 400,000 | 40,308,000.00 |
| 1382048 | 13宁城 建 MTN2 | 2017-01-05 | 101.96 | 150,000 | 15,294,000.00 |
| 1382059 | 13闽投 MTN1 | 2017-01-05 | 102.30 | 500,000 | 51,150,000.00 |
| 合计 | | | | 2,630,000 | 267,034,800.00 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行邮储银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2016年12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA | 762,014,000.00 |
| AAA以下 | 18,789,000.00 |
| 未评级 | 176,984,000.00 |
| 合计 | 957,787,000.00 |

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末2016年 12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------|-------------------|------|------|-----|-------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 23,455,763. 09 | | | | 23,455,763. 09 |
| 结算备付金 | 1,781,727.6 8 | | | | 1,781,727.6 8 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 存出保证金 | 140,828.89 | | | | 140,828.89 |
| 交易性金融资产 | 40,308,000.00 | 780,803,000.00 | 136,676,000.00 | 45,132,804.78 | 1,002,919,804.78 |
| 应收证券清算款 | — | | | 6,353,206.42 | 6,353,206.42 |
| 应收利息 | — | | | 20,849,406.38 | 20,849,406.38 |
| 资产总计 | 65,686,319.66 | 780,803,000.00 | 136,676,000.00 | 72,335,417.58 | 1,055,500,737.24 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 260,288,889.56 | | | | 260,288,889.56 |
| 应付证券清算款 | — | | | 144,421.25 | 144,421.25 |
| 应付管理人报酬 | — | | | 402,796.77 | 402,796.77 |
| 应付托管费 | — | | | 134,265.60 | 134,265.60 |
| 应付销售服务费 | — | | | 3.41 | 3.41 |
| 应付交易费用 | — | | | 194,131.60 | 194,131.60 |
| 应付利息 | — | | | 190,993.23 | 190,993.23 |
| 其他负债 | — | | | 128,000.00 | 128,000.00 |
| 负债总计 | 260,288,889.56 | — | — | 1,194,611.86 | 261,483,501.42 |
| 利率敏感度缺口 | 194,602,569.90 | 780,803,000.00 | 136,676,000.00 | 71,140,805.72 | 794,017,235.82 |

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

| | | |
|----|--------------------|----------------|
| 假设 | 除市场利率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 2016年12月31日 |
| | 市场利率上升25个基点 | -6,370,181.48 |
| | 市场利率下降25个基点 | 6,464,164.32 |

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%。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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 |
|----|--------------------|
| | |

| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产-股票投资 | 45,132,804.78 | 5.68 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — |
| 其他 | — | — |
| 合计 | 45,132,804.78 | 5.68 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为5.68%，因此除市场利率以外的其它市场价格因素对于本基金资产净值无重大影响。

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2016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42,342,869.06元，属于第二层次的余额为960,576,935.72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

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2016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。

(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 | 45,132,804.78 | 4.28 |
| | 其中：股票 | 45,132,804.78 | 4.28 |
| 2 | 固定收益投资 | 957,787,000.00 | 90.74 |
| | 其中：债券 | 957,787,000.00 | 90.74 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 25,237,490.77 | 2.39 |
| 7 | 其他各项资产 | 27,343,441.69 | 2.59 |
| 8 | 合计 | 1,055,500,737.24 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 | 873,000.00 | 0.11 |
| C | 制造业 | 8,157,416.58 | 1.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 2,591,402.23 | 0.33 |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 961,400.00 | 0.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,197,560.00 | 0.28 |
| J | 金融业 | 25,303,624.51 | 3.19 |
| K | 房地产业 | 2,279,080.00 | 0.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 228,291.46 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 973,000.00 | 0.12 |
| 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 | 1,568,030.00 | 0.20 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 45,132,804.78 | 5.68 |

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 | 002673 | 西部证券 | 100,000 | 2,077,000.00 | 0.26 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 650,000 | 2,015,000.00 | 0.25 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 3 | 002594 | 比亚迪 | 35,000 | 1,738,800.00 | 0.22 |
| 4 | 002739 | 万达院线 | 29,000 | 1,568,030.00 | 0.20 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 92,000 | 1,477,520.00 | 0.19 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 50,000 | 1,388,500.00 | 0.17 |
| 7 | 002736 | 国信证券 | 87,000 | 1,352,850.00 | 0.17 |
| 8 | 000895 | 双汇发展 | 64,000 | 1,339,520.00 | 0.17 |
| 9 | 600340 | 华夏幸福 | 56,000 | 1,338,400.00 | 0.17 |
| 10 | 601688 | 华泰证券 | 74,000 | 1,321,640.00 | 0.17 |
| 11 | 000776 | 广发证券 | 78,000 | 1,315,080.00 | 0.17 |
| 12 | 601198 | 东兴证券 | 65,000 | 1,303,900.00 | 0.16 |
| 13 | 300059 | 东方财富 | 72,000 | 1,218,960.00 | 0.15 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 116,000 | 1,027,760.00 | 0.13 |
| 15 | 600398 | 海澜之家 | 95,000 | 1,025,050.00 | 0.13 |
| 16 | 601669 | 中国电建 | 140,000 | 1,016,400.00 | 0.13 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 230,000 | 1,014,300.00 | 0.13 |
| 18 | 600999 | 招商证券 | 62,000 | 1,012,460.00 | 0.13 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 110,000 | 1,001,000.00 | 0.13 |
| 20 | 600061 | 国投安信 | 64,000 | 999,040.00 | 0.13 |
| 21 | 600111 | 北方稀土 | 81,000 | 993,870.00 | 0.13 |
| 22 | 601318 | 中国平安 | 28,000 | 992,040.00 | 0.12 |
| 23 | 002304 | 洋河股份 | 14,000 | 988,400.00 | 0.12 |
| 24 | 601939 | 建设银行 | 180,000 | 979,200.00 | 0.12 |
| 25 | 600637 | 东方明珠 | 42,000 | 978,600.00 | 0.12 |
| 26 | 000069 | 华侨城 A | 140,000 | 973,000.00 | 0.12 |
| 27 | 601018 | 宁波港 | 190,000 | 961,400.00 | 0.12 |
| 28 | 002415 | 海康威视 | 40,000 | 952,400.00 | 0.12 |
| 29 | 600606 | 绿地控股 | 108,000 | 940,680.00 | 0.12 |
| 30 | 000166 | 申万宏源 | 150,000 | 937,500.00 | 0.12 |
| 31 | 600705 | 中航资本 | 150,000 | 918,000.00 | 0.12 |
| 32 | 601901 | 方正证券 | 120,000 | 912,000.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 33 | 000750 | 国海证券 | 130,000 | 906,100.00 | 0.11 |
| 34 | 601225 | 陕西煤业 | 180,000 | 873,000.00 | 0.11 |
| 35 | 600485 | 信威集团 | 57,000 | 832,200.00 | 0.10 |
| 36 | 601328 | 交通银行 | 96,000 | 553,920.00 | 0.07 |
| 37 | 600837 | 海通证券 | 35,000 | 551,250.00 | 0.07 |
| 38 | 600000 | 浦发银行 | 34,000 | 551,140.00 | 0.07 |
| 39 | 601818 | 光大银行 | 140,000 | 547,400.00 | 0.07 |
| 40 | 601377 | 兴业证券 | 71,000 | 543,150.00 | 0.07 |
| 41 | 601800 | 中国交建 | 35,000 | 531,650.00 | 0.07 |
| 42 | 601788 | 光大证券 | 32,949 | 526,854.51 | 0.07 |
| 43 | 002027 | 分众传媒 | 15,998 | 228,291.46 | 0.03 |
| 44 | 601375 | 中原证券 | 26,695 | 106,780.00 | 0.01 |
| 45 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641 | 88,403.48 | 0.01 |
| 46 | 603218 | 日月股份 | 1,652 | 68,805.80 | 0.01 |
| 47 | 603416 | 信捷电气 | 1,076 | 53,886.08 | 0.01 |
| 48 | 603886 | 元祖股份 | 2,241 | 39,665.70 | — |
| 49 | 603239 | 浙江仙通 | 924 | 29,059.80 | — |
| 50 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | — |
| 51 | 300591 | 万里马 | 2,396 | 7,355.72 | — |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 22,060,700.00 | 2.78 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 20,980,600.00 | 2.64 |
| 3 | 002673 | 西部证券 | 2,998,000.00 | 0.38 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 2,508,000.00 | 0.32 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 2,504,700.00 | 0.32 |
| 6 | 002739 | 万达院线 | 2,502,280.00 | 0.32 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7 | 002027 | 分众传媒 | 2,250,669.20 | 0.28 |
| 8 | 002736 | 国信证券 | 2,185,250.00 | 0.28 |
| 9 | 600606 | 绿地控股 | 2,044,700.00 | 0.26 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 2,028,700.00 | 0.26 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 2,008,000.00 | 0.25 |
| 12 | 002594 | 比亚迪 | 1,998,420.00 | 0.25 |
| 13 | 002500 | 山西证券 | 1,997,931.00 | 0.25 |
| 14 | 002236 | 大华股份 | 1,988,000.00 | 0.25 |
| 15 | 601901 | 方正证券 | 1,579,910.00 | 0.20 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 1,561,100.00 | 0.20 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 1,556,740.00 | 0.20 |
| 18 | 600111 | 北方稀土 | 1,554,280.00 | 0.20 |
| 19 | 601669 | 中国电建 | 1,551,692.00 | 0.20 |
| 20 | 600398 | 海澜之家 | 1,548,500.00 | 0.20 |

注：本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 21,079,800.00 | 2.65 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 20,040,800.00 | 2.52 |
| 3 | 002027 | 分众传媒 | 2,114,240.00 | 0.27 |
| 4 | 002236 | 大华股份 | 1,971,670.00 | 0.25 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 1,723,450.00 | 0.22 |
| 6 | 002500 | 山西证券 | 1,668,775.00 | 0.21 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 1,590,950.00 | 0.20 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 1,520,400.00 | 0.19 |
| 9 | 300070 | 碧水源 | 1,489,420.00 | 0.19 |
| 10 | 000686 | 东北证券 | 1,340,700.00 | 0.17 |
| 11 | 000728 | 国元证券 | 1,300,000.00 | 0.16 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 000783 | 长江证券 | 1,297,340.00 | 0.16 |
| 13 | 601211 | 国泰君安 | 1,148,193.00 | 0.14 |
| 14 | 601628 | 中国人寿 | 1,145,400.00 | 0.14 |
| 15 | 601111 | 中国国航 | 1,117,160.00 | 0.14 |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 1,100,000.00 | 0.14 |
| 17 | 600886 | 国投电力 | 1,090,490.00 | 0.14 |
| 18 | 600958 | 东方证券 | 1,088,500.00 | 0.14 |
| 19 | 600606 | 绿地控股 | 1,079,700.00 | 0.14 |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 1,078,000.00 | 0.14 |

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，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

金额单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 158,791,842.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 111,687,759.28 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，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 | 19,472,000.00 | 2.45 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 206,562,000.00 | 26.01 |
| | 其中：政策性金融债 | 157,512,000.00 | 19.84 |
| 4 | 企业债券 | 68,249,000.00 | 8.60 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 中期票据 | 663,504,000.00 | 83.56 |
| 7 | 可转债 | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 957,787,000.00 | 120.63 |

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

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 | 160418 | 16农发18 | 1,000,000 | 98,090,000.00 | 12.35 |
| 2 | 101570007 | 15光明 MTN001 | 600,000 | 60,228,000.00 | 7.59 |
| 3 | 101453001 | 14京国资 MTN001 | 500,000 | 52,995,000.00 | 6.67 |
| 4 | 101461013 | 14京技投 MTN001 | 500,000 | 52,680,000.00 | 6.63 |
| 5 | 1382059 | 13闽投 MTN1 | 500,000 | 51,150,000.00 | 6.44 |

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。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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未被监管部门立案调查，也未在编制日前一年内受到公开谴责和处罚。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未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 | 140,828.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,353,206.42 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 20,849,406.38 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 27,343,441.69 |

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 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 |
| 创金合 | 251 | 3,187,598.3 | 800,055,000 | 100.00 | 32,177.47 | — |

| | | | | | | |
|------------|-----|--------------|----------------|--------|-----------|---------|
| 信鑫价值混合A | | 2 | .00 | % | | |
| 创金合信鑫价值混合C | 57 | 364.92 | — | — | 20,800.37 | 100.00% |
| 合计 | 307 | 2,606,214.91 | 800,055,000.00 | 99.99% | 52,977.84 | 0.01% |

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 | 创金合信鑫价值混合A | 13,395.05 | 0.001674% |
| | 创金合信鑫价值混合C | 2,300.02 | 11.057592% |
| | 合计 | 15,695.07 | 0.001962% |

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 | 创金合信鑫价值混合A | 0~10 |
| | 创金合信鑫价值混合C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信鑫价值混合A | 0 |
| | 创金合信鑫价值混合C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 创金合信鑫价值混合 A | 创金合信鑫价值混合 C |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年08月30日) 基金份额总额 | 800,088,076.57 | 20,800.37 |
| 本报告期期初基金份额总额 | — | — |
| 本报告期基金总申购份额 | — | — |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 899.10 | — |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 800,087,177.47 | 20,800.37 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用86,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为1年。

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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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 | 占股票成交总额比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 第一创业证券 | 2 | 269,715,519.33 | 100.00% | 195,513.85 | 100.00% | |

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

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 | 占债券成交总额比例 | 成交金额 | 占债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占权证成交总额比例 |
| 第一创业证券 | 142,711,369.50 | 100.00% | 3,288,000,000.00 | 100.00% | — | — |

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 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-18 |
| 2 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-18 |
| 3 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-18 |

| | | | |
|---|---|-----------|------------|
| 4 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-18 |
| 5 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-18 |
| 6 | 创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-24 |
| 7 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 公司官网、证券日报 | 2016-08-31 |
| 8 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 公司官网、证券日报 | 2016-09-21 |
| 9 | 创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告 | 公司官网、证券日报 | 2016-11-22 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

13.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日