

# 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 4 季度报告

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

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	金信转型创新成长混合
场内简称	-
交易代码	002810
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	237,252,191.08 份
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	本基金基于经济转型行业，包括新兴产业和传统产业中的优势企业，以及受益于创新的行业，包括新技术、新业态、新模式等，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。
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	本基金为混合型基金，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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	3,739,244.95
2. 本期利润	3,836,671.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0161
4. 期末基金资产净值	251,141,888.83
5. 期末基金份额净值	1.059

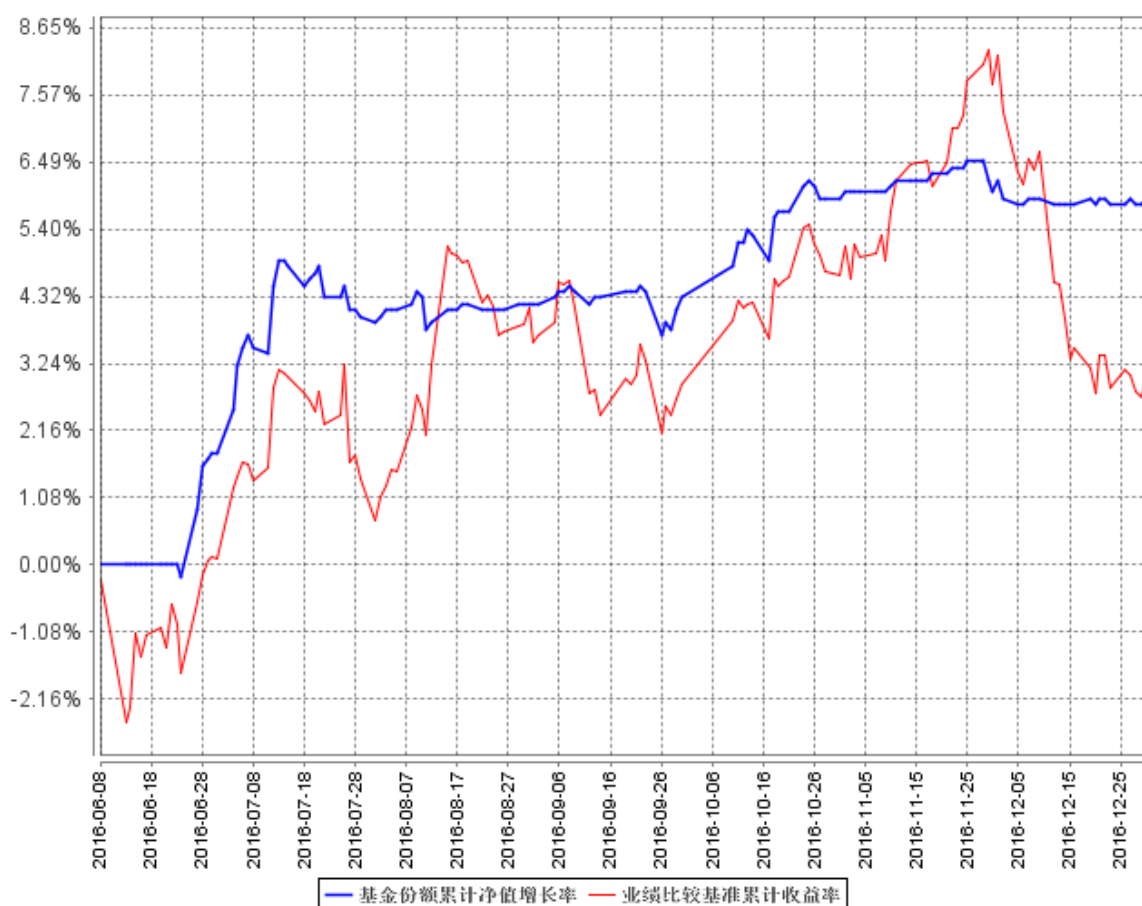
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。
--	--	--	--	--	---------

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”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离职日期”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《证券业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》等有关法律法规、中国证监会和《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》的规定，遵循诚实信用、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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 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。

### 4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，本基金依然立足于中国经济转型创新的大方向，采取择时与组合管理的策略，一方面，低估值蓝筹组合为我们的投资提供了较好的安全边际，另一方面，中小市值的成长类转型创新个股为我们的组合提供了弹性增长空间。着眼未来，12 月份的经济工作会议明确了货币政策保持“稳健中性”的大方向，顶层设计者越来越倾向于注重改革和经济增长的质量，对经济增速的硬约束有所放缓。

我们将继续坚持转型创新成长的大方向，密切关注宏观经济政策变化，灵活调整股票仓位，在尽力规避市场风险的前提下，力求给投资者带来长期稳健的收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值增长 1.53%，同期业绩比较基准增长 0.10%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

# §5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	150,882,131.95	59.94
8	其他资产	512,875.85	0.20
9	合计	251,723,365.79	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	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

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金报告期末未持有沪港通股票。

### 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	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

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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投资股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

-

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

-

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。



### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	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	重大事项
2	002440	闰土股份	297,388.00	0.12	重大事项
3	600859	王府井	212,600.52	0.08	重大事项

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	242,228,451.43
报告期期间基金总申购份额	48,342.59
减：报告期期间基金总赎回份额	5,024,602.94
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	237,252,191.08

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 报告期末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	自合同生效之日起不少于3年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 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
- 2、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

## 10.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502。

## 10.3 查阅方式

基金份额持有人可以到存放地点查阅文件。

金信基金管理有限公司  
2017 年 1 月 19 日