

# 金信新能源汽车灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 26 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	金信新能源汽车混合
基金主代码	002256
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 1 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	31,738,329.26 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资受益于新能源汽车主题的上市公司股票，采用积极主动的分散化投资策略，在严密控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
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、资产配置策略 本基金在资产配置将根据宏观经济环境，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，及时确定基金资产在股票、债券、货币市场工具等各类资产上的投资比例，降低投资组合的风险，优化投资收益。</p> <p>2、股票投资策略 本基金股票资产将主要投资于新能源汽车行业相关的上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>5、衍生品投资策略</p> <p>1) 股指期货投资策略 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 权证为本基金辅助性投资工具。</p>
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×50% + 中证综合债指数收益率×50%

风险收益特征	本基金是以新能源汽车为投资主题的混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--------	---

### 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

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 4 月 1 日 (基金合同生效日)– 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-8,521,836.07	725,945.10	2,302,300.13
本期利润	-10,569,590.75	-6,536.88	-440,764.96
加权平均基金份额本期利润	-0.3428	-0.0002	-0.0144
本期基金份额净值增长率	-34.75%	0.20%	-1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3563	-0.0134	-0.0154
期末基金资产净值	20,429,620.59	30,153,993.75	29,703,716.78
期末基金份额净值	0.644	0.987	0.985

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。

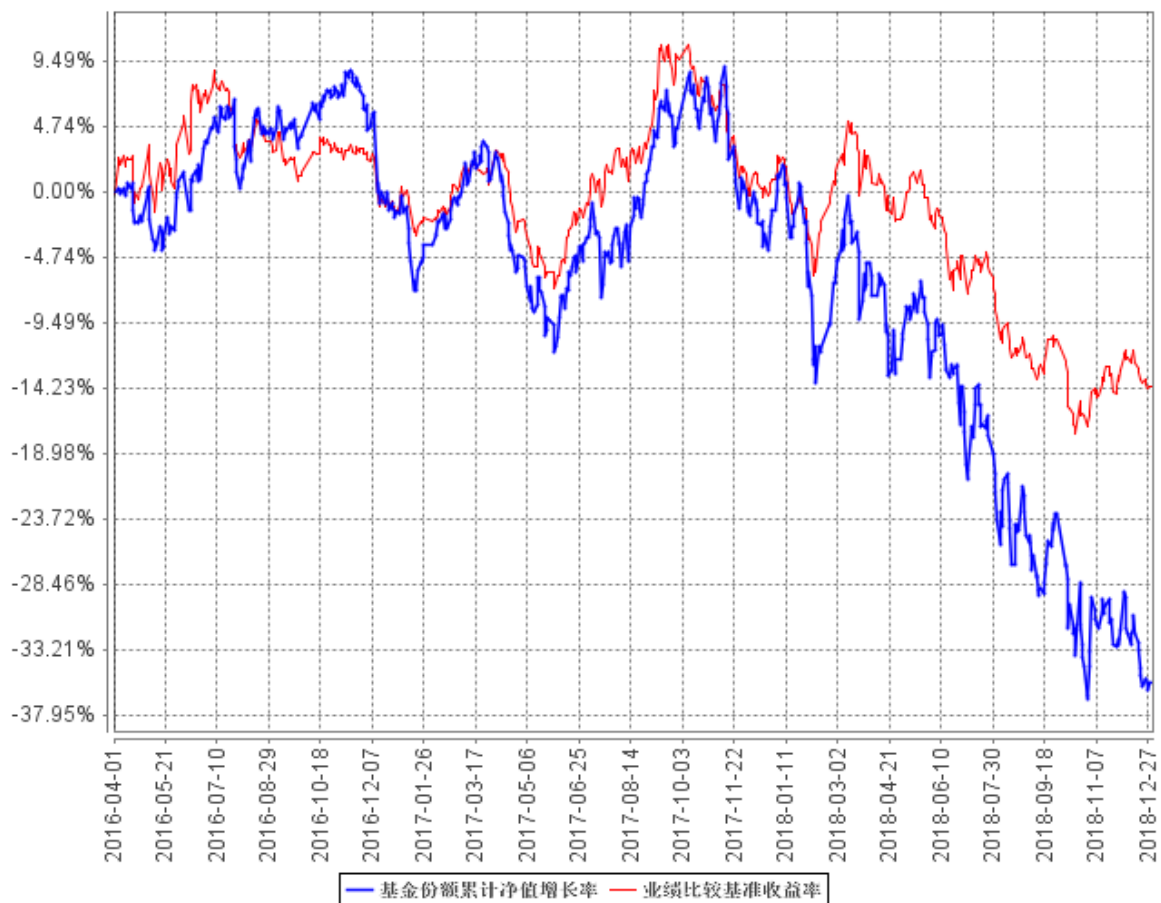
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-15.93%	2.07%	-5.41%	1.05%	-10.52%	1.02%
过去六个月	-24.94%	1.91%	-11.61%	0.92%	-13.33%	0.99%
过去一年	-34.75%	1.74%	-15.02%	0.93%	-19.73%	0.81%
自基金合同 生效起至今	-35.60%	1.30%	-14.20%	0.80%	-21.40%	0.50%

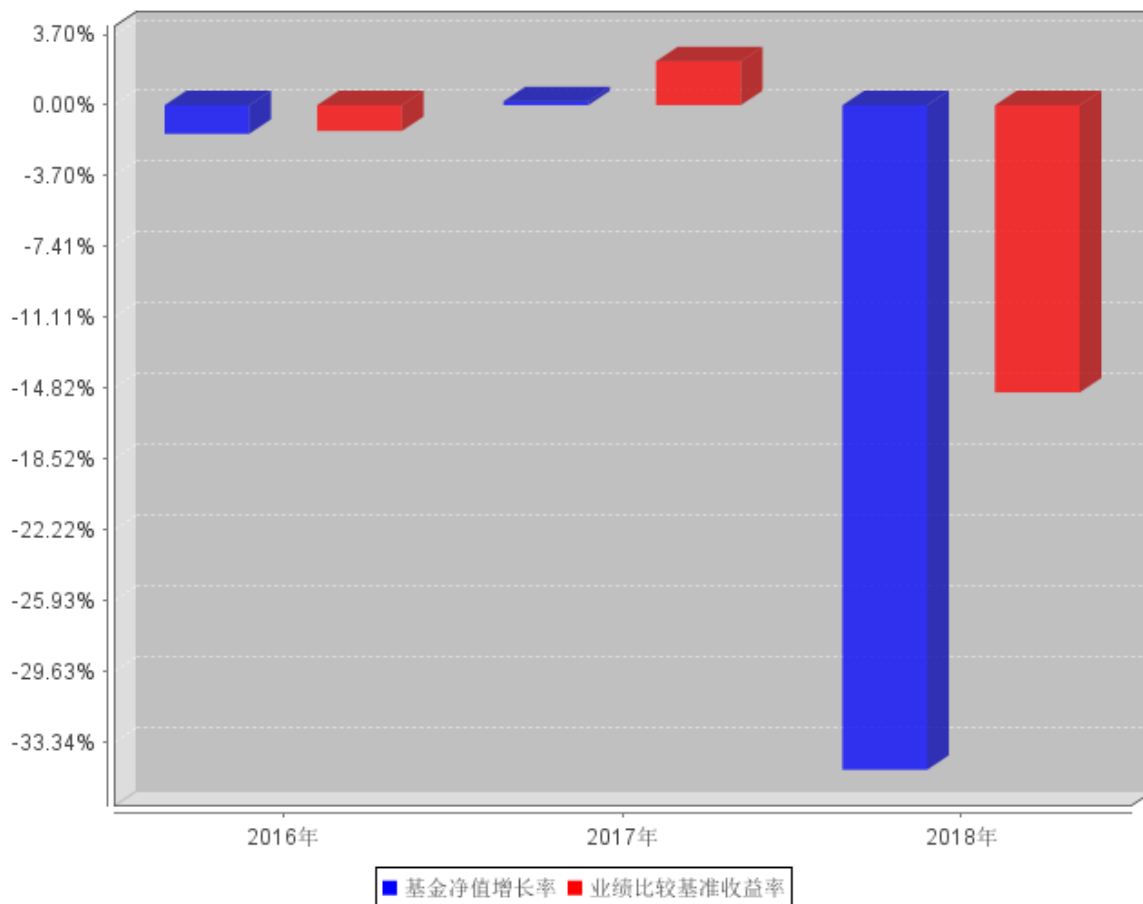
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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 4 月 1 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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金的基金合同于 2016 年 4 月 1 日生效，截止至 2018 年 12 月 31 日，本基金成立未满足 3 年。自合同生效起，本基金无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，金信基金管理有限公司管理资产规模超过 48.06 亿元，旗下管理 10 只开放式基金和 12 只专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘榕俊	本基金基金经理	2016 年 4 月 1 日	2018 年 8 月 1 日	16	男，北京大学经济学士、中国科学院金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于招商基金、景顺长城基金、英大证券资产管理部。现任金信基金投资决策委员会委员、基金经理。
杨仁眉	本基金基金经理	2018 年 8 月 1 日	-	6	男，西南财经大学金融学博士。2012 年 5 月起历任西南证券股份有限公司助理研究员、研究员、投资主办人、金信基金管理有限公司投资人员。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券



投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度和控制方法**

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）等有关法律法规的规定，针对股票、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

宏观经济相对进入了最坏阶段，同时也进入了全球政府联手出台相关政策解决问题的阶段。在此阶段，我们的投资策略需要做出相对积极的配置。因此，在投资中需要更加聚焦，投资标的需要更具有确定性与安全性才能成为组合中的主要持仓对象。在此过程，该组合将消费、医疗、高端制造业、教育、人工智能等相关行业的头部公司作为组合的主要配置对象。期间，组合中的

持仓比例也将根据公司发展战略、业务推进进度以及市场的估值水平进行动态的调整，保持组合的相对稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.644 元；本报告期基金份额净值增长率为-34.75%，业绩比较基准收益率为-15.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年全球经济进入了困难时期，中国经济也如此，各行业都出现了不同程度的增长下滑。但是，2018 年的经济在中美贸易分歧的影响下已经度过一个艰难的时期，2019 年经济将出现其自身规律的发展，也将逐步进入修复阶段。中国的经济发展将逐渐由过去的快速增长阶段，进入质量增长阶段，即高质量的经济发展阶段。

2019 年的经济在中美贸易摩擦中逐步复苏，特别是中美两国政府共同合作，形成包容、竞争、合作的商业格局。中国的优质企业逐步在国际市场展露头角，参与国际市场的商业竞争，为中国企业走向世界奠定了基础，也带动了产业链上相关公司的发展。虽然中国经济度过了最困难的阶段，但是面对复杂的国际经济发展局势 2019 年的经济发展中也存在诸多需要解决的问题，且相关的经济问题夹杂着地缘政治等复杂的问题，让 2019 年的经济发展更加的复杂。而复杂的经济发展中，也存在有相对确定的机会，中美两个大国已经着力于经济发展问题的解决。美联储调整货币政策，让美国经济在相对宽松的货币政策环境中配合其减税等相关财政政策的刺激，谋求新的发展阶段。同样，中国经济也在中国政府的大力减税降费环境中得以增长。中美两国的经济发展步入正轨后，世界分工体系也将在欧盟等发达国家的共同努力下确定新的合作、竞争关系，形成有序的世界分工体系，最后让各个地区在此分工体系中共同合作，推动全球经济的增长。在此约束条件下，2019 经济的发展也存在较大的机会，特别是高质量发展大门开启后，简政放权将进一步激活商业活力。同时，伴随金融、电信、能源等行业的改革开放力度加大，企业家精神也将被进一步激活，中国经济的投资、消费、出口也将进入一个新的发展阶段，产业结构也将出现重大转变，实现产业升级与产业转型。根据国际市场的历史数据以及规律，中国经济在此节点进入了一个新的发展时期，经济发展的轨迹也从数量增长进入质量发展轨道，高质量且具有国际市场定价权的优势产业在此阶段也将崛起成为一个地区走向世界的利器。因此，在此过程中，投资的策略也将更多聚焦于拥有高质量发展战略的公司与方向，分享公司成长带来的财富增长。2019 的资本市场也逐渐进入了市场底的阶段，资本市场的改革开放，也让资本市场的确定性得以回升，确定性的回升让金融资产的估值逐步修复，估值修复与资产质量的提升也为资本市场的投资提供了机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，报告期本基金无利润分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 20974 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	金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“金信新能源汽车混合基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了金信新能源汽车混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于金信新能源汽车混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>金信新能源汽车混合基金的基金管理人金信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估金信新能源汽车混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算金信新能源汽车混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督金信新能源汽车混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理

保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对金信新能源汽车混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金信新能源汽车混合基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	413,285.11	1,775,209.73
结算备付金		15,417.67	149,123.64
存出保证金		20,608.83	9,921.39
交易性金融资产	7.4.7.2	20,054,202.11	28,365,805.04
其中：股票投资		18,547,602.11	28,365,805.04
基金投资		-	-
债券投资		1,506,600.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	42,049.27	794.60
应收股利		-	-
应收申购款		894.66	31,952.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		20,546,457.65	30,332,806.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		3,789.56	-
应付管理人报酬		26,899.46	38,288.36
应付托管费		4,483.23	6,381.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,663.67	54,142.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	80,001.14	80,000.00
负债合计		116,837.06	178,812.71
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	31,738,329.26	30,562,741.06
未分配利润	7.4.7.10	-11,308,708.67	-408,747.31
所有者权益合计		20,429,620.59	30,153,993.75
负债和所有者权益总计		20,546,457.65	30,332,806.46

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.644 元，基金份额总额

31,738,329.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-9,743,147.75	805,921.11
1. 利息收入		47,292.53	16,386.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,396.46	16,386.87
债券利息收入		31,068.50	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,827.57	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,756,555.59	1,506,867.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,002,036.65	1,365,247.23
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	245,481.06	141,620.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,047,754.68	-732,481.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	13,869.99	15,148.27
<b>减：二、费用</b>		826,443.00	812,457.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	382,368.31	450,672.97



2. 托管费	7.4.10.2.2	63,728.06	75,112.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	299,307.48	206,082.78
5. 利息支出		174.15	-
其中：卖出回购金融资产支出		174.15	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	80,865.00	80,590.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-10,569,590.75	-6,536.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-10,569,590.75	-6,536.88

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,562,741.06	-408,747.31	30,153,993.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-10,569,590.75	-10,569,590.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,175,588.20	-330,370.61	845,217.59
其中：1. 基金申购款	3,463,161.51	-850,435.40	2,612,726.11
2. 基金赎回款	-2,287,573.31	520,064.79	-1,767,508.52
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	31,738,329.26	-11,308,708.67	20,429,620.59
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,169,352.36	-465,635.58	29,703,716.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,536.88	-6,536.88
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）	393,388.70	63,425.15	456,813.85
其中：1. 基金申购款	2,354,289.06	116,043.66	2,470,332.72
2. 基金赎回款	-1,960,900.36	-52,618.51	-2,013,518.87
五、期末所有者权益（基金净值）	30,562,741.06	-408,747.31	30,153,993.75

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：

_____ 殷克胜	_____ 殷克胜	_____ 陈瑾
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

金信新能源汽车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]447号《关于准予金信新能源汽车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《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信新能源汽车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,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31,122,709.37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361号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年4月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为31,130,144.76份基金份额,其中认购资金利息折合7,435.39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,发起资金认购部分为20,001,150.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信新能源汽车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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于新能源汽车主题相关的股票不低于非现金资产的 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在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证新能源汽车指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人金信基金管理有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

#### 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》、《金信新能源汽车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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于 2018 年 12 月 31 日，本基金的基金资产净值为 20,429,620.59 元，且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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。

#### 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。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变动计入当期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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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。

#### 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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬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。

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

每一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[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 22 日前，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的初始投资成本，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的初始投资成本，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。自 2017 年 12 月 22 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。



(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 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(“金信基金”)	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(“招商银行”)	基金托管人
深圳市卓越创业投资有限责任公司(“深圳卓越创投”)	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司(“安徽国元信托”)	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	382,368.31	450,672.97
其中：支付销售机构的客户维护费	4,538.23	2,683.73

注：支付基金管理人金信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	63,728.06	75,112.24

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳卓越创投	10,001,625.00	31.51%	10,001,625.00	32.72%
安徽国元	9,999,525.00	31.51%	9,999,525.00	32.72%

信托				
----	--	--	--	--

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	413,285.11	7,891.87	1,775,209.73	15,406.95

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 18,547,602.11 元，属于第二层次的余额为 1,506,600.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 27,715,745.04 元，第二层次 650,060.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，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	18,547,602.11	90.27
	其中：股票	18,547,602.11	90.27
3	固定收益投资	1,506,600.00	7.33
	其中：债券	1,506,600.00	7.33
7	银行存款和结算备付金合计	428,702.78	2.09
8	其他各项资产	63,552.76	0.31
9	合计	20,546,457.65	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 (%)
C	制造业	12,646,553.41	61.90
J	金融业	847,110.00	4.15
L	租赁和商务服务业	526,400.00	2.58
Q	卫生和社会工作	4,527,538.70	22.16
	合计	18,547,602.11	90.79

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600887	伊利股份	87,032	1,991,292.16	9.75
2	600519	贵州茅台	3,300	1,947,033.00	9.53
3	000333	美的集团	51,700	1,905,662.00	9.33
4	002044	美年健康	125,172	1,871,321.40	9.16
5	300015	爱尔眼科	69,001	1,814,726.30	8.88
6	300124	汇川技术	83,300	1,677,662.00	8.21
7	000858	五粮液	32,300	1,643,424.00	8.04
8	601231	环旭电子	142,048	1,278,432.00	6.26
9	002008	大族激光	36,600	1,111,176.00	5.44

10	600276	恒瑞医药	20,699	1,091,872.25	5.34
----	--------	------	--------	--------------	------

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

## 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002044	美年健康	4,163,349.96	13.81
2	002340	格林美	3,535,034.00	11.72
3	300718	长盛轴承	3,396,575.33	11.26
4	600521	华海药业	3,096,352.80	10.27
5	002415	海康威视	3,045,499.00	10.10
6	300347	泰格医药	2,969,892.00	9.85
7	600703	三安光电	2,942,579.00	9.76
8	600276	恒瑞医药	2,879,895.00	9.55
9	000333	美的集团	2,742,555.00	9.10
10	300124	汇川技术	2,726,372.00	9.04
11	600887	伊利股份	2,698,414.00	8.95
12	002373	千方科技	2,671,010.07	8.86
13	300003	乐普医疗	2,646,032.00	8.78
14	300015	爱尔眼科	2,639,033.00	8.75
15	600031	三一重工	2,592,810.00	8.60
16	002334	英威腾	2,540,283.00	8.42
17	601012	隆基股份	2,524,672.00	8.37
18	601231	环旭电子	2,405,897.00	7.98
19	002032	苏泊尔	2,400,318.00	7.96
20	000513	丽珠集团	2,301,717.00	7.63
21	002294	信立泰	2,259,095.00	7.49
22	300304	云意电气	2,207,961.00	7.32
23	600519	贵州茅台	2,122,983.00	7.04
24	000858	五粮液	2,053,852.00	6.81
25	002008	大族激光	1,923,465.60	6.38
26	000001	平安银行	1,890,818.00	6.27
27	300001	特锐德	1,718,060.00	5.70

28	000069	华侨城 A	1,715,675.00	5.69
29	002027	分众传媒	1,582,780.00	5.25
30	600050	中国联通	1,572,342.00	5.21
31	300098	高新兴	1,399,542.00	4.64
32	002279	久其软件	1,371,183.00	4.55
33	000681	视觉中国	1,296,840.00	4.30
34	300607	拓斯达	1,282,020.00	4.25
35	002475	立讯精密	1,222,547.00	4.05
36	600068	葛洲坝	1,213,638.00	4.02
37	601098	中南传媒	1,191,320.00	3.95
38	600409	三友化工	1,189,080.00	3.94
39	300401	花园生物	1,188,032.00	3.94
40	002594	比亚迪	1,177,806.00	3.91
41	000977	浪潮信息	1,170,136.00	3.88
42	603960	克来机电	1,122,484.20	3.72
43	300316	晶盛机电	1,109,432.00	3.68
44	600588	用友网络	1,087,940.00	3.61
45	600048	保利地产	1,076,560.00	3.57
46	002074	国轩高科	1,048,212.80	3.48
47	002925	盈趣科技	1,043,513.00	3.46
48	601002	晋亿实业	1,030,225.00	3.42
49	600136	当代明诚	1,021,334.00	3.39
50	601318	中国平安	1,013,284.00	3.36
51	002648	卫星石化	1,002,906.00	3.33
52	600884	杉杉股份	978,760.00	3.25
53	600525	长园集团	918,516.00	3.05
54	000425	徐工机械	884,930.00	2.93
55	002583	海能达	871,117.00	2.89
56	000888	峨眉山 A	860,262.00	2.85
57	300258	精锻科技	817,988.00	2.71
58	300136	信维通信	800,509.00	2.65
59	000100	TCL 集团	799,200.00	2.65
60	300197	铁汉生态	764,053.00	2.53
61	000997	新大陆	721,180.00	2.39
62	000823	超声电子	704,688.00	2.34
63	002456	欧菲科技	701,044.00	2.32

64	300183	东软载波	671,679.00	2.23
65	600522	中天科技	671,400.00	2.23
66	600388	龙净环保	666,591.00	2.21
67	600583	海油工程	603,840.00	2.00

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600031	三一重工	4,287,721.55	14.22
2	300718	长盛轴承	3,562,597.94	11.81
3	601012	隆基股份	3,342,170.00	11.08
4	002340	格林美	3,277,471.00	10.87
5	603960	克来机电	3,188,356.30	10.57
6	600521	华海药业	3,170,855.00	10.52
7	600703	三安光电	3,104,510.00	10.30
8	300003	乐普医疗	2,770,942.08	9.19
9	600050	中国联通	2,563,896.00	8.50
10	002294	信立泰	2,428,885.00	8.05
11	002032	苏泊尔	2,410,677.00	7.99
12	002415	海康威视	2,359,015.09	7.82
13	002373	千方科技	2,349,470.00	7.79
14	000513	丽珠集团	2,267,130.00	7.52
15	002044	美年健康	2,192,531.46	7.27
16	002334	英威腾	2,126,664.00	7.05
17	000425	徐工机械	2,123,120.00	7.04
18	000001	平安银行	1,926,214.00	6.39
19	000888	峨眉山A	1,837,138.00	6.09
20	300304	云意电气	1,826,512.00	6.06
21	000069	华侨城A	1,762,347.00	5.84
22	300001	特锐德	1,682,592.00	5.58
23	600366	宁波韵升	1,500,371.00	4.98
24	600699	均胜电子	1,490,861.98	4.94
25	000758	中色股份	1,462,582.00	4.85
26	002456	欧菲科技	1,458,625.00	4.84
27	300098	高新兴	1,434,932.00	4.76



28	600418	江淮汽车	1,416,608.00	4.70
29	000050	深天马 A	1,408,557.47	4.67
30	002279	久其软件	1,396,840.00	4.63
31	600549	厦门钨业	1,364,008.00	4.52
32	300347	泰格医药	1,347,778.45	4.47
33	002027	分众传媒	1,339,358.44	4.44
34	000681	视觉中国	1,324,786.60	4.39
35	000970	中科三环	1,239,299.00	4.11
36	600048	保利地产	1,198,880.00	3.98
37	000977	浪潮信息	1,194,664.71	3.96
38	300607	拓斯达	1,194,475.00	3.96
39	300401	花园生物	1,172,144.00	3.89
40	002475	立讯精密	1,163,376.23	3.86
41	600584	长电科技	1,161,340.00	3.85
42	601098	中南传媒	1,132,417.00	3.76
43	600588	用友网络	1,131,817.00	3.75
44	300316	晶盛机电	1,126,930.00	3.74
45	002249	大洋电机	1,120,465.00	3.72
46	600068	葛洲坝	1,100,304.00	3.65
47	600409	三友化工	1,079,364.00	3.58
48	002594	比亚迪	1,066,989.00	3.54
49	600884	杉杉股份	1,058,687.00	3.51
50	600276	恒瑞医药	1,053,687.66	3.49
51	002055	得润电子	1,039,344.00	3.45
52	601231	环旭电子	1,024,044.21	3.40
53	600136	当代明诚	958,265.00	3.18
54	600820	隧道股份	954,096.00	3.16
55	002925	盈趣科技	945,700.00	3.14
56	601002	晋亿实业	919,500.00	3.05
57	002648	卫星石化	913,400.00	3.03
58	600525	长园集团	861,513.00	2.86
59	300258	精锻科技	819,929.00	2.72
60	000100	TCL 集团	804,000.00	2.67
61	300136	信维通信	795,560.00	2.64
62	601668	中国建筑	786,400.00	2.61
63	000997	新大陆	772,796.00	2.56
64	600522	中天科技	763,600.00	2.53
65	300197	铁汉生态	754,188.00	2.50

66	300183	东软载波	738,895.00	2.45
67	000823	超声电子	728,604.00	2.42
68	002074	国轩高科	716,880.50	2.38
69	002583	海能达	692,400.00	2.30
70	600340	华夏幸福	684,200.00	2.27
71	600388	龙净环保	678,876.00	2.25
72	600066	宇通客车	636,672.25	2.11
73	600583	海油工程	624,000.00	2.07
74	600267	海正药业	617,797.00	2.05

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	124,930,764.27
卖出股票收入（成交）总额	124,693,625.87

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

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（%）
3	金融债券	1,506,600.00	7.37
	其中：政策性金融债	1,506,600.00	7.37
10	合计	1,506,600.00	7.37

### 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	018005	国开 1701	15,000	1,506,600.00	7.37

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 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

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 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：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 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受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	20,608.83
4	应收利息	42,049.27
5	应收申购款	894.66
9	合计	63,552.76

### 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**

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中未有存在流通受限的情况。

### **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
244	130,075.12	30,005,408.85	94.54%	1,732,920.41	5.46%

### 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

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

### 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：本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金份额。

### 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
基金管理人股东	20,001,150.00	63.02	20,001,150.00	63.02	自合同生效 之日起不少 于3年
合计	20,001,150.00	63.02	20,001,150.00	63.02	自合同生效 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4月1日）基金份额总额	31,130,144.76
本报告期期初基金份额总额	30,562,741.06
本报告期期间基金总申购份额	3,463,161.51
减:本报告期期间基金总赎回份额	2,287,573.31
本报告期期末基金份额总额	31,738,329.26

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

本基金管理人 2018 年 8 月 31 日公告，金信基金管理有限公司聘任邵若昊先生为公司副总经理。

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无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 30,000 元。

### 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	
中信建投	2	290,624,595.29	36.31%	37,273.95	24.45%	-
安信证券	4	59,343,266.79	23.77%	43,397.96	28.46%	-
东兴证券	1	34,581,110.23	13.85%	24,597.56	16.13%	-
广发证券	4	31,784,601.63	12.73%	23,244.08	15.25%	-
海通证券	1	19,265,162.40	7.72%	13,703.17	8.99%	-
国信证券	2	14,018,973.80	5.62%	10,252.12	6.72%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

万联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

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
中信建投	1,501,050.00	100.00%	42,800,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-



---

国盛证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018.01.01-2018.12.31	9,999,525.00	-	-	9,999,525.00	31.51%
	2	2018.01.01-2018.12.31	10,003,200.00	-	-	10,003,200.00	31.52%
	3	2018.01.01-2018.12.31	10,001,625.00	-	-	10,001,625.00	31.51%

#### 产品特有风险

##### 1、大额赎回风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

##### 2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

金信基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日