

# 金信新能源汽车灵活配置混合型发起式证 券投资基金 2016 年年度报告 摘要

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

### 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 4 月 1 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 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	30,169,352.36 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</p> <p>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</p> <p>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。通过基本面分析，结合国内外行业发展的不同驱动因素，投资受益于国际产业链分工及技术进步的新能源汽车上市公司股票，力求为投资人带来稳定的资本增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。通过债券品种的动态配置与优化配比，动态调整固定收益证券组合的久期、银行间市场和交易所市场的投资比重，并相应调整不同债券品种间的配比，在较低风险条件下获得稳定投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券，定价受多种因素影响，包括市场利率、</p>

	<p>发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等。本基金将深入分析上述基本面因素，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</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

### § 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4月1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	2,302,300.13	-	-
本期利润	-440,764.96	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0144	-	-
本期基金份额净值增长率	-1.50%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0154	-	-
期末基金资产净值	29,703,716.78	-	-
期末基金份额净值	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。

4、本基金的基金合同于 2016 年 4 月 1 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

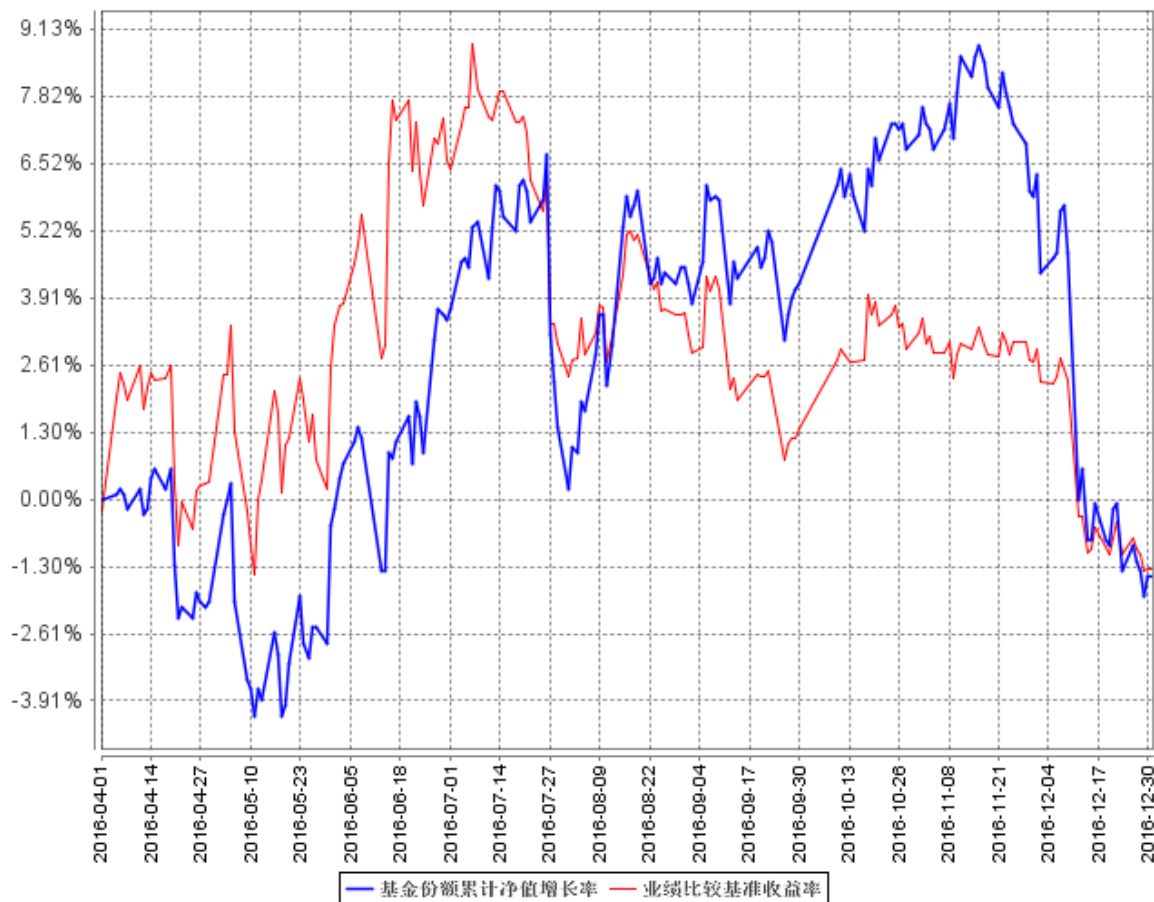
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.47%	0.85%	-2.70%	0.50%	-2.77%	0.35%
过去六个月	-4.83%	0.85%	-7.00%	0.57%	2.17%	0.28%
自基金合同生效起至今	-1.50%	0.88%	-1.35%	0.77%	-0.15%	0.11%

注：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%

##### 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

## 费率变动的比较

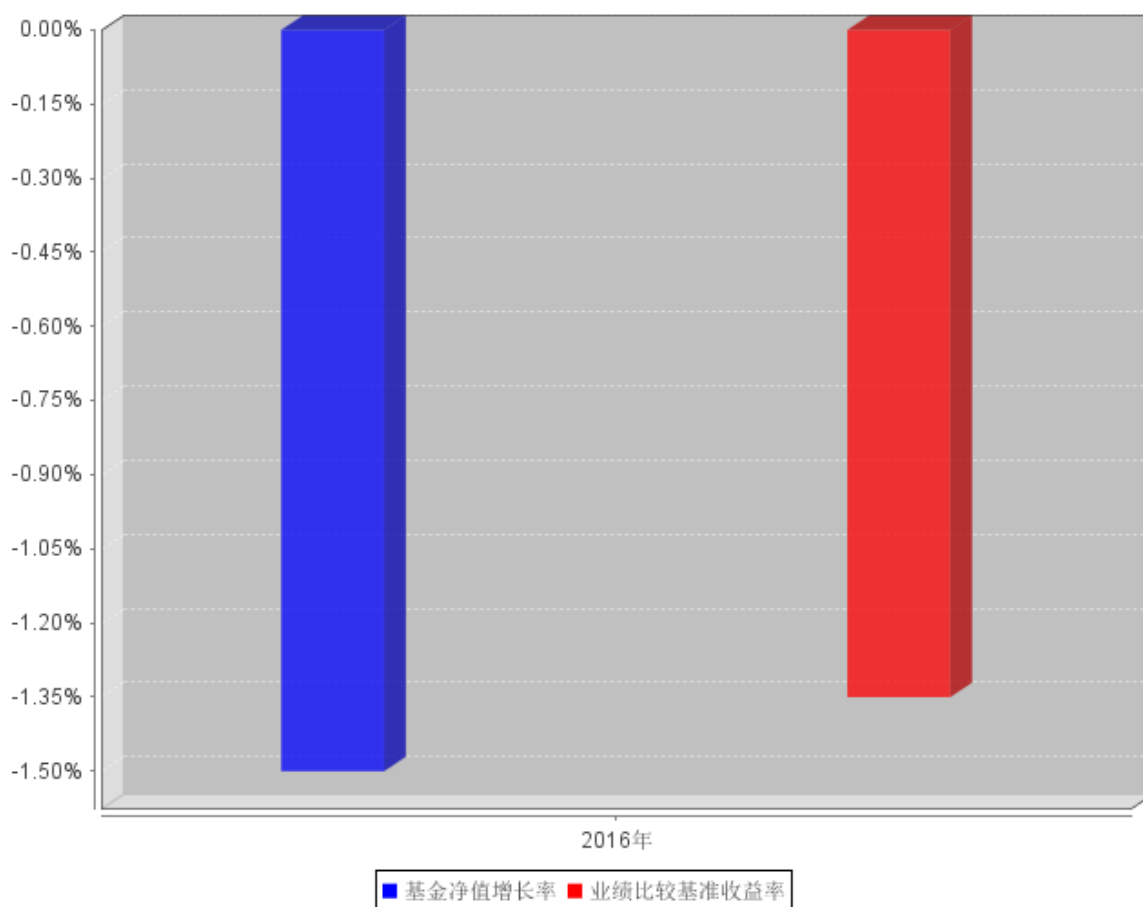
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 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；截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满 1 年。

### 3.3 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 4 月 1 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4月1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。

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》等有关法律法规及有关各项实施准则、《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

2016 年新能源汽车行业先扬后抑，整体表现出现较大的波动，新能源汽车销量预期降低、补贴政策不确定等因素继续困扰行业，增速放缓的新能源汽车行业整体表现不佳。展望 2017 年，由汽车驾驶衍生出来的智能监测、交通优化、消费娱乐应用将快速发展，汽车电动化和智能化未来的发展空间巨大，新能源汽车产业链较长，行业中的公司将在竞争中走向分化，我们关注在资源整合、市场开拓、研发技术方面具备优势的企业。

本基金密切关注市场环境的变化，总体上我们将采用把握波段、精选个股的投资策略，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。

### 4.4.2 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 0.985 元，报告期内单位净值增长率为-1.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，利好利空因素交织，市场分歧仍然较大，市场震荡仍然难免，经历了股灾和反复震荡，市场参与者对风险的防控会更加关注，另一方面，下跌也是风险释放，目前创业板的估值已有显著调整，蓝筹股的估值仍然处于历史低位，2017 年金融体制改革、资源品价格改革、国企改革、国防军队改革等都将稳步推进，政策着重抑制资产泡沫和防范金融风险，经济失速下行的可能性大幅度降低，国企改革、汇率贬值幅度和经济增长数据等都有发生预期背离的可能，进而引发修复行情，随着时间的推移和中长期资金的逐步入市，不确定性的消除有利于市场走好，2017 年市场存在可观的机会。

#### 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。

#### 4.10 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《金信新能源汽车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，金信新能源汽车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新能源汽车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，金信新能源汽车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新能源汽车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（2017）第 20326 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
引言段	我们审计了后附的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 4 月 1 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	编制和公允列报财务报表是金信新能源汽车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: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述金信新能源汽车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,公允反映了金信新能源汽车混合型发起式基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 1 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：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
<b>资产：</b>		
银行存款		1,630,613.56
结算备付金		63,042.32
存出保证金		19,851.88
交易性金融资产		28,073,957.53
其中：股票投资		28,073,957.53
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		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		57,911.73
应收利息		406.65
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		29,845,783.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 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		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		968.44
应付管理人报酬		38,903.97
应付托管费		6,483.98
应付销售服务费		-
应付交易费用		17,709.77
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		78,000.73
负债合计		142,066.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		30,169,352.36
未分配利润		-465,635.58
所有者权益合计		29,703,716.78
负债和所有者权益总计		29,845,783.67

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.985 元，基金份额总额 30,169,352.36 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 1 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：2016 年 4 月 1 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 4 月 1 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		177,991.59
1. 利息收入		48,276.42
其中：存款利息收入		47,723.64
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		552.78
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,866,723.96
其中：股票投资收益		2,706,233.83

基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		160,490.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,743,065.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		6,056.30
<b>减：二、费用</b>		618,756.55
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	352,817.93
2. 托管费	7.4.8.2.2	58,802.90
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-
4. 交易费用		128,260.72
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		78,875.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-440,764.96
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-440,764.96

### 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：2016 年 4 月 1 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 4 月 1 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）	31,130,144.76	-	31,130,144.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-440,764.96	-440,764.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-960,792.40	-24,870.62	-985,663.02



(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	526,473.28	25,330.97	551,804.25
2. 基金赎回款	-1,487,265.68	-50,201.59	-1,537,467.27
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）	30,169,352.36	-465,635.58	29,703,716.78

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基金,存续期限不定,首次募集期间为2016年3月17日至2016年3月25日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集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,发起资金来源于基金管理人的股东。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、可转换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(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%;其中投资于新能源汽车主题相关的股票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:中证新能源汽车指数收益率 $\times$ 50%+中证综合债指数收益率 $\times$ 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。

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 4 月 1 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 4 月 1 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。

#### 7.4.5 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 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
安徽国元信托有限责任公司	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
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。

## 7.4.8 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

#### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

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。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

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。

### 7.4.8.2 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
	2016年4月1日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	352,817.93
其中：支付销售机构的客户维护费	3,058.42

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年4月1日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	58,802.90

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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

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

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。

#### 7.4.8.4 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

本报告期内基金管理人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 2016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
安徽国元信托有限责	9,999,525.00	33.1446%

任公司		
深圳市卓越创业投资有限公司	10,001,625.00	33.1516%

#### 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 2016年4月1日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,630,613.56	46,623.61

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

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2016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

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。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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。

###### 7.4.9.3.2 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。

## 7.4.10 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 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 28073957.53 元，属于第二层次的余额为 0 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	28,073,957.53	94.06
	其中：股票	28,073,957.53	94.06
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	-	-
	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	1,693,655.88	5.67
7	其他各项资产	78,170.26	0.26
8	合计	29,845,783.67	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	-	-
B	采矿业	2,316,621.00	7.80
C	制造业	20,723,783.59	69.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,300.00	0.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	866,877.94	2.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,188,557.00	7.37
J	金融业	1,717,168.00	5.78
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	208,650.00	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-



P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,073,957.53	94.51

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	002475	立讯精密	82,000	1,701,500.00	5.73
2	601689	拓普集团	56,000	1,647,520.00	5.55
3	002450	康得新	84,340	1,611,737.40	5.43
4	300183	东软载波	63,000	1,557,360.00	5.24
5	000758	中色股份	188,900	1,509,311.00	5.08
6	600584	长电科技	85,000	1,500,250.00	5.05
7	600699	均胜电子	44,000	1,455,960.00	4.90
8	600405	动力源	124,295	1,388,375.15	4.67
9	002055	得润电子	56,500	1,339,615.00	4.51
10	002456	欧菲光	38,000	1,302,640.00	4.39

### 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	002456	欧菲光	3,854,413.86	12.98
2	000758	中色股份	2,813,468.00	9.47
3	002230	科大讯飞	2,596,198.00	8.74

4	601318	中国平安	2,306,704.30	7.77
5	601689	拓普集团	1,746,320.00	5.88
6	002055	得润电子	1,714,641.00	5.77
7	600699	均胜电子	1,610,951.00	5.42
8	600584	长电科技	1,580,004.00	5.32
9	300183	东软载波	1,578,591.24	5.31
10	600518	康美药业	1,576,732.00	5.31
11	600405	动力源	1,569,846.60	5.29
12	002475	立讯精密	1,551,698.00	5.22
13	000429	粤高速 A	1,546,224.00	5.21
14	002450	康得新	1,478,162.02	4.98
15	002249	大洋电机	1,478,034.00	4.98
16	002121	科陆电子	1,455,861.00	4.90
17	000970	中科三环	1,451,940.00	4.89
18	002008	大族激光	1,346,750.00	4.53
19	600459	贵研铂业	1,330,948.00	4.48
20	002454	松芝股份	1,243,343.24	4.19
21	600432	*ST 吉恩	1,162,239.10	3.91
22	300134	大富科技	1,130,111.00	3.80
23	600497	驰宏锌锗	1,122,320.00	3.78
24	002196	方正电机	1,098,570.92	3.70
25	600030	中信证券	1,044,237.00	3.52
26	600366	宁波韵升	1,043,569.00	3.51
27	002594	比亚迪	1,028,980.00	3.46
28	600259	广晟有色	981,604.00	3.30
29	600270	外运发展	980,107.26	3.30
30	603589	口子窖	959,174.00	3.23
31	600418	江淮汽车	946,567.00	3.19
32	600074	保千里	874,392.00	2.94
33	000063	中兴通讯	792,040.00	2.67
34	300160	秀强股份	789,089.00	2.66
35	600360	华微电子	756,303.00	2.55
36	600406	国电南瑞	702,178.00	2.36
37	600362	江西铜业	664,551.00	2.24
38	603885	吉祥航空	652,165.87	2.20
39	600168	武汉控股	646,104.00	2.18

40	002053	云南能投	643,151.12	2.17
41	000998	隆平高科	637,441.00	2.15
42	000625	长安汽车	637,230.00	2.15

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	002456	欧菲光	2,847,617.00	9.59
2	002230	科大讯飞	1,938,121.25	6.52
3	000429	粤高速 A	1,688,932.00	5.69
4	601318	中国平安	1,687,879.76	5.68
5	600432	*ST 吉恩	1,451,676.22	4.89
6	002008	大族激光	1,404,200.00	4.73
7	002196	方正电机	1,309,980.00	4.41
8	600497	驰宏锌锗	1,298,228.23	4.37
9	000758	中色股份	1,255,320.00	4.23
10	300134	大富科技	1,254,980.00	4.22
11	600459	贵研铂业	1,236,003.00	4.16
12	600518	康美药业	1,105,150.00	3.72
13	603589	口子窖	1,024,271.00	3.45
14	600360	华微电子	895,515.50	3.01
15	300160	秀强股份	877,558.00	2.95
16	000063	中兴通讯	814,210.00	2.74
17	600074	保千里	765,315.00	2.58
18	002053	云南能投	735,371.08	2.48
19	603885	吉祥航空	723,239.00	2.43
20	600406	国电南瑞	719,827.00	2.42
21	600362	江西铜业	707,583.25	2.38
22	000998	隆平高科	637,218.00	2.15
23	600166	福田汽车	624,000.00	2.10
24	600168	武汉控股	619,577.00	2.09
25	000625	长安汽车	616,686.00	2.08

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	67,761,873.74
卖出股票收入（成交）总额	39,651,084.95

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

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

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 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

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	19,851.88
2	应收证券清算款	57,911.73
3	应收股利	-
4	应收利息	406.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	78,170.26
---	----	-----------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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
48	628,528.17	30,004,350.00	99.45%	165,002.36	0.55%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

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	0.00	0.0000%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	20,001,150.00	66.29	20,001,150.00	66.29	自基金合同生效之日起不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	20,001,150.00	66.29	20,001,150.00	66.29	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	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	526,473.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,487,265.68
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）	-
本报告期期末基金份额总额	30,169,352.36

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	
安信证券	2	104,591,395.24	97.40%	76,487.36	96.72%	-
广发证券	2	2,789,206.50	2.60%	2,597.67	3.28%	-
中投证券	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
安信证券	-	-	4,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

**§ 12 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  
2017年3月29日