

金信转型创新成长灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：金信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2016 年 6 月 8 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
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.....	54
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.....	54

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	54
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	55
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	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末上市基金前十名持有人	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	金信转型创新成长混合
基金主代码	002810
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月8日
基金管理人	金信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	237,252,191.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，挖掘受益于中国经济转型与创新过程中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五个方面：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量宏观经济指标以及各项国家政策来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金资产将主要投资于转型创新主题的证券，基于受益于经济转型及创新的行业，同时会随着经济社会的不断发展，动态调整转型创新受益行业的范围。在操作过程中，本基金将根据宏观经济中期趋势、政策环境变化、各行业景气度情况以及估值区间水平等因素，对行业配置不断进行调整和优化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，以获取稳健的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证</p>

	<p>券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>5、衍生品投资策略</p> <p>1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。</p> <p>2) 权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金以转型创新成长为投资主题的混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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		金信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段卓立	张燕
	联系电话	0755-82510502	0755-83199084
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-866-2866	95555
传真		0755-82510305	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518038	518040
法定代表人		殷克胜	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

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

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	金信基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502

§ 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 6 月 8 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	10,927,365.18	-	-
本期利润	11,555,002.02	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0546	-	-
本期加权平均净值利润率	5.22%	-	-
本期基金份额净值增长率	5.90%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	13,050,289.99	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0550	-	-
期末基金资产净值	251,141,888.83	-	-
期末基金份额净值	1.059	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	5.90%	-	-

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

2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

4、本基金的基金合同于 2016 年 6 月 8 日生效,截止 2016 年 12 月 31 日,本基金成立未满 1 年。

3.2 基金净值表现

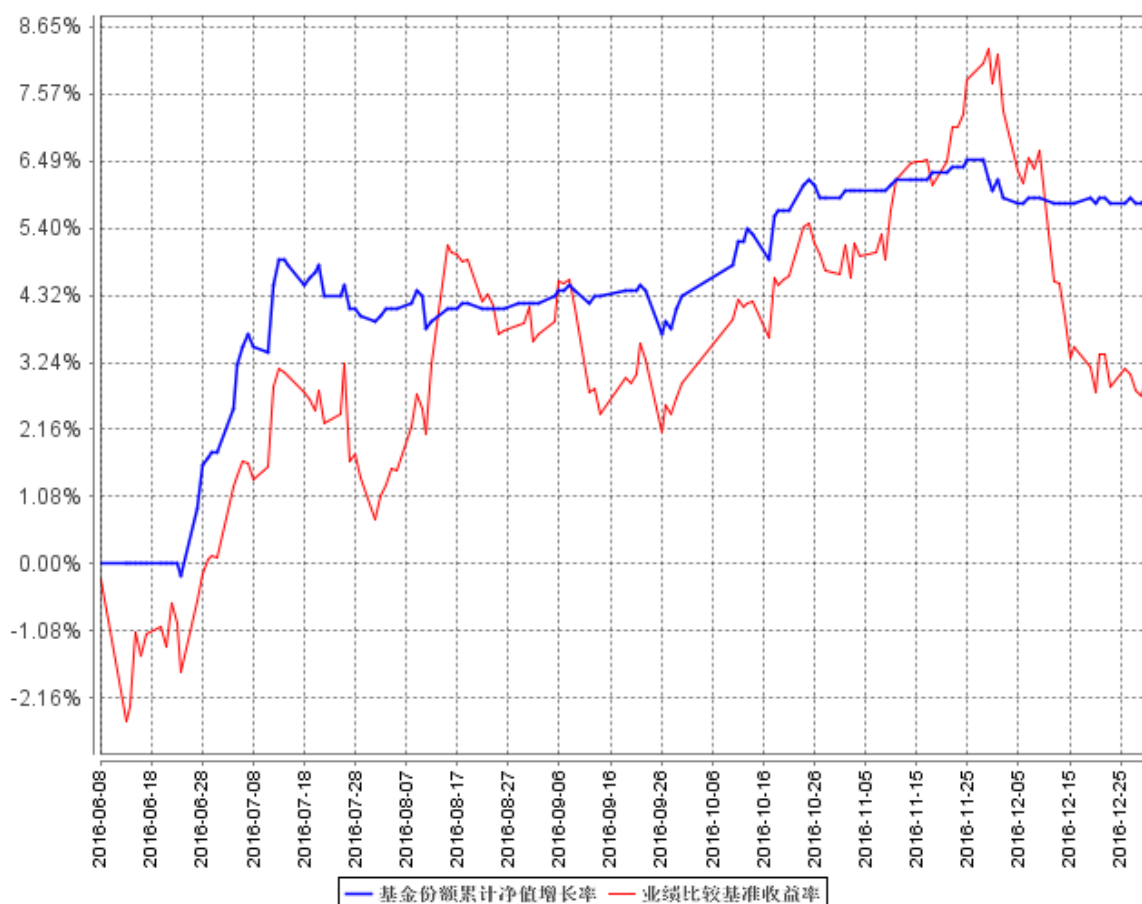
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.53%	0.16%	0.10%	0.48%	1.43%	-0.32%
过去六个月	4.03%	0.21%	2.88%	0.51%	1.15%	-0.30%
自基金合同生效起至今	5.90%	0.23%	3.00%	0.55%	2.90%	-0.32%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35%

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

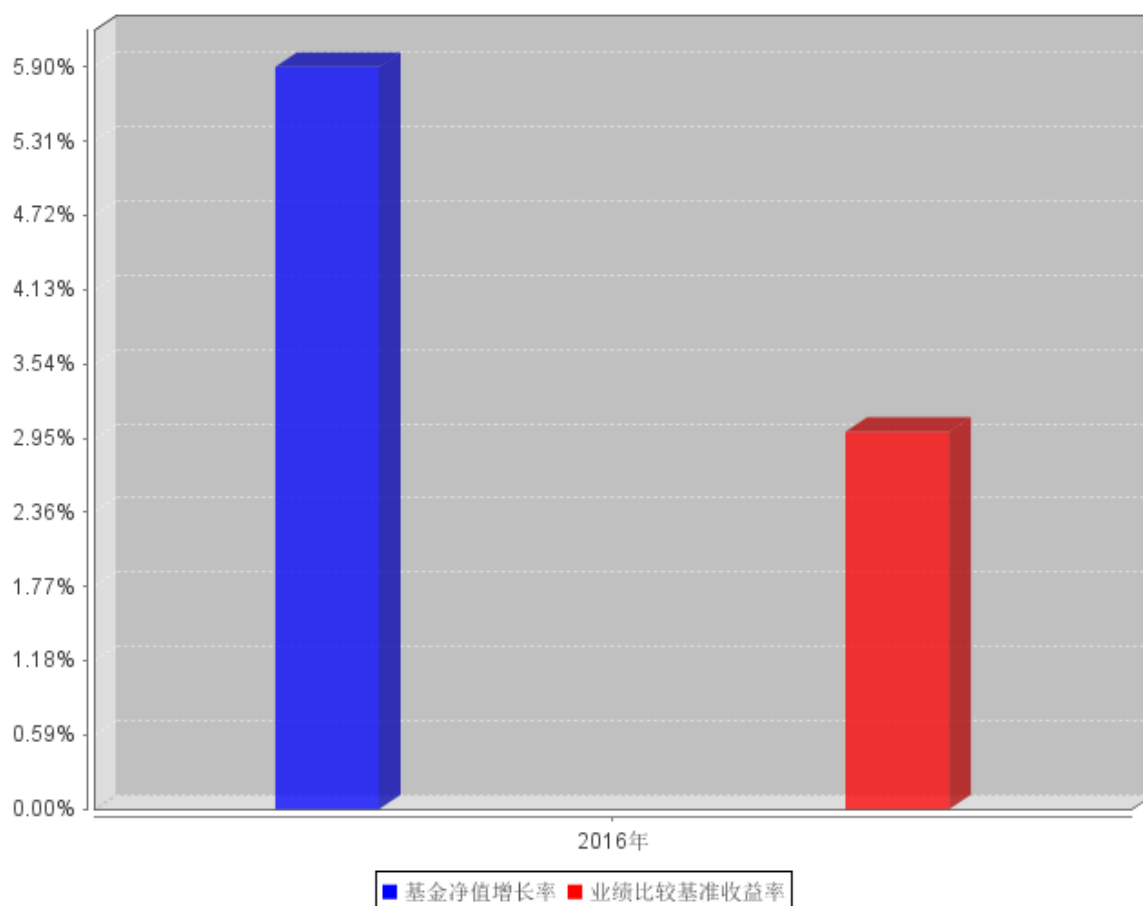
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2016 年 6 月 8 日生效，2016 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算；截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满 1 年。

3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	

注：本基金的基金合同于 2016 年 6 月 8 日生效，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满三年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金信基金管理有限公司成立于 2015 年 7 月，注册资本 1 亿元人民币，注册地位于深圳前海，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳卓越创业投资有限责任公司及安徽国元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司管理资产规模超过 38.5 亿元，旗下管理 6 只开放式基金和 10 只专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘榕俊	本基金基金经理	2016年6月8日	-	14	男，北京大学经济学士、中国科学院金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于招商基金、景顺长城基金、英大证券资产管理部。现任金信基金投资决策委员会委员、基金经理。
任进	本基金基金经理助理	2016年6月8日	-	3	男，武汉大学文学学士、北京大学西方经济学硕士、香港大学金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于申万宏源证券资产管理部，现任金信基金基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等有关法律法规及有关各项实施准则、《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初，A 股市场在人民币贬值预期和依然高企的估值影响下经历了快速的“熔断”下跌。2 月初开始市场逐渐企稳，全年余下时间段呈现震荡的走势。在国企改革深化，新股发行稳步进行，

保险资金加大股票市场资产配置等影响下，A 股市场呈现了热点不断轮换，行情主线围绕“低估值”和“转型创新”两大主题开展的特征。

本基金自成立以来，坚定 A 股市场为中国经济转型创新发展阶段优秀企业做强做优服务的方向，结合国内外经济政治时局的变化，在择时选择上灵活调整权益持有仓位。在股票配置上，选择在全社会资产收益率下降的背景下具有比较优势的低估值高分红股票板块作为安全边际，同时精选符合经济产业转型创新和技术升级换代的小市值股票作为弹性组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金产品的单位净值为 1.059 元，报告期内单位净值增长率为 5.90%，同期业绩比较基准收益率为 3.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看，我们对中国经济谨慎乐观，我国完整的产业结构、依然巨大的劳动人口、日益增长的国内市场、长期稳定的政治经济环境和不断深化改革开放的决心，中国经济依然十分有潜力。

从股市自身的运行来看，A 股经过 2015 年 6 月以来的大幅下跌以及 2016 年全年的估值缓慢回归，估值区间已逐渐趋向合理，继续下跌的空间有限。从大类资产配置的比较，债市的调整还未充分进行，房地产的高位震荡，权益市场具备相对的吸引力。政府为了进一步推动改革，重启资本市场改革的预期较为强烈，发展资本市场的举措有望经过一段时间沉寂后再度发力。

从中国所处阶段和经济发展情况来看，我们认为低估值高分红，具备稳定现金流估值合理的公司将继续突出。在成长股方面，随着新股发行的增多，区别“真伪”成长股，选择具有现代管理能力和研发实力的优质科技企业将成为未来市场新的方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人由总经理、督察长、运作保障部、基金投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他相关人员，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投

资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，未出现对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

本基金为发起式基金，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金净值的限制性条款暂不适用本基金。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》的有关约定，诚实、尽职地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——金信基金管理有限公司在金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对金信基金管理有限公司编制和披露的金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 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 20327 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“金信转型创新成长混合型发起式基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 6 月 8 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金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金管理人金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作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为,上述金信转型创新成长混合型发起式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，公允反映了金信转型创新成长混合型发起式基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 6 月 8 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	薛竞	崔崑
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 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	134,105,762.29	-
结算备付金		16,776,369.66	-
存出保证金		224,956.76	-
交易性金融资产	7.4.7.2	10,328,357.99	-
其中：股票投资		10,328,357.99	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	90,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	287,919.09	-
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		251,723,365.79	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		319,102.65	-
应付托管费		53,183.78	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	131,490.53	-
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	77,700.00	-
负债合计		581,476.96	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	237,252,191.08	-
未分配利润	7.4.7.10	13,889,697.75	-
所有者权益合计		251,141,888.83	-
负债和所有者权益总计		251,723,365.79	-

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.059 元，基金份额总额 237,252,191.08 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 6 月 8 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：金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 6 月 8 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 6 月 8 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		14,769,117.79	-
1. 利息收入		2,096,662.64	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	358,122.94	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,738,539.70	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,011,877.68	-

其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,554,302.97	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	457,574.71	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	627,636.84	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	32,940.63	-
减：二、费用		3,214,115.77	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,874,162.52	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	312,360.47	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	948,908.13	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	78,684.65	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,555,002.02	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,555,002.02	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016年6月8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6月8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）	180,094,811.36	-	180,094,811.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,555,002.02	11,555,002.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	57,157,379.72	2,334,695.73	59,492,075.45

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	67,198,288.43	2,851,577.56	70,049,865.99
2. 基金赎回款	-10,040,908.71	-516,881.83	-10,557,790.54
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）	237,252,191.08	13,889,697.75	251,141,888.83
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

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：

<u> 殷克胜 </u>	<u> 殷克胜 </u>	<u> 陈瑾 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1007号《关于准予金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由金信基金管理有限公司依照《中华人民

《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集期间为 2016 年 5 月 20 日至 2016 年 6 月 3 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 180,035,996.02 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 725 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 180,094,811.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,815.34 份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金来源于基金管理人的基金经理助理。发起资金提供方认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%；其中投资于基金合同界定的经济转型与创新主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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，现金类资产或者到期日一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×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》、《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列表。

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 6 月 8 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 6 月 8 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 6 月 8 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

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债),并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(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。本基金持有的其他金融负债包括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

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值，不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格，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。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 股票投资

1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的

估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

(2) 债券投资

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(3) 权证投资

1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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

的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

(4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中的相关原则进行估值；

(5) 期货合约以结算价格估值；

(6) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此之外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬和托管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。

(2) 卖出回购金额资产支出，按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位, 则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(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, 每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%, 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(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) 每一基金份额享有同等分配权;

(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, 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) 对于在银行间同业市场交易的债券品种, 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》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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	134,105,762.29	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	134,105,762.29	-

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	9,700,721.15	10,328,357.99	627,636.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,700,721.15	10,328,357.99	627,636.84
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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
买入返售证券	90,000,000.00	-
合计	90,000,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	29,503.32	-
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	8,304.34	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	250,000.00	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	111.43	-
合计	287,919.09	-

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：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	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	131,490.53	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	131,490.53	-

注：

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	上年度末 2015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	77,700.00	-
合计	77,700.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	180,094,811.36	180,094,811.36
本期申购	67,198,288.43	67,198,288.43
本期赎回(以“-”号填列)	-10,040,908.71	-10,040,908.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	237,252,191.08	237,252,191.08

7.4.7.10 未分配利润

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
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	10,927,365.18	627,636.84	11,555,002.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,122,924.81	211,770.92	2,334,695.73
其中：基金申购款	2,531,805.56	319,772.00	2,851,577.56
基金赎回款	-408,880.75	-108,001.08	-516,881.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,050,289.99	839,407.76	13,889,697.75

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	275,789.88	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	81,183.22	-
其他	1,149.84	-
合计	358,122.94	-

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	360,191,316.90	-
减：卖出股票成本总额	348,637,013.93	-
买卖股票差价收入	11,554,302.97	-

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股指期货-投资收益		-

注：本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	457,574.71	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	457,574.71	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	627,636.84	-
——股票投资	627,636.84	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	627,636.84	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	32,940.63	-
合计	32,940.63	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	948,908.13	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	948,908.13	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	27,700.00	-
帐户维护费	400.00	-
银行费用	584.65	-
合计	78,684.65	-

7.4.7.21 分部报告

-

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
金信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人

深圳巨财汇投资有限公司	基金管理人股东
深圳市卓越创业投资有限责任公司	基金管理人股东
安徽国元信托有限责任公司	基金管理人股东
殷克胜	基金管理人股东
徐海焱	基金管理人股东（2016年9月29日前）

注：1. 根据金信基金 2016 年 7 月 8 日股东会决定，金信基金原股东徐海焱将其持有的 1.5% 股权转让给殷克胜，上述工商变更手续已于 2016 年 9 月 29 日完成。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

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	上年度可比期间
	2016年6月8日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,874,162.52	-
其中：支付销售机构的客户维护费	175.91	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	312,360.47	-

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

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

注：本基金本报告期内与关联方无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

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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6月8日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	134,105,762.29	275,789.88	-	-

注：本基金银行存款由托管人招商银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

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**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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**

注：截止本报告期末，本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券的情形。

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	备注
000711	京蓝科技	2016年10月20日	临时停牌	32.54	-	-	42,700	1,231,406.19	1,389,458.00	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	临时停牌	16.34	2017年1月12日	15.22	18,200	285,930.42	297,388.00	-

600859	王府井	2016年9月27日	临时停牌	16.28	-	-	13,059	216,479.71	212,600.52	-
300243	瑞丰高材	2016年9月20日	临时停牌	15.18	2017年1月4日	16.70	3,900	58,561.83	59,202.00	-
600152	维科精华	2016年11月21日	临时停牌	12.50	-	-	3,255	38,720.61	40,687.50	-
002159	三特索道	2016年12月29日	临时停牌	32.00	2017年1月6日	31.60	1,204	34,097.69	38,528.00	-
600875	东方电气	2016年12月9日	临时停牌	10.79	-	-	2,527	24,709.10	27,266.33	-
000540	中天城投	2016年11月28日	临时停牌	6.93	2017年1月3日	7.00	3,080	20,862.40	21,344.40	-
000166	申万宏源	2016年12月21日	临时停牌	6.25	2017年1月26日	6.29	3,288	20,626.01	20,550.00	-

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，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%;其中投资于基金合同界定的经济转型与创新主题的证券不低于非现金基金资产的 80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%;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,现金类资产或者到期日一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的基金管理人建设全面风险管理体系,建立了以公司董事会审计与风险控制委员会为核心的、由投资决策委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等。在公司管理层下设立投资决策委员会和监察稽核部对公司的风险进行的预防和控制;投资决策委员会在总经理的领导下,研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略,对基金的总体投资情况提出指导性意见,从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的;监察稽核部在督察长的领导下,独立于公司各业务部门和各分支机构,对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。在业务部门层面,公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行,与该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设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

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证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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、结算备付金及存出保证金等。

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	134,105,762.29	-	-	-	-	-	134,105,762.29
结算备付金	16,776,369.66	-	-	-	-	-	16,776,369.66
存出保证金	224,956.76	-	-	-	-	-	224,956.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	10,328,357.99	10,328,357.99
买入返售金融资产	90,000,000.00	-	-	-	-	-	90,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	287,919.09	287,919.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	241,107,088.71	-	-	-	-	10,616,277.08	251,723,365.79
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	319,102.65	319,102.65
应付托管费	-	-	-	-	-	53,183.78	53,183.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	131,490.53	131,490.53
其他负债	-	-	-	-	-	77,700.00	77,700.00
负债总计	-	-	-	-	-	581,476.96	581,476.96
利率敏感度缺口	241,107,088.71	-	-	-	-	10,034,800.12	251,141,888.83
上年度末 2015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							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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的股票，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，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。本基金股票投资占基金资产的比例范围 0-95%；债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,328,357.99	4.11	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,328,357.99	4.11	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	548,281.42	-
	沪深 300 指数下降 5%	-548,281.42	-

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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 8,221,333.24 元，属于第二层次的余额为 2,107,024.75 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	10,328,357.99	4.10
	其中：股票	10,328,357.99	4.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	90,000,000.00	35.75
	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	150,882,131.95	59.94
7	其他各项资产	512,875.85	0.20
8	合计	251,723,365.79	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	229,628.52	0.09
B	采矿业	311,306.57	0.12
C	制造业	4,895,484.21	1.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	485,498.53	0.19
E	建筑业	349,904.30	0.14
F	批发和零售业	685,032.86	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	361,642.35	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,167.32	0.04
J	金融业	866,002.81	0.34
K	房地产业	1,798,805.08	0.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,922.60	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	156,190.65	0.06
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	52,772.19	0.02
	合计	10,328,357.99	4.11

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金目前不允许投资沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000711	京蓝科技	42,700	1,389,458.00	0.55
2	300200	高盟新材	30,600	547,740.00	0.22
3	600992	贵绳股份	21,488	364,866.24	0.15
4	002440	闰土股份	18,200	297,388.00	0.12
5	600859	王府井	13,059	212,600.52	0.08
6	300120	经纬电材	6,400	99,904.00	0.04
7	603900	通灵珠宝	1,959	75,421.50	0.03
8	603819	神力股份	1,698	67,580.40	0.03
9	002819	东方中科	1,293	61,559.73	0.02
10	600021	上海电力	4,900	59,486.00	0.02
11	300243	瑞丰高材	3,900	59,202.00	0.02
12	603633	徕木股份	1,258	51,590.58	0.02
13	603323	吴江银行	3,094	47,833.24	0.02
14	000100	TCL 集团	14,400	47,520.00	0.02
15	600099	林海股份	2,492	47,173.56	0.02
16	000993	闽东电力	3,103	44,093.63	0.02
17	600810	神马股份	4,228	43,506.12	0.02
18	600050	中国联通	5,915	43,238.65	0.02
19	600152	维科精华	3,255	40,687.50	0.02
20	002040	南京港	1,971	40,582.89	0.02
21	002159	三特索道	1,204	38,528.00	0.02
22	300417	南华仪器	696	38,182.56	0.02
23	000737	南风化工	5,056	37,616.64	0.01
24	601668	中国建筑	4,144	36,715.84	0.01
25	002598	山东章鼓	2,566	36,539.84	0.01
26	600097	开创国际	1,676	36,436.24	0.01
27	002058	威尔泰	1,219	36,423.72	0.01
28	002136	安纳达	2,061	35,696.52	0.01
29	002760	凤形股份	903	35,388.57	0.01
30	600352	浙江龙盛	3,808	35,071.68	0.01
31	600985	雷鸣科化	2,352	35,068.32	0.01
32	002205	国统股份	1,150	35,052.00	0.01
33	300214	日科化学	3,873	34,934.46	0.01
34	000985	大庆华科	1,137	34,905.90	0.01
35	300313	天山生物	1,836	34,884.00	0.01
36	002627	宜昌交运	1,410	34,883.40	0.01
37	600802	福建水泥	3,347	34,875.74	0.01

38	600727	鲁北化工	3,279	34,855.77	0.01
39	300280	南通锻压	1,014	34,668.66	0.01
40	000153	丰原药业	2,689	34,661.21	0.01
41	000707	双环科技	3,875	34,642.50	0.01
42	600778	友好集团	3,074	34,613.24	0.01
43	600853	龙建股份	4,994	34,608.42	0.01
44	300192	科斯伍德	2,287	34,533.70	0.01
45	600774	汉商集团	1,525	34,388.75	0.01
46	600615	丰华股份	1,629	34,274.16	0.01
47	600213	亚星客车	2,199	34,260.42	0.01
48	600513	联环药业	1,956	34,151.76	0.01
49	000713	丰乐种业	2,930	34,134.50	0.01
50	600889	南京化纤	2,593	34,097.95	0.01
51	002591	恒大高新	1,932	34,080.48	0.01
52	600573	惠泉啤酒	2,190	34,054.50	0.01
53	600444	国机通用	1,514	34,049.86	0.01
54	601678	滨化股份	4,662	33,985.98	0.01
55	600051	宁波联合	2,597	33,942.79	0.01
56	600593	大连圣亚	853	33,847.04	0.01
57	601800	中国交建	2,226	33,812.94	0.01
58	600302	标准股份	3,123	33,790.86	0.01
59	600766	园城黄金	1,933	33,788.84	0.01
60	600448	华纺股份	4,298	33,610.36	0.01
61	300106	西部牧业	2,083	33,598.79	0.01
62	300330	华虹计通	1,743	33,552.75	0.01
63	300344	太空板业	2,085	33,234.90	0.01
64	002420	毅昌股份	3,284	33,135.56	0.01
65	002066	瑞泰科技	1,747	33,123.12	0.01
66	000785	武汉中商	2,314	32,997.64	0.01
67	300321	同大股份	854	32,964.40	0.01
68	600605	汇通能源	1,395	32,963.85	0.01
69	600560	金白天正	2,012	32,936.44	0.01
70	600731	湖南海利	3,117	32,915.52	0.01
71	600706	曲江文旅	1,654	32,815.36	0.01
72	002457	青龙管业	2,826	32,809.86	0.01
73	600128	弘业股份	2,154	32,762.34	0.01
74	002715	登云股份	920	32,742.80	0.01
75	600148	长春一东	1,169	32,720.31	0.01
76	002057	中钢天源	1,922	32,616.34	0.01

77	600356	恒丰纸业	2,662	32,503.02	0.01
78	601186	中国铁建	2,695	32,232.20	0.01
79	600561	江西长运	2,308	32,035.04	0.01
80	002134	天津普林	2,000	32,020.00	0.01
81	600793	宜宾纸业	1,020	31,864.80	0.01
82	601000	唐山港	7,945	31,859.45	0.01
83	600371	万向德农	1,949	31,827.17	0.01
84	600141	兴发集团	2,086	31,728.06	0.01
85	600883	博闻科技	1,961	31,532.88	0.01
86	000159	国际实业	3,703	31,475.50	0.01
87	600791	京能置业	3,827	31,381.40	0.01
88	300275	梅安森	1,434	31,375.92	0.01
89	000004	国农科技	694	31,160.60	0.01
90	600505	西昌电力	3,066	31,119.90	0.01
91	300022	吉峰农机	3,278	31,075.44	0.01
92	300260	新莱应材	924	31,009.44	0.01
93	002633	申科股份	1,132	30,948.88	0.01
94	601333	广深铁路	6,090	30,876.30	0.01
95	600030	中信证券	1,904	30,578.24	0.01
96	600385	山东金泰	1,277	30,405.37	0.01
97	601717	郑煤机	4,319	30,362.57	0.01
98	000610	西安旅游	2,030	30,226.70	0.01
99	600689	上海三毛	1,512	30,209.76	0.01
100	600796	钱江生化	2,429	30,192.47	0.01
101	000725	京东方A	10,514	30,070.04	0.01
102	600540	新赛股份	3,766	29,789.06	0.01
103	000692	惠天热电	4,623	29,725.89	0.01
104	000779	三毛派神	1,537	29,602.62	0.01
105	000702	正虹科技	2,162	29,403.20	0.01
106	000488	晨鸣纸业	2,835	29,370.60	0.01
107	600281	太化股份	3,925	29,359.00	0.01
108	000898	鞍钢股份	5,817	29,317.68	0.01
109	600455	博通股份	498	29,297.34	0.01
110	300354	东华测试	1,200	29,280.00	0.01
111	002248	华东数控	2,535	29,228.55	0.01
112	600359	新农开发	3,084	28,958.76	0.01
113	600657	信达地产	4,746	28,950.60	0.01
114	000830	鲁西化工	5,162	28,855.58	0.01
115	300483	沃施股份	517	28,822.75	0.01

116	300305	裕兴股份	2,234	28,818.60	0.01
117	002015	霞客环保	3,270	28,808.70	0.01
118	300218	安利股份	1,774	28,774.28	0.01
119	300046	台基股份	1,141	28,502.18	0.01
120	600362	江西铜业	1,701	28,457.73	0.01
121	300176	鸿特精密	936	28,426.32	0.01
122	601169	北京银行	2,908	28,382.08	0.01
123	600720	祁连山	3,451	28,194.67	0.01
124	601006	大秦铁路	3,955	28,001.40	0.01
125	300125	易世达	937	27,922.60	0.01
126	300092	科新机电	2,008	27,871.04	0.01
127	601318	中国平安	784	27,777.12	0.01
128	600028	中国石化	5,117	27,682.97	0.01
129	000709	河钢股份	8,281	27,658.54	0.01
130	000338	潍柴动力	2,772	27,609.12	0.01
131	000900	现代投资	3,405	27,478.35	0.01
132	600881	亚泰集团	4,998	27,339.06	0.01
133	600875	东方电气	2,527	27,266.33	0.01
134	601666	平煤股份	5,593	27,237.91	0.01
135	600241	时代万恒	1,758	27,178.68	0.01
136	000695	滨海能源	1,689	27,176.01	0.01
137	601857	中国石油	3,416	27,157.20	0.01
138	300035	中科电气	1,833	27,146.73	0.01
139	300489	中飞股份	712	27,063.12	0.01
140	601992	金隅股份	6,048	26,974.08	0.01
141	600015	华夏银行	2,471	26,810.35	0.01
142	601939	建设银行	4,921	26,770.24	0.01
143	600426	华鲁恒升	2,017	26,725.25	0.01
144	601998	中信银行	4,165	26,697.65	0.01
145	000425	徐工机械	7,875	26,617.50	0.01
146	000528	柳工	3,626	26,506.06	0.01
147	600808	马钢股份	9,366	26,505.78	0.01
148	601088	中国神华	1,638	26,502.84	0.01
149	000157	中联重科	5,824	26,440.96	0.01
150	600801	华新水泥	3,409	26,419.75	0.01
151	601009	南京银行	2,436	26,406.24	0.01
152	000937	冀中能源	3,913	26,373.62	0.01
153	600026	中远海能	3,871	26,361.51	0.01
154	600795	国电电力	8,309	26,339.53	0.01

155	000778	新兴铸管	5,089	26,310.13	0.01
156	000929	兰州黄河	1,355	26,151.50	0.01
157	600266	北京城建	1,960	26,126.80	0.01
158	000572	海马汽车	4,865	26,076.40	0.01
159	601166	兴业银行	1,603	25,872.42	0.01
160	601390	中国中铁	2,919	25,862.34	0.01
161	600971	恒源煤电	4,123	25,851.21	0.01
162	600816	安信信托	1,085	25,627.70	0.01
163	601988	中国银行	7,441	25,597.04	0.01
164	601328	交通银行	4,431	25,566.87	0.01
165	600325	华发股份	1,995	25,536.00	0.01
166	600717	天津港	2,527	25,472.16	0.01
167	601818	光大银行	6,510	25,454.10	0.01
168	600585	海螺水泥	1,499	25,423.04	0.01
169	601699	潞安环能	3,157	25,413.85	0.01
170	600000	浦发银行	1,561	25,303.81	0.01
171	601898	中煤能源	4,354	25,296.74	0.01
172	000001	平安银行	2,758	25,097.80	0.01
173	601669	中国电建	3,451	25,054.26	0.01
174	600019	宝钢股份	3,941	25,025.35	0.01
175	600376	首开股份	2,114	24,966.34	0.01
176	601398	工商银行	5,656	24,942.96	0.01
177	600219	南山铝业	8,043	24,852.87	0.01
178	601618	中国中冶	5,327	24,823.82	0.01
179	600383	金地集团	1,911	24,766.56	0.01
180	000623	吉林敖东	798	24,730.02	0.01
181	600016	民生银行	2,716	24,661.28	0.01
182	601117	中国化学	3,640	24,642.80	0.01
183	600642	申能股份	4,186	24,571.82	0.01
184	601288	农业银行	7,910	24,521.00	0.01
185	600221	海南航空	7,497	24,440.22	0.01
186	600068	葛洲坝	2,653	24,381.07	0.01
187	600823	世茂股份	3,416	23,980.32	0.01
188	600005	武钢股份	6,993	23,846.13	0.01
189	600039	四川路桥	5,026	23,823.24	0.01
190	600348	阳泉煤业	3,535	23,790.55	0.01
191	600027	华电国际	4,795	23,735.25	0.01
192	000402	金融街	2,282	23,504.60	0.01
193	600805	悦达投资	2,765	23,474.85	0.01

194	000726	鲁 泰 A	1,820	23,314.20	0.01
195	002051	中工国际	1,003	22,988.76	0.01
196	600761	安徽合力	1,806	22,972.32	0.01
197	600827	百联股份	1,582	22,717.52	0.01
198	600660	福耀玻璃	1,218	22,691.34	0.01
199	601336	新华保险	518	22,678.04	0.01
200	600582	天地科技	4,508	22,404.76	0.01
201	600170	上海建工	4,704	22,249.92	0.01
202	002202	金风科技	1,295	22,157.45	0.01
203	600004	白云机场	1,551	21,853.59	0.01
204	002146	荣盛发展	2,772	21,760.20	0.01
205	000550	江铃汽车	805	21,735.00	0.01
206	600166	福田汽车	7,028	21,716.52	0.01
207	002142	宁波银行	1,302	21,665.28	0.01
208	600048	保利地产	2,359	21,537.67	0.01
209	601633	长城汽车	1,946	21,522.76	0.01
210	000333	美的集团	763	21,493.71	0.01
211	601901	方正证券	2,814	21,386.40	0.01
212	000581	威孚高科	952	21,362.88	0.01
213	000540	中天城投	3,080	21,344.40	0.01
214	601211	国泰君安	1,148	21,341.32	0.01
215	000685	中山公用	1,917	21,336.21	0.01
216	000501	鄂武商 A	1,093	21,335.36	0.01
217	000786	北新建材	2,072	21,320.88	0.01
218	600104	上汽集团	908	21,292.60	0.01
219	600023	浙能电力	3,920	21,285.60	0.01
220	600970	中材国际	2,982	21,142.38	0.01
221	600188	兖州煤业	1,946	21,133.56	0.01
222	600583	海油工程	2,856	21,077.28	0.01
223	600089	特变电工	2,303	21,026.39	0.01
224	000027	深圳能源	3,052	20,967.24	0.01
225	600837	海通证券	1,323	20,837.25	0.01
226	000069	华侨城 A	2,989	20,773.55	0.01
227	000776	广发证券	1,225	20,653.50	0.01
228	601601	中国太保	742	20,605.34	0.01
229	600743	华远地产	4,620	20,559.00	0.01
230	000166	申万宏源	3,288	20,550.00	0.01
231	601377	兴业证券	2,674	20,456.10	0.01
232	600109	国金证券	1,568	20,431.04	0.01

233	600064	南京高科	1,218	20,401.50	0.01
234	601515	东风股份	1,703	20,384.91	0.01
235	601555	东吴证券	1,533	20,342.91	0.01
236	000686	东北证券	1,645	20,332.20	0.01
237	601155	新城控股	1,729	20,315.75	0.01
238	600741	华域汽车	1,267	20,208.65	0.01
239	600011	华能国际	2,842	20,036.10	0.01
240	000543	皖能电力	2,625	19,976.25	0.01
241	600690	青岛海尔	2,016	19,918.08	0.01
242	600060	海信电器	1,162	19,893.44	0.01
243	600886	国投电力	2,982	19,889.94	0.01
244	600674	川投能源	2,275	19,792.50	0.01
245	600999	招商证券	1,211	19,775.63	0.01
246	600958	东方证券	1,267	19,676.51	0.01
247	601788	光大证券	1,225	19,587.75	0.01
248	000783	长江证券	1,911	19,549.53	0.01
249	600483	福能股份	1,764	19,527.48	0.01
250	601111	中国国航	2,709	19,504.80	0.01
251	002736	国信证券	1,253	19,484.15	0.01
252	000600	建投能源	2,191	19,456.08	0.01
253	600578	京能电力	4,627	19,433.40	0.01
254	600177	雅戈尔	1,386	19,376.28	0.01
255	600398	海澜之家	1,792	19,335.68	0.01
256	601688	华泰证券	1,078	19,253.08	0.01
257	000625	长安汽车	1,288	19,242.72	0.01
258	600240	华业资本	1,761	18,913.14	0.01
259	603188	亚邦股份	1,057	18,878.02	0.01
260	600835	上海机电	966	18,856.32	0.01
261	600340	华夏幸福	784	18,737.60	0.01
262	600894	广日股份	1,370	18,727.90	0.01
263	002081	金螳螂	1,911	18,708.69	0.01
264	600066	宇通客车	938	18,375.42	0.01
265	600270	外运发展	1,106	18,293.24	0.01
266	600236	桂冠电力	2,877	17,549.70	0.01
267	000926	福星股份	854	10,879.96	0.00
268	000876	新希望	980	7,889.00	0.00
269	000656	金科股份	1,204	6,308.96	0.00
270	600061	国投安信	224	3,496.64	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	002760	凤形股份	3,123,392.00	1.24
2	000711	京蓝科技	2,279,951.00	0.91
3	002435	长江润发	2,136,287.47	0.85
4	300344	太空板业	2,091,361.00	0.83
5	300218	安利股份	2,060,017.00	0.82
6	000985	大庆华科	2,040,270.00	0.81
7	002205	国统股份	2,028,807.00	0.81
8	600593	大连圣亚	2,014,637.00	0.80
9	300106	西部牧业	2,011,754.30	0.80
10	600213	亚星客车	2,005,897.34	0.80
11	000737	南风化工	2,001,525.18	0.80
12	000707	双环科技	1,988,708.00	0.79
13	000153	丰原药业	1,978,894.39	0.79
14	002058	威尔泰	1,977,905.00	0.79
15	002627	宜昌交运	1,976,449.36	0.79
16	000993	闽东电力	1,974,733.26	0.79
17	000713	丰乐种业	1,973,997.98	0.79
18	002420	毅昌股份	1,972,471.42	0.79
19	002715	登云股份	1,971,592.00	0.79
20	600099	林海股份	1,971,297.60	0.78

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	002760	凤形股份	2,983,638.31	1.19
2	002435	长江润发	2,310,620.56	0.92
3	000785	武汉中商	2,113,423.45	0.84
4	600593	大连圣亚	2,054,781.60	0.82

5	000993	闽东电力	2,053,404.40	0.82
6	002248	华东数控	2,051,828.01	0.82
7	300218	安利股份	2,050,214.79	0.82
8	000737	南风化工	2,049,775.19	0.82
9	002205	国统股份	2,048,397.30	0.82
10	000635	英力特	2,046,151.98	0.81
11	600985	雷鸣科化	2,031,781.12	0.81
12	000985	大庆华科	2,028,375.00	0.81
13	300344	太空板业	2,027,605.82	0.81
14	300174	元力股份	2,018,067.51	0.80
15	600148	长春一东	2,012,650.17	0.80
16	002058	威尔泰	2,010,527.92	0.80
17	600302	标准股份	2,005,449.52	0.80
18	600128	弘业股份	2,004,985.41	0.80
19	000707	双环科技	1,996,528.20	0.79
20	000153	丰原药业	1,995,586.61	0.79

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	358,337,735.08
卖出股票收入（成交）总额	360,191,316.90

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	224,956.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	287,919.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	512,875.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

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	000711	京蓝科技	1,389,458.00	0.55	停牌
2	002440	闰土股份	297,388.00	0.12	停牌
3	600859	王府井	212,600.52	0.08	停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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
9	26,361,354.56	227,195,120.63	95.76%	10,057,070.45	4.24%

9.2 期末上市基金前十名持有人

注：本基金未申请场内上市交易。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,005,705.33	4.2173%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本报告期末本公司高管、投研部门负责人及本基金基金经理未持有本基金份额。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	10,004,775.00	4.22	10,004,775.00	4.22	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,775.00	4.22	10,004,775.00	4.22	自基金合同生效之日起不少于3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年6月8日）基金份额总额	180,094,811.36
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	67,198,288.43
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	10,040,908.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	237,252,191.08
-------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	2	374,396,589.35	52.15%	273,796.65	52.15%	-
安信证券	2	343,541,467.64	47.85%	251,231.81	47.85%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	-	-	11,293,000,000.00	89.07%	-	-
安信证券	-	-	1,386,300,000.00	10.93%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2016年6月13日

2	金信基金管理有限公司关于参与天天基金费率优惠活动的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 14 日
3	金信基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 7 月 1 日
4	金信基金管理有限公司关于旗下基金增加陆金所资管为代销机构的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 7 月 18 日
5	金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 7 月 27 日
6	金信基金关于旗下部分基金增加中信证券、中信证券（山东）、中信期货、银河证券、金斧子、伯嘉基金和攀赢金融等 7 家机构为代销机构的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 8 月 29 日
7	金信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与银河证券日常申购费率优惠活动的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 8 月 29 日
8	金信基金管理有限公司关于股东及股东出资比例变更的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 9 月 30 日
9	金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 10 月 25 日
10	金信基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 11 月 11 日

11	金信基金管理有限公司关于参加上海利得基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 11 月 11 日
12	金信基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证券日报、证券时报、基金管理人的官方网站	2016 年 12 月 31 日

§ 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

《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

13.2 存放地点

基金管理人处：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502

13.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.jxfunds.com.cn。

金信基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日