

光大保德信吉鑫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：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金财务出具了 2016 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 8 月 19 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
§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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
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.....	21
§6 审计报告	21
6.1 管理层对财务报表的责任.....	21
6.2 注册会计师的责任.....	22
6.3 审计意见.....	22
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	56

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	56
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	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	光大保德信吉鑫混合	
基金主代码	003117	
交易代码	003117	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 19 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,199,014,145.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C
下属分级基金的交易代码	003117	003118
报告期末下属分级基金的份额总额	1,198,926,628.57 份	87,517.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下，获取长期、持续、稳定的合理回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定</p>

影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；

(3) 结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。

2、股票投资策略

本基金将结合自上而下行业分析与自下而上研究入库的投资理念，在以整个宏观策略为前提，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股，并将这些股票组成本基金的核心股票库。

(1) 行业分析

在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后，精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。

(2) 个股选择

本基金将在核心股票库的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。同时，本基金关注国家相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响，本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上，对行业进行优化配置和动态调整。

1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。

2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对

备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

3、固定收益类品种投资策略

本基金投资于固定收益类品种的目的在于保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

4、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

5、国债期货投资策略

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，

	<p>投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>8、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>9、权证及其他品种投资策略</p> <p>本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。</p> <p>同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p>

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		光大保德信基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露	姓名	魏丹	贺碧波

负责人	联系电话	021-80262888-605	0574-89103198
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	hebibo@nbc.cn
客户服务电话		4008-202-888	95574
传真		021-80262468	0574-89103213
注册地址	上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层至10层	中国浙江宁波市宁南南路700号	
办公地址	上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	中国浙江宁波市宁南南路700号	
邮政编码	200010	315100	
法定代表人	林昌	陆华裕	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、宁波银行股份有限公司的办公场所。

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）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层

§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 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	
	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C
本期已实现收益	-14,913,982.32	-853.21
本期利润	-20,953,933.51	-1,496.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0221	-0.0127
本期加权平均净值利润率	-2.22%	-1.27%
本期基金份额净值增长率	-1.70%	-1.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C
期末可供分配利润	-19,856,031.66	-1,467.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0166	-0.0168
期末基金资产净值	1,179,070,596.91	86,049.30
期末基金份额净值	0.983	0.983
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C
基金份额累计净值增长率	-1.70%	-1.70%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 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

1. 光大保德信吉鑫混合 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	-1.70%	0.10%	0.00%	0.39%	-1.70%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-1.70%	0.10%	-1.45%	0.36%	-0.25%	-0.26%

2. 光大保德信吉鑫混合 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	-1.70%	0.10%	0.00%	0.39%	-1.70%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-1.70%	0.10%	-1.45%	0.36%	-0.25%	-0.26%

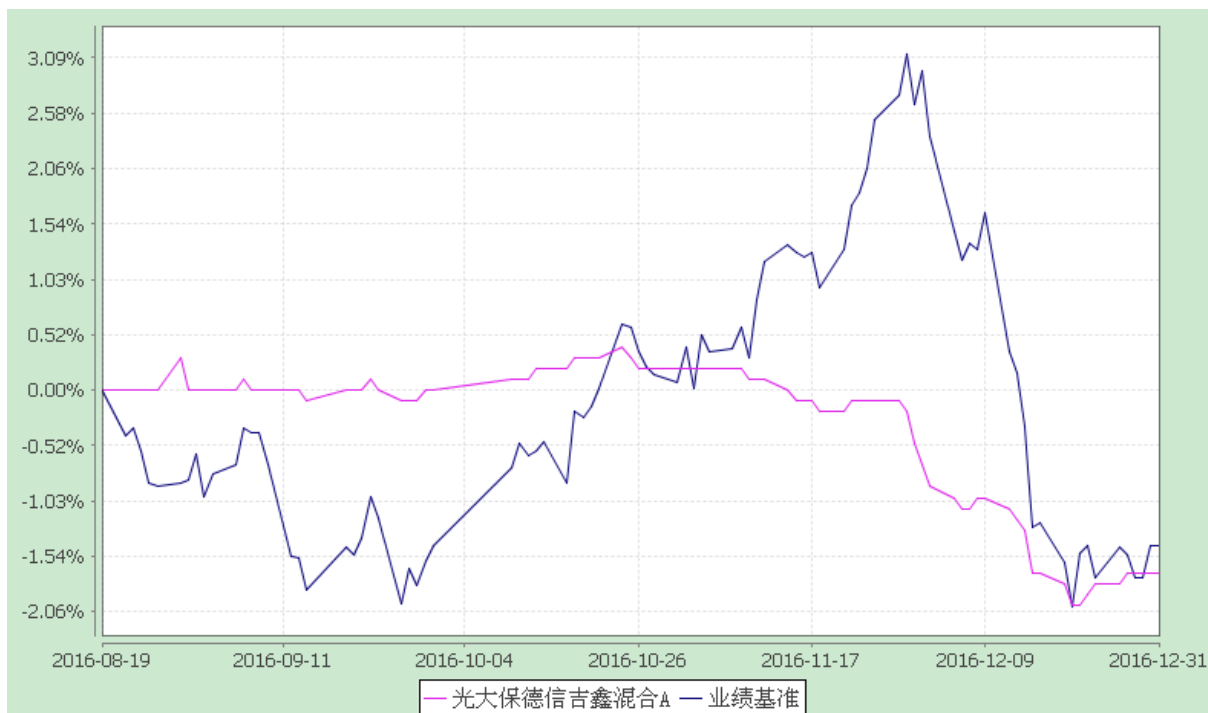
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金

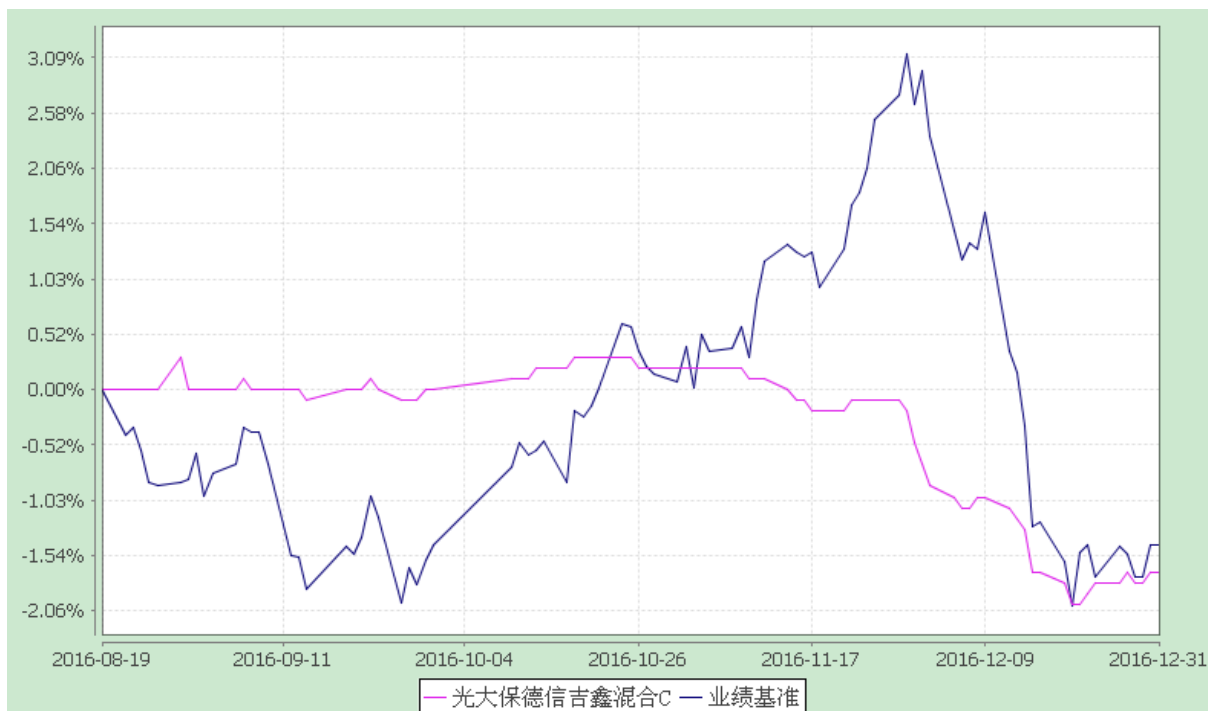
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 8 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日)

1、光大保德信吉鑫混合 A



2、光大保德信吉鑫混合 C

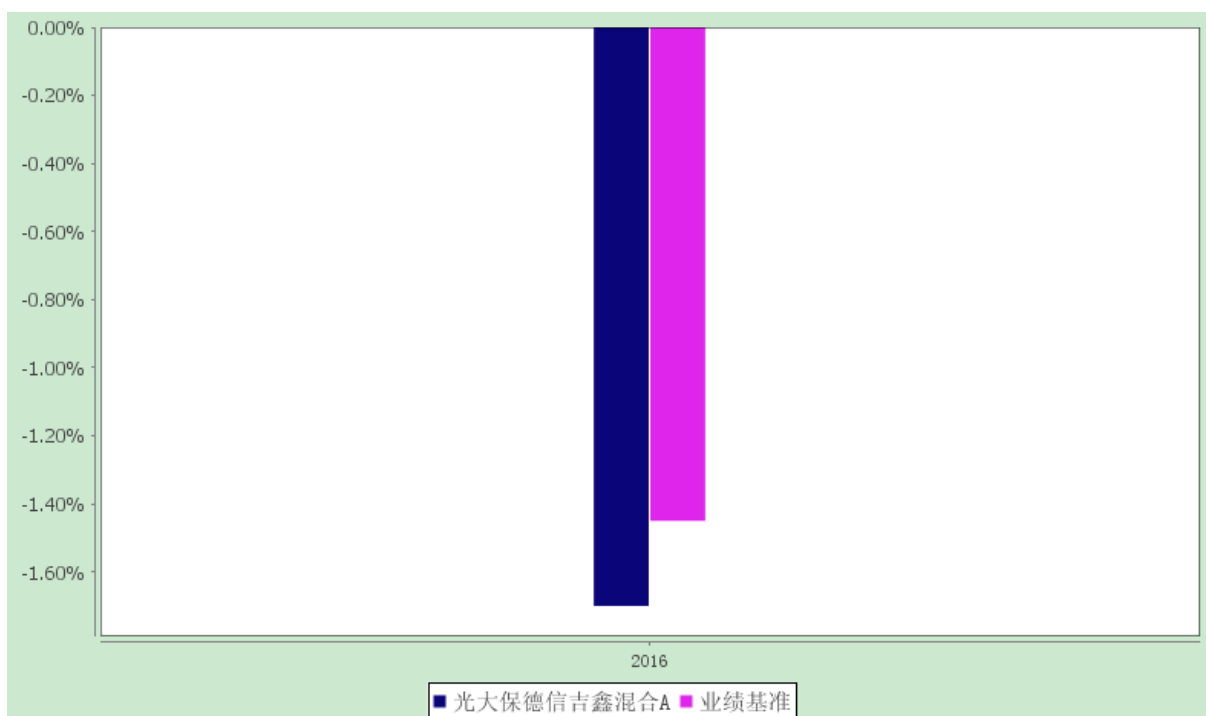


注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2016 年 8 月 19 日至 2017 年 2 月 18 日。

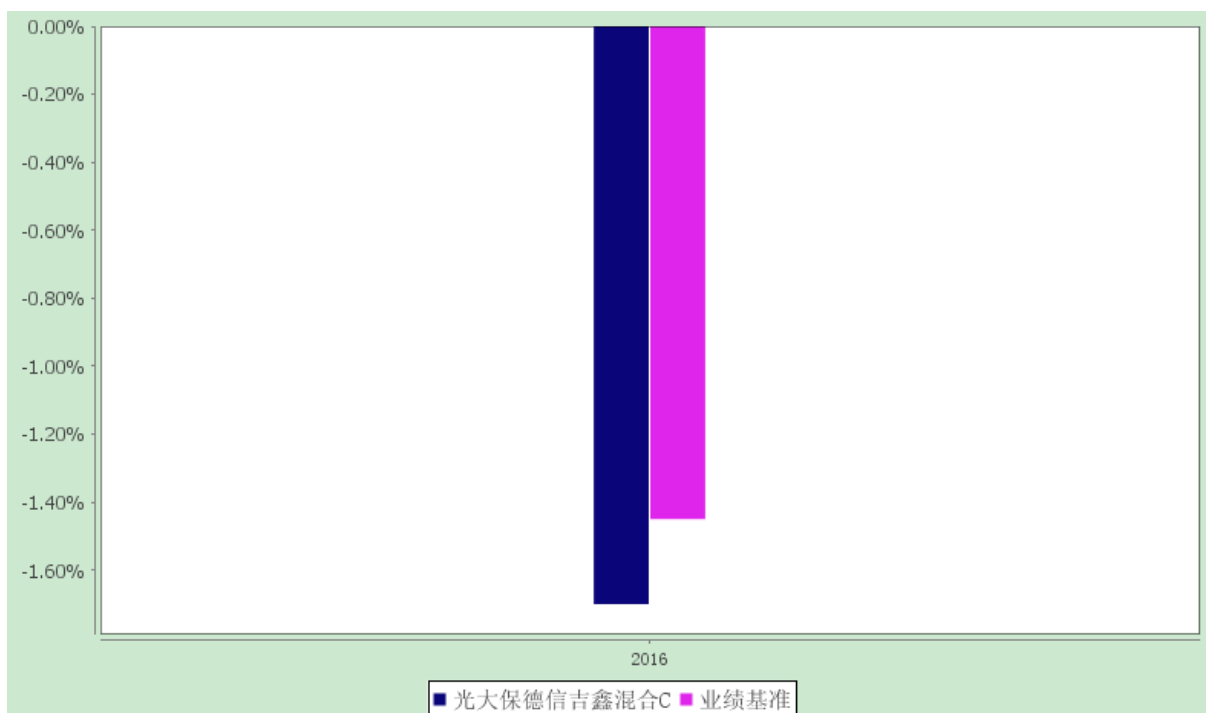
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、光大保德信吉鑫混合 A



2、光大保德信吉鑫混合 C



注：本基金基金合同于 2016 年 8 月 19 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2016 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 30 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊享一年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
蔡乐	基金经理	2016-08-19	-	12 年	蔡乐女士，金融投资学学士。2003 年 7 月至 2005 年 2 月任方正证券

				<p>固定收益部项目经理；2005 年 3 月至 2014 年 8 月历任中再资产管理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员、投资经理助理、自有账户投资经理。2014 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

本基金于 2017 年 3 月 9 日增聘房雷先生为基金经理。

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，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，未有损害基金份额持有人利益的行为。

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国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资

管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，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、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3 日、5 日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 = $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 = $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55%之间。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，出现溢

价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且组合经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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存在异常交易行为。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场与银行间市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

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

2016 年一季度债市博弈多空双方势力均衡，二季度小的流动性危机爆发。2 月份降准前后货币政策上宽松预期利好多头，然而物价数据、信贷数据等对通胀预期压力增加利空债市，因而整个一季度呈现震荡格局。但是到了二季度央行降准使得货币宽松的利好阶段性出尽，而政府工作报告出台显示财政赤字目标增加，积极的财政政策使得市场对经济过热的预期加剧，加之经济数据显示基本面有短暂回暖，进一步对债市形成压制。在众多不利因素不断发酵的过程中，信用事件 3-4 月份的频发成为 4 月份流动性危机爆发的导火索。2016 年 3 月，东北特钢短期融资券发生实质违约，投资人对于地方国有企业刚性兑付的幻想破灭，实质性违约逐步向评级高、期限短、股东背景较强的方向演化；4 月 11 日，中铁物资股份有限公司公告暂停 15 铁物资 SCP004 的交易；4 月 20 日、21 日两只城投债分别公告提前还款被打上另类违约的标签。短端风险溢价快速增加，投资者不得不快速去杠杆，债市在 4 月下旬经历一波快速调整，10 年期国债收益率上行至 2.95%。三季度以配置力量推动为主。进入 6 月份，国内方面，基本面数据较弱使得前期对实体经济转暖的猜测被证伪，通胀担忧下降。外部环境方面，6 月美国非农数据较差、英国脱欧的大环境下，避险情绪升温。从而配置力量强势发力，推动了近 2 个月的债券牛市。具体来看，此轮债牛又可以从理财新规出台前后分为两个阶段。6 月到 7 月，由于全球的负利率背景加上国内的投资增速偏弱，共同推动收益率重新回到 2.8% 一线，随后 10 年期国债收益率短暂横盘整理。7 月 27 日理财新规出台，对理财资金投资在权益和非标做出限制，刺激了追求绝对收益的理财资金的委外需求，强化了配置牛的逻辑。长端利率突破前期箱体，债市展开第二个阶段的快牛，市场上的超长期债券、中低评级债券、分级 A 等一切价值洼地被快速填平，10 年期国债收益率最低下探到 2.65%。但是从 8 月份开始，央行的货币政策其实已经开始悄悄的变化。8 月份央行增加对 14D 的续作比例，通过拉长公开市场操作资金的久期的方式引导市场降杠杆，打破关于收益率下行的一致性预期，债市收益率先在恐慌中展开调整，10 年期国债在 9 月上旬上行至 2.75% 附近。但是投资者并没有对央行降杠杆的决心给予足够的

重视，9月中旬开始，收益率又开始一波回调。尤其是十一期间出台了房地产调控政策后，对国庆节后的债市形成进一步的利好刺激。10年国债收益率从2.75%快速下行至2.65%左右。四季度流动性拐点，利空因素集中爆发。到了四季度，国际上不确定事件增多，国内债市更多的受到国际资本市场的影响。欧洲央行释放信号声称逐步退出量化宽松，美联储12月加息临近，全球的低利率环境在逐步转变。9月以来美国、欧洲等世界主要发达国家的10年期国债收益率快速上行，致使国内外债券收益率利差拉大，进一步引起资本外逃。11月初，特朗普获胜，其主张的积极财政政策成为众多不确定事件中较为确定的因素，对债市进一步形成恐慌性打压。国内环境方面，商品价格快速上涨、春节时间错位等因素致使对通胀上升的担忧加剧；尤其是临近年关，资金面紧张因素增加，加上12月中旬爆发的债券代持违约事件，使得本已利空重重的债市更加不堪一击，终于再次爆发了更严重的流动性风险，利率展开了12月下旬的大踏步上行，10年期国债收益率从12月初的3.0%最高触及到3.4%。

本报告期内，本基金保持了仓位调整的灵活性，由于同业存款价格大幅走低，组合配置上增加了中高等级短融和逆回购的仓位，大幅降低了同业存款的仓位。同时由于期限利差甚小，组合久期也有所缩短。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，积极努力为投资者赚取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信吉鑫混合 A 份额净值增长率为-1.70%，业绩比较基准收益率为-1.45%，光大保德信吉鑫混合 C 份额净值增长率为-1.70%，业绩比较基准收益率为-1.45%。

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 2017 年,国内经济自去年四季度开始企稳，通胀逐渐升温。央行在人民币持续贬值压力的背景下，用锁短放长的操作方式，去杠杆防风险意图明显，我们认为短期内央行政策很难宽松。另外，今年以来金融监管趋严，理财新规、资管八条底线、将表外理财纳入 MPA 广义信贷测算等政策逐渐加码，未来配置压力将会有所减弱，多种因素合力作用，我们认为债市未来仍存回调风险。利率债方面，2017 年经济趋稳，通胀中枢也可能比今年高。在人民币汇率压力和资产泡沫因素的制约下，货币政策大概率会维持紧平衡。我们预计明年债市依然会维持震荡。明年债券市场风险不可低估，尤其是一季度，利率调整力度可能较大。全年来看，我们认为依然延续今年震荡市行情。信用债方面，三季报显示，16 年前三季度 A 股非金融企业整体营业收入、营业利润和净利润增速持续走高，整体信用基本面短期改善，短期偿债能力增强。但我们注意到，价格的上涨主要是由于供给侧收缩，而需求并没有明显改善，这种价格的上涨不具有可持续性。另外，下游复苏的行业集中在地产和汽车等，这些行业受政策影响较大，未来政策的变化可能会给这些行业带来不利影响。另外我

们还注意到，过剩产能行业的资产负债率并没有下降，明年随着债转股的进一步推进，信用风险也可能随之上升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。此外，监察稽核部每年实施若干内部审计项目，以风险为导向，对公司重要业务环节提出流程改进建议。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行了法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往

地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性，估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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，本托管人在光大吉鑫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。

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20332 号

光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“光大保德信吉鑫混合基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 8 月 19 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。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是光大保德信吉鑫混合基金的基金管理人光大保德信基金管理有限公

司管理层的责任。这种责任包括：

(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;

(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。

6.2 注册会计师的责任

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。

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。

6.3 审计意见

我们认为,上述光大保德信吉鑫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,公允反映了光大保德信吉鑫混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 8 月 19 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

薛竞 黄浩

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:光大保德信吉鑫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	496,235,869.28
结算备付金		612,926.76
存出保证金		92,023.20
交易性金融资产	7.4.7.2	403,955,082.82
其中：股票投资		43,439,762.82
基金投资		-
债券投资		360,515,320.00
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	270,200,868.80
应收证券清算款		4,003,864.58
应收利息	7.4.7.5	6,225,724.49
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		1,181,326,359.93
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	7.4.7.3	-
衍生金融负债		-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		984,251.25
应付赎回款		980.06
应付管理人报酬		600,890.20
应付托管费		100,148.34
应付销售服务费		7.44
应付交易费用	7.4.7.7	279,435.20
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	204,001.23
负债合计		2,169,713.72
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	1,199,014,145.82
未分配利润	7.4.7.10	-19,857,499.61
所有者权益合计		1,179,156,646.21
负债和所有者权益总计		1,181,326,359.93

注：1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,199,014,145.82 份，其中 A 类基金份额总额为 1,198,926,628.57 份，基金份额净值 0.983 元；C 类基金份额总额为 87,517.25 份，基金份额净值 0.983 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2016

		年 12 月 31 日
一、收入		-17,968,153.32
1.利息收入		12,418,524.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,141,819.35
债券利息收入		9,209,597.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,067,107.69
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,346,108.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-782,663.28
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-23,563,444.77
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-6,040,593.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	24.07
减：二、费用		2,987,276.19
1. 管理人报酬		2,025,910.27
2. 托管费		337,651.73
3. 销售服务费		43.83
4. 交易费用	7.4.7.20	414,227.93
5. 利息支出		5,042.43
其中：卖出回购金融资产支出		5,042.43
6. 其他费用	7.4.7.21	204,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		-20,955,429.51

列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,955,429.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 8 月 19 日（基金合同生效日）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）	600,161,654.23	-	600,161,654.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,955,429.51	-20,955,429.51
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）	598,852,491.59	1,097,929.90	599,950,421.49
其中：1.基金申购款	598,901,618.67	1,097,881.33	599,999,500.00
2.基金赎回款	-49,127.08	48.57	-49,078.51
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）	1,199,014,145.82	-19,857,499.61	1,179,156,646.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：包爱丽，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大保德信吉鑫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]1070 号《关于准予光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予，由光大保德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《光大保德信吉鑫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 600,161,650.50 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 1107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,161,654.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 3.73 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称“宁波银行”)。

根据《光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购费或申购费的，称为 A 类基金份额；不收取前后端认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。投资者可自行选择认购或申购基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类金融工具(包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、货币市场工具、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等)、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数

收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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》、《光大保德信吉鑫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 19 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 19 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 19 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、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)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。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(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[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)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	1,235,869.28	
定期存款	495,000,000.00	
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00	
存款期限 1 个月以内	130,000,000.00	
存款期限 3 个月以上	265,000,000.00	
其他存款	-	
合计	496,235,869.28	

注：1. 定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

2. 本基金本期未发生定期存款提前支取的情况。

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		43,496,509.32	43,439,762.82	-56,746.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	68,988,952.60	67,957,320.00	-1,031,632.60
	银行间市场	297,510,214.88	292,558,000.00	-4,952,214.88
	合计	366,499,167.48	360,515,320.00	-5,983,847.48
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		409,995,676.80	403,955,082.82	-6,040,593.98

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余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所市场	11,000,000.00	-
银行间市场	259,200,868.80	-
合计	270,200,868.80	-

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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日

应收活期存款利息	8,479.74
应收定期存款利息	719,744.38
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	303.49
应收债券利息	5,324,108.51
应收买入返售证券利息	173,042.82
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	45.54
合计	6,225,724.49

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	256,015.16
银行间市场应付交易费用	23,420.04
合计	279,435.20

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	1.23
预提审计费	54,000.00
预提信息披露费	150,000.00
合计	204,001.23

7.4.7.9 实收基金

光大保德信吉鑫混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	600,030,621.11	600,030,621.11
本期申购	598,901,618.67	598,901,618.67
本期赎回（以“-”号填列）	-5,611.21	-5,611.21
本期末	1,198,926,628.57	1,198,926,628.57

光大保德信吉鑫混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	131,033.12	131,033.12
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-43,515.87	-43,515.87
本期末	87,517.25	87,517.25

注：1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.本基金自 2016 年 8 月 15 日至 2016 年 8 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 600,161,650.50 元。根据《光大保德信吉鑫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 3.73 元在本基金成立后，折算为 600,161,654.23 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3.根据《光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告》，本基金于 2016 年 8 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 10 月 12 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回、转换及定投业务自 2016 年 10 月 13 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

光大保德信吉鑫混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-14,913,982.32	-6,039,951.19	-20,953,933.51
本期基金份额交易产生的变动数	981,329.84	116,572.01	1,097,901.85
其中：基金申购款	981,331.83	116,549.50	1,097,881.33
基金赎回款	-1.99	22.51	20.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,932,652.48	-5,923,379.18	-19,856,031.66

光大保德信吉鑫混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-853.21	-642.79	-1,496.00
本期基金份额交易产生的变动数	-182.35	210.40	28.05
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-182.35	210.40	28.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,035.56	-432.39	-1,467.95

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	189,902.80
定期存款利息收入	1,947,036.04
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,585.75
其他	294.76
合计	2,141,819.35

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	118,707,415.08
减：卖出股票成本总额	119,490,078.36
买卖股票差价收入	-782,663.28

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内未投资基金。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）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	-23,563,444.77
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	-23,563,444.77

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）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	959,135,168.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	970,387,673.74
减：应收利息总额	12,310,939.51
买卖债券差价收入	-23,563,444.77

7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-6,040,593.98
——股票投资	-56,746.50
——债券投资	-5,983,847.48
——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	-6,040,593.98

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	12.88
基金转换费收入	11.19
合计	24.07

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回

费用不低于 75% 的部分归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用不低于 50% 的部分归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	399,752.93
银行间市场交易费用	14,475.00
合计	414,227.93

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	54,000.00
信息披露费	150,000.00
开户费	400.00
合计	204,400.00

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，本基金并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

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司(“光大保德信”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司(“宁波银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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8月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	280,933,254.31	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期

	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	109,682,161.92	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

	本期 2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
关联方名称	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	441,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

	本期 2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日			
关联方名称	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	256,015.16	100.00%	256,015.16	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。权证交易不计佣金。

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。

7.4.10.2 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8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,025,910.27
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	337,651.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C	合计
光大保德信	-	43.59	43.59
合计	-	43.59	43.59

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金

份额销售服务费年费率为 0.1%。

本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

本基金本报告期末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

本报告期内基金管理人未投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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8月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行	1,235,869.28	189,902.80

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

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	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股申购	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股申购	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股申购	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	500,000.00	3,876,757.00	3,485,000.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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，本基金无因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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因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。

7.4.13 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。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制定本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于同一发行主体发行的信用类投资品种不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金通过监控组合的久期来管理基金面临的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	131,235,86 9.28	100,000,00 0.00	265,000,00 0.00	-	-	-	496,235,86 9.28
结算备付金	612,926.76	-	-	-	-	-	612,926.76
存出保证金	92,023.20	-	-	-	-	-	92,023.20
交易性金融资产	4,980,000.0 0	20,026,000. 00	133,013,32 0.00	202,496,00 0.00	-	43,439,762. 82	403,955,08 2.82
买入返售证券	201,000,52 5.00	69,200,343. 80	-	-	-	-	270,200,86 8.80
应收利息	-	-	-	-	-	6,225,724.4 9	6,225,724.4 9
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,003,864.5 8	4,003,864.5 8
资产总计	337,921,34 4.24	189,226,34 3.80	398,013,32 0.00	202,496,00 0.00	-	53,669,351. 89	1,181,326,3 59.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	980.06	980.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	600,890.20	600,890.20
应付托管费	-	-	-	-	-	100,148.34	100,148.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7.44	7.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	279,435.20	279,435.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-	984,251.25	984,251.25

其他负债	-	-	-	-	-	204,001.23	204,001.23
负债总计	-	-	-	-	-	2,169,713.7	2,169,713.7
						2	2
利率敏感度缺 口	337,921,34 4.24	189,226,34 3.80	398,013,32 0.00	202,496,00 0.00	-	51,499,638. 17	1,179,156,6 46.21

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	资产净值变动与利率变动成负相关，相关系数为资产组合的货币久期		
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	上年度末 -
	基准利率上升 1%	减少约 1,572,819.30	-
	基准利率下降 1%	增加约 1,572,819.30	-

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要系市场价格风险。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	43,439,762.82	3.68
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	360,515,320.00	30.57
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	403,955,082.82	34.26

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致	
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
	业绩比较基准上升 1%	增加约 1,159,587.88
	业绩比较基准下降 1%	减少约 1,159,587.88

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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 39,756,069.78 元,属于第二层次的余额为 364,199,013.04 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	43,439,762.82	3.68
	其中:股票	43,439,762.82	3.68
2	固定收益投资	360,515,320.00	30.52
	其中:债券	360,515,320.00	30.52
	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	270,200,868.80	22.87
	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	496,848,796.04	42.06
7	其他各项资产	10,321,612.27	0.87
8	合计	1,181,326,359.93	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,176,000.00	0.35
B	采矿业	4,977,200.00	0.42
C	制造业	11,223,511.95	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	2,899,260.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	20,148,198.64	1.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,439,762.82	3.68

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	601318	中国平安	280,000.00	9,920,400.00	0.84
2	600028	中国石化	920,000.00	4,977,200.00	0.42
3	601166	兴业银行	259,000.00	4,180,260.00	0.35
4	601118	海南橡胶	600,000.00	4,176,000.00	0.35
5	000750	国海证券	500,000.00	3,485,000.00	0.30
6	600688	上海石化	499,975.00	3,219,839.00	0.27
7	600803	新奥股份	225,000.00	3,208,500.00	0.27
8	002221	东华能源	234,000.00	2,899,260.00	0.25
9	601009	南京银行	226,546.00	2,455,758.64	0.21
10	000630	铜陵有色	700,000.00	2,156,000.00	0.18
11	000599	青岛双星	200,000.00	1,588,000.00	0.13
12	300196	长海股份	14,676.00	552,111.12	0.05
13	601375	中原证券	26,695.00	106,780.00	0.01
14	603298	杭叉集团	3,641.00	88,403.48	0.01
15	603878	武进不锈	2,000.00	80,000.00	0.01
16	603218	日月股份	1,652.00	68,805.80	0.01
17	603877	太平鸟	3,180.00	67,734.00	0.01
18	603416	信捷电气	1,076.00	53,886.08	0.00
19	603389	亚振家居	1,963.00	47,327.93	0.00
20	603886	元祖股份	2,241.00	39,665.70	0.00
21	603239	浙江仙通	924.00	29,059.80	0.00
22	603035	常熟汽饰	2,316.00	24,179.04	0.00
23	603929	亚翔集成	2,193.00	15,592.23	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	601318	中国平安	9,655,841.00	0.82
2	600000	浦发银行	6,542,585.00	0.55
3	600803	新奥股份	6,474,454.00	0.55
4	601611	中国核建	6,444,025.00	0.55
5	000001	平安银行	6,418,200.00	0.54
6	600406	国电南瑞	5,970,871.00	0.51
7	600519	贵州茅台	5,615,059.29	0.48
8	600155	宝硕股份	5,458,654.00	0.46
9	000915	山大华特	5,411,022.00	0.46
10	601169	北京银行	5,036,864.00	0.43
11	600028	中国石化	4,901,200.00	0.42
12	300015	爱尔眼科	4,564,699.00	0.39
13	601166	兴业银行	4,371,490.00	0.37
14	601118	海南橡胶	4,217,095.18	0.36
15	601607	上海医药	4,024,173.00	0.34
16	002648	卫星石化	4,007,345.00	0.34
17	000157	中联重科	3,894,500.00	0.33
18	000750	国海证券	3,876,757.00	0.33
19	000630	铜陵有色	3,727,327.45	0.32
20	300367	东方网力	3,713,564.36	0.31

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	601611	中国核建	6,578,547.29	0.56
2	600000	浦发银行	6,553,507.61	0.56
3	000001	平安银行	6,424,800.00	0.54
4	600406	国电南瑞	5,874,239.00	0.50
5	600519	贵州茅台	5,506,584.43	0.47
6	000915	山大华特	5,338,677.00	0.45
7	600155	宝硕股份	5,187,883.76	0.44
8	601169	北京银行	5,044,400.00	0.43
9	002648	卫星石化	4,586,596.00	0.39
10	300015	爱尔眼科	4,333,800.00	0.37
11	601607	上海医药	4,022,377.00	0.34

12	600803	新奥股份	3,684,846.99	0.31
13	300367	东方网力	3,667,191.38	0.31
14	000157	中联重科	3,586,036.57	0.30
15	601998	中信银行	3,498,212.20	0.30
16	002299	圣农发展	3,435,968.00	0.29
17	000402	金融街	2,927,015.00	0.25
18	002807	江阴银行	2,644,709.00	0.22
19	300196	长海股份	2,250,383.00	0.19
20	000423	东阿阿胶	2,243,899.00	0.19

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	162,986,587.68
卖出股票的收入（成交）总额	118,707,415.08

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	31,891,200.00	2.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,270,000.00	2.57
	其中：政策性金融债	30,270,000.00	2.57
4	企业债券	36,066,120.00	3.06
5	企业短期融资券	59,792,000.00	5.07
6	中期票据	202,496,000.00	17.17
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	360,515,320.00	30.57

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	101456035	14 昆山经技 MTN001	500,000	52,060,000.00	4.42
2	101652038	16 希望六和 MTN001	500,000	48,735,000.00	4.13
3	019546	16 国债 18	320,000	31,891,200.00	2.70
4	101364010	13 泉州路桥 MTN001	300,000	31,473,000.00	2.67
5	1382279	13 常交通 MTN1	300,000	30,648,000.00	2.60

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，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。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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	92,023.20
2	应收证券清算款	4,003,864.58
3	应收股利	-
4	应收利息	6,225,724.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,321,612.27

8.12.2 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间的可转换债券。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000750	国海证券	3,485,000.00	0.30	重大事项停牌

8.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

§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
光大保德信吉鑫混合 A	118	10,160,395.16	1,198,899,098.90	100.00%	27,529.67	0.00%
光大保德信吉鑫混合 C	311	281.41	0.00	0.00%	87,517.25	100.00%
合计	429	2,794,904.77	1,198,899,098.90	99.99%	115,046.92	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	光大保德信吉鑫混合 A	4,416.44	0.00%
	光大保德信吉鑫混合 C	18,716.77	21.39%
	合计	23,133.21	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	光大保德信吉鑫混合 A	0
	光大保德信吉鑫混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信吉鑫混合 A	0~10
	光大保德信吉鑫混合 C	0

	合计	0~10
--	----	------

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信吉鑫混合 A	光大保德信吉鑫混合 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 19 日）基金份额总额	600,030,621.11	131,033.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	598,901,618.67	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,611.21	43,515.87
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,198,926,628.57	87,517.25

§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

经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自 2016 年 3 月 3 日起，陶耿先生正式离任公司总经理，由林昌先生代任公司总经理。包爱丽女士自 2016 年 7 月 19 日起担任公司总经理，自包爱丽女士任总经理职务之日起，本基金管理人董事长林昌先生不再代行总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金聘任普华永道中天会计师事务所为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所的报酬是 5.4 万元，目前该审计机构已提供审计服务连续年限为 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，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	280,933,254.31	100.00%	256,015.16	100.00%	-

注：（1）本报告期内本基金新增光大证券 2 个交易单元。

（2）专用交易单元的选择标准和程序

A. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

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；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

B. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照 A 中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

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		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
光大证券	109,682,161.92	100.00%	441,000,000.00	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	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-12
2	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-12
3	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-12
4	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-12
5	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-12
6	关于光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-18
7	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-08-20
8	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基	《中国证券报》、《上海	2016-10-11

	金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证券报》、《证券时报》	
9	对通过网上直销平台(包括移动终端平台)进行光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金的申购、定期定额投资和基金转换实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-10-11
10	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-10-18
11	光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-11-10

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢(北区 3 号楼)6 层至 10 层本基金管理人办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。客户服务中心电话:4008-202-888,021-80262888。公司网址:www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日