

信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准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 10 月 19 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62

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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	64
§10 开放式基金份额变动	64
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信达澳银新目标混合
场内简称	-
基金主代码	003456
交易代码	003456
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 19 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	200,038,082.58 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，通过对不同类别资产的优化配置，严选安全边际较高的股票、债券等进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，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		信达澳银基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	陆志俊
	联系电话	0755-83172666	95559

	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216
注册地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层 和第 9 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层 和第 9 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		518054	200120
法定代表人		于建伟	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-70,973.29

本期利润	-3,968,217.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0198
本期加权平均净值利润率	-2.00%
本期基金份额净值增长率	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	-3,968,217.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0198
期末基金资产净值	196,069,865.01
期末基金份额净值	0.980
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-2.00%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效起至今	-2.00%	0.26%	-0.25%	0.36%	-1.75%	-0.10%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

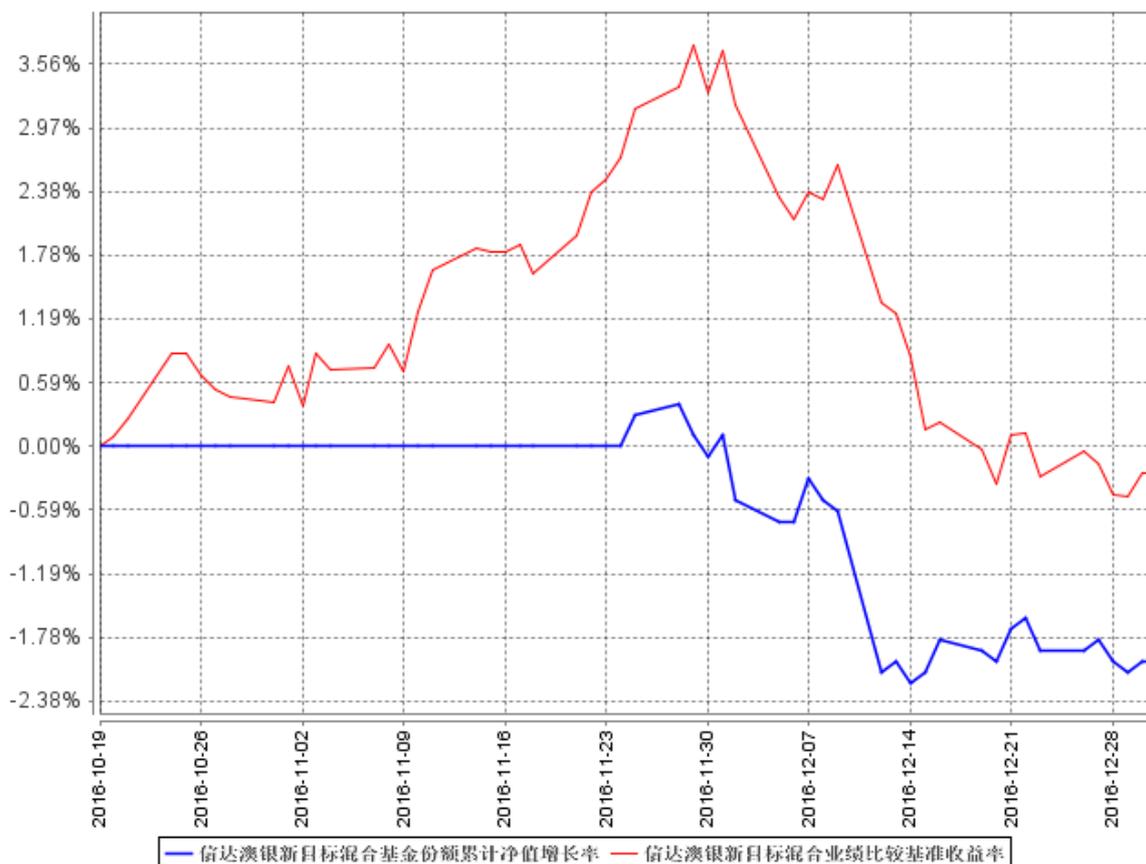
沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，上证国债指数收益率是由上海证券交易所编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和上海证券交易所网站：

<http://www.csindex.com.cn>

<http://www.sse.com.cn>

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

信达澳银新目标混合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

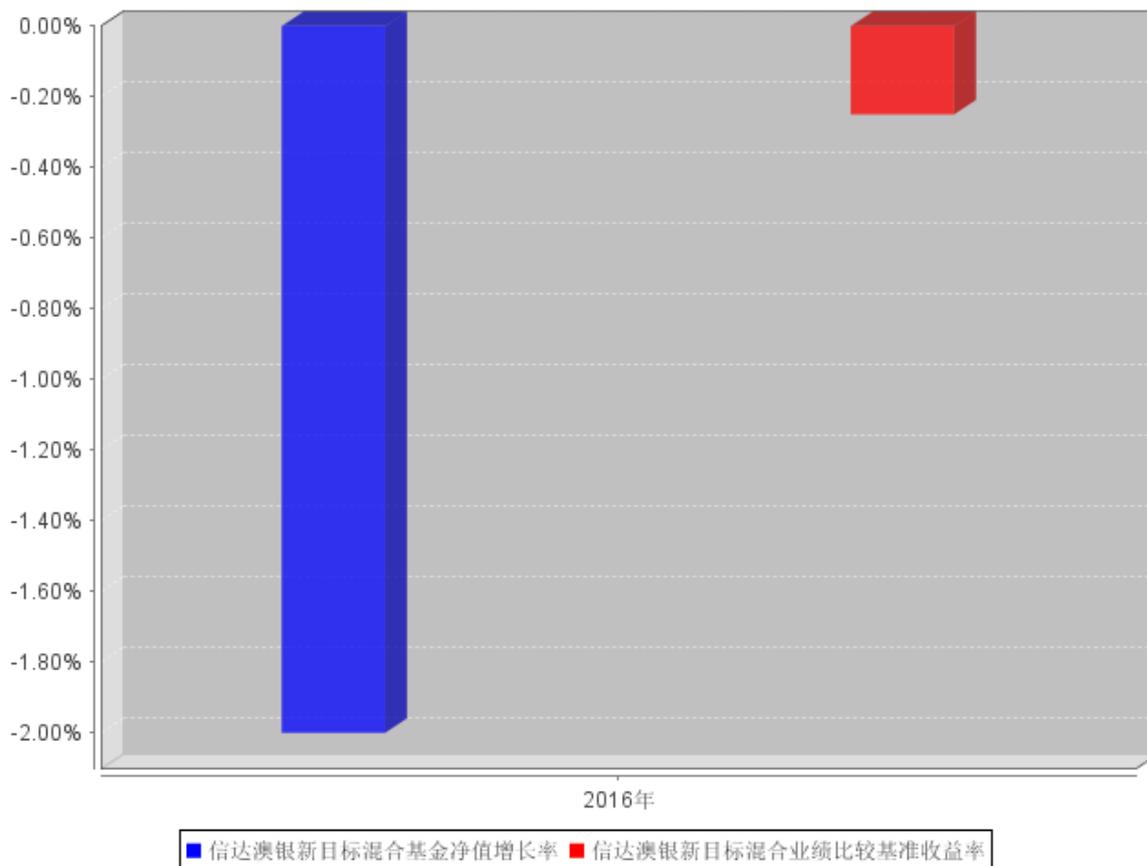


注：1、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。

2、本基金基金合同生效日 2016 年 10 月 19 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内，建仓期结束时本基金的各项投资比例将符合基金合同的有关约定。

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

信达澳银新目标混合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：本基金基金合同于 2016 年 10 月 19 日生效，因此 2016 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金从 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股

份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司共管理十六只基金，包括信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金。

报告期内，公司第四届董事会独立董事孙志新先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 10 个工作日；独立董事刘颂兴先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 9 个工作日；独立董事刘治海先生以现场考察、参加现场董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 9 个工作日。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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		
孔学峰	本基金的	2016 年 10 月	-	12 年	中央财经大学金融学硕

	基金经理，稳定价值债券基金、鑫安债券基金（LOF）、信用债债券基金、慧管家货币基金、纯债债券基金、慧理财货币基金的基金经理，公募投资总部副总监	25 日			士。历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理；2011 年 8 月加入信达澳银基金公司，历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、公募投资总部副总监、信达澳银稳定价值债券基金基金经理（2011 年 9 月 29 日起至今）、信达澳银鑫安债券基金（LOF）基金经理（2012 年 5 月 7 日起至今）、信达澳银信用债债券基金基金经理（2013 年 5 月 14 日起至今）、信达澳银慧管家货币基金基金经理（2014 年 6 月 26 日起至今）、信达澳银纯债债券基金基金经理（2016 年 8 月 4 日起至今）、信达澳银慧理财货币基金基金经理（2016 年 9 月 30 日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016 年 10 月 25 日起至今）。
冯士祯	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理、新财	2016 年 10 月 19 日	-	5 年	北京大学金融学硕士。2011 年 7 月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2015 年 5 月 9 日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2015 年 7 月 1 日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2015 年 8 月 19 日起至今）、信达澳银转型创新

	富混合基金的基金经理				股票基金基金经理（2016年9月14日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年10月19日起至今）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2016年11月10日起至今）。
唐弋迅	本基金的基金经理、慧理财货币基金、新财富混合基金的基金经理	2016年11月25日	-	4年	中国人民大学世界经济专业硕士。2012年7月至2014年7月在第一创业证券，任研究所债券研究员；2014年7月至2015年9月在第一创业证券，任固定收益部销售经理、产品经理；2015年9月至2016年7月在第一创业证券，任固定收益部债券交易员、投资经理助理。2016年8月加入信达澳银基金，任信达澳银慧理财货币基金基金经理（2016年11月25日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年11月25日起至今）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2016年11月25日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）本基金管理人管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现本基金管理人管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同时反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度，央行仅进行了一次降准操作，实质上执行了偏中性的政策。公开市场的货币投放偏谨慎，且回购利率维持在 2.25%，使得短端收益率无法进一步向下突破。二季度，债券市场受到营改增事件的阶段性冲击，同时大宗商品的大幅反弹也带来了通胀的担忧，因此在二季度

初期中长期利率债收益率有较大的反弹。但二季度的中后期，由于海外市场的动荡致使风险偏好下降，中国的利率债收益率也开始逐渐回落。三季度，央行重启 14 天和 28 天的逆回购，有意识的锁短放长，以压迫市场降低杠杆。但市场依然较为乐观，金融杠杆维持高位。四季度，央行在公开市场操作持续净回笼，导致货币市场极度紧张，银行同业存单利率大幅上行，并带来连锁反应，致使货币利率及债券各期限利率在短时间内大幅上扬。

伴随着“灾后重建”，中高评级债券的收益率逐步回落。不过，市场的悲观情绪仍未完全消散，长期限和低等级的债券利差仍然有扩大的趋势。目前市场对 2017 年的担心主要基于三点：一是按照当下的监管方向，2017 年银行委外增速大概率放缓甚至减少，部分机构仍然有卖券压力；二是美国进入加息周期的逐步确立，限制了收益率下行的空间；三是关于 2017 年基本面和通胀看法，市场预期存在较大差异。

本基金成立于 2016 年四季度。除部分配置股票以外，剩余一半仓位配置了债券市场，并把握了 12 月债券市场的调整机会，择机配置了部分收益较高的高等级债券，对冲了股票市场的下行风险；同时，进入 12 月本基金继续参与新股网下申购，逐步开始累积确定性的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.980 元，份额累计净值为 0.980 元，报告期内份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为-0.25%。

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，在结束了 2014-2016 年牛市以后，债券市场进入盘整期，短期看走势不明，对于投资来说，选择防守反击较为稳妥。作为债券增强型产品，一是经过 2016 年 4 季度调整后，债市收益率全面上行，从绝对收益的角度，2017 年配置中高评级、短久期将有稳定的持有期回报；二是 2017 年将推进 IPO 以解决新股堰塞湖，发行频率将加大，这对打新收益有一定增厚效应，打新策略依旧有效；三是股票市场在经历了过去一年的充分调整后，较之其他金融资产相对价值，且本基金着眼于低估值的蓝筹股，全年出现大幅波动的可能性不大，有益于债券和打新的收益积累。

操作上，由于央行货币政策相对收紧，资金面预期不稳可能会放大市场波动，等待市场调整机会进入，择券方面以短久期、中高等级为主。打新方面，新股发行频率加快叠加开板涨幅降低的因素，整体回报不会有太大变化，预期增厚收益率依然可观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 实时监控基金投资运作，监督投资决策行为，保证了公司所管理的基金合法合规运作，未出现重大违规事件。

(3) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行销售适用性原则。

(5) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(6) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由分管基金运营的高级管理人员担任；基金估值小组成员若干名，由公募投资总部、专户理财部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为-3,968,217.57 元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

2016 年度，基金托管人在信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年度，信达澳银基金管理有限公司在信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2016 年度，由信达澳银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相

关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2017）审字第 60467227_H16 号

信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

一、基金管理人 对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表，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而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人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。

三、审计意见

我们认为，信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

汤骏

中国北京

中国注册会计师

郭淑仪

2017年3月28日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	13,342,005.88
结算备付金		15,624,710.88
存出保证金		22,806.78
交易性金融资产	7.4.7.2	206,904,516.60
其中：股票投资		99,155,516.60
基金投资		-
债券投资		107,749,000.00
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	5,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	618,355.44
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		241,512,395.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		44,999,732.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		250,678.26
应付托管费		25,067.79
应付销售服务费		-

应付交易费用	7.4.7.7	129,027.86
应交税费		-
应付利息		8,024.16
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	30,000.00
负债合计		45,442,530.57
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	200,038,082.58
未分配利润	7.4.7.10	-3,968,217.57
所有者权益合计		196,069,865.01
负债和所有者权益总计		241,512,395.58

注：1、本财务报表的实际报告期间为 2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.980 元，基金份额总额 200,038,082.58 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 10 月 19 日(基金合同 生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-3,099,758.96
1. 利息收入		778,804.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	187,731.65
债券利息收入		188,709.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		402,363.51
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,680.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,664.35
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,920.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,936.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,897,244.28

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、费用		868,458.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2	595,122.15
2. 托管费	7.4.10.2	59,512.18
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	152,399.90
5. 利息支出		11,328.85
其中：卖出回购金融资产支出		11,328.85
6. 其他费用	7.4.7.19	50,095.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,968,217.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,968,217.57

注：本财务报表的实际报告期间为 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,038,082.58	-	200,038,082.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,968,217.57	-3,968,217.57
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）	200,038,082.58	-3,968,217.57	196,069,865.01

注：本财务报表的实际报告期间为 2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

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>于建伟</u>	<u>徐伟文</u>	<u>董瑾娟</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

信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1592 号《关于核准信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由信达澳银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《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,025,579.95 元，业经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2016)验字第 60467227_H03 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 10 月 19 日正式生效，本基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 200,025,579.95 元，折合 200,025,579.95 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 12,502.63 元，折合 12,502.63 份基金份额。以上基金合同生效日的基金份额总额为 200,038,082.58 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，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等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基

金资产的比例为 0-95%；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，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%；本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制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 日的财务状况以及自 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2016 年 10 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；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，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；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。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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。除此以外，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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、

红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，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；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率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；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；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；

(4) 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；

(5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(7) 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；

(8) 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公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9) 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) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（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；

(4) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；

(5)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的，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 20%，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

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，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。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	13,342,005.88
定期存款	-
其他存款	-
合计：	13,342,005.88

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	103,025,643.75	99,155,516.60	-3,870,127.15	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	107,776,117.13	107,749,000.00	-27,117.13
	合计	107,776,117.13	107,749,000.00	-27,117.13
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	210,801,760.88	206,904,516.60	-3,897,244.28	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

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_交易所	5,000,000.00	-

买入返售证券_银行间	-	-
合计	5,000,000.00	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,520.96
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	7,734.21
应收债券利息	605,972.27
应收买入返售证券利息	3,116.67
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.33
合计	618,355.44

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	124,131.71
银行间市场应付交易费用	4,896.15
合计	129,027.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	30,000.00
合计	30,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年10月19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	200,038,082.58	200,038,082.58
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	200,038,082.58	200,038,082.58

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	-70,973.29	-3,897,244.28	-3,968,217.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,973.29	-3,897,244.28	-3,968,217.57

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	119,255.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,093.34
其他	30.83
合计	187,731.65

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
卖出股票成交总额	15,144,795.65
减: 卖出股票成本总额	15,125,131.30
买卖股票差价收入	19,664.35

7.4.7.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	9,950,083.80
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	9,911,400.00
减: 应收利息总额	41,603.80
买卖债券差价收入	-2,920.00

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日)至2016年12 月31日
股票投资产生的股利收益	1,936.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,936.40

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2016年10月19日(基金合同生效日)至2016 年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,897,244.28
——股票投资	-3,870,127.15
——债券投资	-27,117.13

——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	-3,897,244.28

7.4.7.17 其他收入

本基金本期无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	151,099.90
银行间市场交易费用	1,300.00
合计	152,399.90

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	15,000.00
银行费用	4,695.53
债券托管账户维护费	-
其他	400.00
合计	50,095.53

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资

产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司（Colonial First State Group Limited）	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	595,122.15
其中：支付销售机构的客户维护费	12.22

注：支付基金管理人信达澳银基金公司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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,512.18

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本期基金管理人无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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

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10月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	13,342,005.88	47,351.92

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无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

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

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**

本基金本期无利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	认购新发证券	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72

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
600161	天坛生物	2016年12月06日	重大事项	39.40	2017年3月24日	43.34	5,200	202,428.00	204,880.00
600171	上海贝岭	2016年12月14日	重大事项	14.05	2017年2月16日	14.90	10,400	159,199.58	146,120.00
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项	7.43	2017年1月13日	8.17	15,700	119,648.13	116,651.00
600551	时代出版	2016年11月28日	重大事项	20.32	继续停牌	无	4,400	88,851.00	89,408.00
600645	中源协和	2016年12月13日	重大事项	26.80	继续停牌	无	6,000	179,823.29	160,800.00
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.42	继续停牌	无	19,000	210,951.89	216,980.00
601168	西部矿业	2016年12月19日	重大事项	7.83	继续停牌	无	32,100	267,758.03	251,343.00
603555	贵人鸟	2016年12月12日	重大事项	30.76	继续停牌	无	2,500	70,187.50	76,900.00
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	继续停牌	无	23,000	310,827.41	317,170.00
002602	世纪华通	2016年12月23日	重大事项	46.89	2017年1月9日	50.00	3,200	112,029.18	150,048.00
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大事项	12.93	继续停牌	无	7,000	98,560.00	90,510.00

002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	重大事 项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	4,100	90,662.18	86,920.00
--------	-----	------------------------	----------	-------	-------------------	-------	-------	-----------	-----------

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 44,999,732.50 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111681906	16 宁波银行 CD239	2017 年 1 月 3 日	98.94	300,000	29,682,000.00
111609346	16 浦发 CD346	2017 年 1 月 3 日	96.37	100,000	9,637,000.00
011697008	16 滨海建投 SCP001	2017 年 1 月 3 日	99.86	100,000	9,986,000.00
合计				500,000	49,305,000.00

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。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金, 属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会, 负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度; 在经营层面设立风险管理委员会, 讨论和制定

公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法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，将风险控制在可承受的范围内。

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交通银行，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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	107,749,000.00
合计	107,749,000.00

注：1、本期末未评级债券为超短期融资券、大额可转让同业存单及政策性金融债。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内(含 1 年)的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

注：长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

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监察稽核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。本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%；本基金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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况

外，其余均能以合理价格适时变现。

除卖出回购金融资产款余额中有 44,999,732.50 元将在一个月内到期且计息外，本基金持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,342,005.88	-	-	-	13,342,005.88
结算备付金	15,624,710.88	-	-	-	15,624,710.88
存出保证金	22,806.78	-	-	-	22,806.78
交易性金融资产	107,749,000.00	-	-	99,155,516.60	206,904,516.60
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00

应收利息	-	-	618,355.44	618,355.44
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	141,738,523.54	-	99,773,872.04	241,512,395.58
负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	44,999,732.50	-	-	44,999,732.50
应付管理人报酬	-	-	250,678.26	250,678.26
应付托管费	-	-	25,067.79	25,067.79
应付交易费用	-	-	129,027.86	129,027.86
应付利息	-	-	8,024.16	8,024.16
其他负债	-	-	30,000.00	30,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
负债总计	44,999,732.50	-	442,798.07	45,442,530.57
利率敏感度缺口	96,738,791.04	-	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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：人民币万元)
		本期末 2016年12月31日
	1. 市场利率下降 25 个基点	上升约 13
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 13

7.4.13.4.2 外汇风险

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金将在风险管理的前提下进行积极的投资，其投资策略主要包括两个方面：自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股；运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产为基金资产的 0%-95%；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，基金保留的现金或投资于到期日在一年内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	99,155,516.60	50.57
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	99,155,516.60	50.57

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：人民币万元）
		本期末 2016 年 12 月 31 日

	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 605
	2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 605

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

(a) 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 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人民币 97,240,430.88 元，属于第二层次的余额为人民币 109,664,085.72 元，无属于第三层次的余额。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(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可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	99,155,516.60	41.06
	其中：股票	99,155,516.60	41.06
2	固定收益投资	107,749,000.00	44.61
	其中：债券	107,749,000.00	44.61
	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	5,000,000.00	2.07
	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	28,966,716.76	11.99
7	其他各项资产	641,162.22	0.27
8	合计	241,512,395.58	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	1,347,479.00	0.69
B	采矿业	2,572,686.00	1.31
C	制造业	56,576,625.45	28.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,249,931.60	3.70
E	建筑业	2,305,541.00	1.18
F	批发和零售业	5,787,334.64	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	6,416,617.68	3.27
H	住宿和餐饮业	91,326.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,069,920.00	2.08
J	金融业	2,263,987.00	1.15
K	房地产业	4,595,209.00	2.34
L	租赁和商务服务业	3,202,561.23	1.63
M	科学研究和技术服务业	275,684.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	339,112.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	195,200.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,169,815.00	0.60
S	综合	696,487.00	0.36
	合计	99,155,516.60	50.57

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	000895	双汇发展	189,975	3,976,176.75	2.03
2	600900	长江电力	310,000	3,924,600.00	2.00
3	600270	外运发展	140,900	2,330,486.00	1.19
4	600138	中青旅	110,659	2,320,519.23	1.18
5	600166	福田汽车	724,900	2,239,941.00	1.14
6	002563	森马服饰	200,000	2,054,000.00	1.05
7	000429	粤高速 A	299,902	2,051,329.68	1.05
8	600276	恒瑞医药	44,982	2,046,681.00	1.04
9	601318	中国平安	57,000	2,019,510.00	1.03
10	002008	大族激光	88,000	1,988,800.00	1.01
11	300408	三环集团	119,979	1,905,266.52	0.97
12	000028	国药一致	21,675	1,450,057.50	0.74
13	600038	中直股份	29,329	1,420,110.18	0.72
14	600562	国睿科技	42,484	1,292,363.28	0.66
15	600452	涪陵电力	30,745	1,281,451.60	0.65
16	000963	华东医药	17,202	1,239,748.14	0.63
17	300072	三聚环保	9,900	458,271.00	0.23
18	002466	天齐锂业	11,900	386,155.00	0.20
19	002310	东方园林	26,200	370,730.00	0.19
20	600584	长电科技	21,000	370,650.00	0.19
21	002085	万丰奥威	18,700	369,512.00	0.19
22	600522	中天科技	34,100	359,073.00	0.18
23	600079	人福医药	17,700	353,115.00	0.18
24	002405	四维图新	17,600	340,560.00	0.17
25	600498	烽火通信	13,200	332,772.00	0.17
26	600201	生物股份	10,100	319,059.00	0.16
27	002400	省广股份	23,000	317,170.00	0.16
28	600487	亨通光电	16,800	313,488.00	0.16
29	300115	长盈精密	11,600	302,296.00	0.15
30	000661	长春高新	2,600	290,810.00	0.15
31	000656	金科股份	55,300	289,772.00	0.15
32	600521	华海药业	12,800	281,984.00	0.14
33	002572	索菲亚	5,200	281,632.00	0.14
34	000961	中南建设	26,700	277,680.00	0.14
35	600436	片仔癀	5,900	270,161.00	0.14
36	002340	格林美	40,000	262,000.00	0.13
37	600219	南山铝业	84,700	261,723.00	0.13
38	601012	隆基股份	19,200	257,088.00	0.13
39	600503	华丽家族	30,700	254,503.00	0.13

40	002508	老板电器	6,900	253,920.00	0.13
41	002426	胜利精密	30,500	252,235.00	0.13
42	601168	西部矿业	32,100	251,343.00	0.13
43	600879	航天电子	16,400	249,936.00	0.13
44	600664	哈药股份	28,600	245,388.00	0.13
45	600143	金发科技	31,500	245,070.00	0.12
46	600643	爱建集团	19,700	244,477.00	0.12
47	002131	利欧股份	15,300	244,035.00	0.12
48	000997	新大陆	12,500	242,875.00	0.12
49	000998	隆平高科	11,300	242,159.00	0.12
50	002701	奥瑞金	28,000	241,920.00	0.12
51	002004	华邦健康	26,600	241,262.00	0.12
52	000930	中粮生化	17,700	237,888.00	0.12
53	002049	紫光国芯	7,200	237,168.00	0.12
54	600978	宜华生活	22,100	235,365.00	0.12
55	002048	宁波华翔	10,600	234,684.00	0.12
56	002271	东方雨虹	10,600	229,914.00	0.12
57	002168	深圳惠程	14,400	228,384.00	0.12
58	000970	中科三环	17,100	228,285.00	0.12
59	000983	西山煤电	26,900	227,574.00	0.12
60	002273	水晶光电	11,400	226,860.00	0.12
61	600266	北京城建	17,000	226,610.00	0.12
62	000690	宝新能源	24,300	225,261.00	0.11
63	002030	达安基因	9,600	222,720.00	0.11
64	600699	均胜电子	6,700	221,703.00	0.11
65	002092	中泰化学	18,300	221,430.00	0.11
66	600635	大众公用	36,800	221,168.00	0.11
67	600426	华鲁恒升	16,600	219,950.00	0.11
68	000581	威孚高科	9,800	219,912.00	0.11
69	000400	许继电气	12,100	219,615.00	0.11
70	002179	中航光电	6,000	217,740.00	0.11
71	600655	豫园商城	19,000	216,980.00	0.11
72	600312	平高电气	13,800	215,556.00	0.11
73	300113	顺网科技	7,900	212,431.00	0.11
74	002573	清新环境	12,100	211,387.00	0.11
75	002299	圣农发展	9,900	210,078.00	0.11
76	002439	启明星辰	10,100	209,979.00	0.11
77	002001	新和成	10,700	209,720.00	0.11
78	300253	卫宁健康	10,700	209,613.00	0.11

79	600056	中国医药	11,000	209,330.00	0.11
80	002038	双鹭药业	7,800	208,338.00	0.11
81	600482	中国动力	6,800	207,672.00	0.11
82	600500	中化国际	17,800	207,548.00	0.11
83	600565	迪马股份	27,900	207,018.00	0.11
84	600418	江淮汽车	17,800	205,768.00	0.10
85	600161	天坛生物	5,200	204,880.00	0.10
86	600594	益佰制药	12,300	204,795.00	0.10
87	002013	中航机电	11,100	203,019.00	0.10
88	002665	首航节能	22,900	200,604.00	0.10
89	002223	鱼跃医疗	6,400	198,528.00	0.10
90	000566	海南海药	15,600	198,276.00	0.10
91	600388	龙净环保	16,000	197,920.00	0.10
92	600759	洲际油气	20,000	196,400.00	0.10
93	600633	浙报传媒	11,100	196,026.00	0.10
94	600614	鼎立股份	16,700	195,390.00	0.10
95	000078	海王生物	31,000	195,300.00	0.10
96	300244	迪安诊断	6,100	195,200.00	0.10
97	600478	科力远	19,500	195,000.00	0.10
98	002217	合力泰	10,800	193,320.00	0.10
99	603766	隆鑫通用	9,300	193,254.00	0.10
100	002410	广联达	13,200	192,720.00	0.10
101	300055	万邦达	11,700	191,646.00	0.10
102	600601	方正科技	41,600	191,360.00	0.10
103	000002	万科A	9,300	191,115.00	0.10
104	002250	联化科技	11,800	190,924.00	0.10
105	002221	东华能源	15,400	190,806.00	0.10
106	600094	大名城	21,300	189,570.00	0.10
107	600751	天海投资	22,500	188,100.00	0.10
108	600811	东方集团	26,300	188,045.00	0.10
109	000988	华工科技	12,000	187,800.00	0.10
110	600435	北方导航	14,400	187,776.00	0.10
111	300134	大富科技	7,400	187,664.00	0.10
112	000598	兴蓉环境	32,400	186,624.00	0.10
113	600851	海欣股份	14,400	186,192.00	0.09
114	600787	中储股份	20,500	185,935.00	0.09
115	600410	华胜天成	17,100	185,877.00	0.09
116	600240	华业资本	17,300	185,802.00	0.09
117	002051	中工国际	8,100	185,652.00	0.09

118	600200	江苏吴中	9,600	185,376.00	0.09
119	002595	豪迈科技	8,800	185,240.00	0.09
120	002311	海大集团	12,300	185,115.00	0.09
121	601155	新城控股	15,700	184,475.00	0.09
122	002714	牧原股份	7,900	183,912.00	0.09
123	600516	方大炭素	19,800	183,348.00	0.09
124	000031	中粮地产	20,500	182,860.00	0.09
125	600572	康恩贝	25,000	182,750.00	0.09
126	600120	浙江东方	6,300	182,196.00	0.09
127	002191	劲嘉股份	17,500	182,175.00	0.09
128	603019	中科曙光	6,500	180,830.00	0.09
129	600755	厦门国贸	21,800	178,760.00	0.09
130	000979	中弘股份	67,300	177,672.00	0.09
131	002366	台海核电	3,300	176,946.00	0.09
132	600176	中国巨石	17,800	175,152.00	0.09
133	600511	国药股份	5,800	174,580.00	0.09
134	601929	吉视传媒	41,500	173,885.00	0.09
135	000006	深振业 A	18,400	173,880.00	0.09
136	002308	威创股份	11,700	172,458.00	0.09
137	002699	美盛文化	5,100	172,380.00	0.09
138	000488	晨鸣纸业	16,600	171,976.00	0.09
139	600183	生益科技	15,600	171,600.00	0.09
140	000975	银泰资源	10,900	170,476.00	0.09
141	002074	国轩高科	5,500	170,445.00	0.09
142	600409	三友化工	18,100	169,959.00	0.09
143	002353	杰瑞股份	8,300	168,490.00	0.09
144	600160	巨化股份	15,900	168,222.00	0.09
145	000612	焦作万方	14,500	167,475.00	0.09
146	600967	北方创业	12,300	166,911.00	0.09
147	600026	中海发展	24,500	166,845.00	0.09
148	600198	大唐电信	10,500	166,635.00	0.08
149	002268	卫士通	5,300	166,526.00	0.08
150	600216	浙江医药	13,100	166,108.00	0.08
151	600064	南京高科	9,900	165,825.00	0.08
152	600881	亚泰集团	30,300	165,741.00	0.08
153	002276	万马股份	11,000	165,330.00	0.08
154	600528	中铁二局	12,000	165,120.00	0.08
154	600325	华发股份	12,900	165,120.00	0.08
155	300182	捷成股份	15,900	163,929.00	0.08

156	600497	驰宏锌锗	23,300	163,799.00	0.08
157	002078	太阳纸业	24,400	162,992.00	0.08
158	002155	湖南黄金	14,200	162,590.00	0.08
159	600499	科达洁能	21,500	162,540.00	0.08
160	000758	中色股份	20,300	162,197.00	0.08
161	000671	阳光城	29,100	162,087.00	0.08
162	600884	杉杉股份	11,500	161,920.00	0.08
163	300199	翰宇药业	9,000	161,820.00	0.08
164	600316	洪都航空	8,200	161,212.00	0.08
165	600645	中源协和	6,000	160,800.00	0.08
166	000513	丽珠集团	2,700	160,650.00	0.08
167	600597	光明乳业	12,300	160,638.00	0.08
168	000786	北新建材	15,600	160,524.00	0.08
169	600717	天津港	15,900	160,272.00	0.08
170	000012	南玻A	14,100	159,894.00	0.08
171	000939	凯迪生态	12,400	159,588.00	0.08
172	600175	美都能源	32,200	159,390.00	0.08
173	300026	红日药业	29,300	159,099.00	0.08
174	600108	亚盛集团	27,800	159,016.00	0.08
175	601699	潞安环能	19,700	158,585.00	0.08
176	000860	顺鑫农业	7,200	158,400.00	0.08
177	600770	综艺股份	15,300	158,355.00	0.08
178	002050	三花智控	14,300	157,872.00	0.08
179	002266	浙富控股	27,400	157,824.00	0.08
180	600039	四川路桥	33,200	157,368.00	0.08
181	600808	马钢股份	55,400	156,782.00	0.08
182	000592	平潭发展	23,100	156,156.00	0.08
183	600416	湘电股份	10,600	155,926.00	0.08
184	600062	华润双鹤	7,000	155,610.00	0.08
185	600611	大众交通	23,600	155,052.00	0.08
186	600872	中炬高新	11,000	154,880.00	0.08
187	600320	振华重工	30,200	154,020.00	0.08
188	600267	海正药业	11,700	153,855.00	0.08
189	000543	皖能电力	20,000	152,200.00	0.08
190	002073	软控股份	13,400	152,090.00	0.08
191	002477	雏鹰农牧	30,000	150,600.00	0.08
192	000519	江南红箭	10,100	150,490.00	0.08
193	002602	世纪华通	3,200	150,048.00	0.08
194	002022	科华生物	7,500	150,000.00	0.08

195	600366	宁波韵升	7,600	149,644.00	0.08
196	000878	云南铜业	12,500	147,625.00	0.08
197	000685	中山公用	13,200	146,916.00	0.07
198	600073	上海梅林	12,800	146,560.00	0.07
199	000008	神州高铁	15,700	146,324.00	0.07
200	000667	美好置业	39,600	146,124.00	0.07
201	600171	上海贝岭	10,400	146,120.00	0.07
202	600187	国中水务	26,800	144,452.00	0.07
203	300274	阳光电源	13,700	144,398.00	0.07
204	600067	冠城大通	20,000	143,200.00	0.07
205	002603	以岭药业	8,300	143,092.00	0.07
206	600298	安琪酵母	8,000	142,560.00	0.07
207	000616	海航投资	27,300	142,506.00	0.07
208	002657	中科金财	3,300	142,428.00	0.07
209	600380	健康元	14,300	141,999.00	0.07
210	600422	昆药集团	10,500	141,855.00	0.07
211	002489	浙江永强	18,700	141,559.00	0.07
212	002281	光迅科技	1,800	141,300.00	0.07
213	300010	立思辰	8,500	141,270.00	0.07
214	600260	凯乐科技	9,100	140,868.00	0.07
215	002437	誉衡药业	16,800	138,936.00	0.07
216	600017	日照港	34,300	138,915.00	0.07
217	600557	康缘药业	8,200	138,826.00	0.07
218	600392	盛和资源	10,400	138,632.00	0.07
219	300291	华录百纳	6,200	138,136.00	0.07
220	600587	新华医疗	5,500	138,105.00	0.07
221	000066	长城电脑	11,100	138,084.00	0.07
222	600277	亿利洁能	19,400	137,934.00	0.07
223	002375	亚厦股份	13,000	137,540.00	0.07
224	600125	铁龙物流	17,000	137,360.00	0.07
225	002390	信邦制药	13,800	136,482.00	0.07
226	601880	大连港	48,700	136,360.00	0.07
227	000762	西藏矿业	8,000	136,240.00	0.07
228	002325	洪涛股份	17,000	136,170.00	0.07
229	600284	浦东建设	10,300	135,857.00	0.07
230	002002	鸿达兴业	18,500	135,790.00	0.07
231	000418	小天鹅 A	4,200	135,744.00	0.07
232	601311	骆驼股份	8,300	135,539.00	0.07
233	300001	特锐德	7,800	135,252.00	0.07

234	002368	太极股份	4,400	134,684.00	0.07
235	002041	登海种业	7,100	134,048.00	0.07
236	000021	深科技	14,200	133,906.00	0.07
237	600651	飞乐音响	12,700	133,731.00	0.07
238	002384	东山精密	6,800	133,348.00	0.07
239	002122	天马股份	10,500	133,245.00	0.07
240	000703	恒逸石化	8,800	132,264.00	0.07
241	600575	皖江物流	23,000	132,250.00	0.07
242	300287	飞利信	11,100	132,090.00	0.07
243	002672	东江环保	7,500	132,000.00	0.07
244	000816	智慧农业	20,700	131,652.00	0.07
245	002512	达华智能	8,000	130,640.00	0.07
246	600970	中材国际	18,400	130,456.00	0.07
247	002358	森源电气	6,800	130,424.00	0.07
248	600765	中航重机	9,100	130,403.00	0.07
249	000777	中核科技	5,800	129,804.00	0.07
250	002589	瑞康医药	4,000	129,800.00	0.07
251	002444	巨星科技	8,300	129,480.00	0.07
252	600517	置信电气	13,300	129,409.00	0.07
253	000926	福星股份	10,100	128,674.00	0.07
254	600086	东方金钰	11,800	128,384.00	0.07
255	300202	聚龙股份	5,200	127,920.00	0.07
256	600736	苏州高新	14,100	127,323.00	0.06
257	002479	富春环保	8,500	125,970.00	0.06
258	002028	思源电气	9,500	125,210.00	0.06
259	600809	山西汾酒	5,000	125,100.00	0.06
260	600169	太原重工	30,900	124,527.00	0.06
261	000848	承德露露	11,100	124,209.00	0.06
262	002373	千方科技	9,000	124,200.00	0.06
263	001696	宗申动力	13,200	124,080.00	0.06
264	600694	大商股份	3,100	123,783.00	0.06
265	601801	皖新传媒	7,000	122,990.00	0.06
266	600536	中国软件	5,100	122,706.00	0.06
267	600880	博瑞传播	14,000	122,640.00	0.06
268	002624	完美世界	4,100	122,139.00	0.06
269	300043	星辉娱乐	12,000	121,680.00	0.06
270	600004	白云机场	8,600	121,174.00	0.06
271	002317	众生药业	9,800	121,030.00	0.06
272	002431	棕榈股份	13,200	120,912.00	0.06

273	601000	唐山港	30,100	120,701.00	0.06
274	002285	世联行	15,800	120,080.00	0.06
275	002244	滨江集团	17,200	120,056.00	0.06
276	000600	建投能源	13,500	119,880.00	0.06
277	601717	郑煤机	16,900	118,807.00	0.06
278	601010	文峰股份	22,500	118,350.00	0.06
279	603077	和邦生物	23,100	118,272.00	0.06
280	002503	搜于特	8,200	117,998.00	0.06
281	000401	冀东水泥	9,900	117,810.00	0.06
282	600058	五矿发展	7,700	117,271.00	0.06
283	600835	上海机电	6,000	117,120.00	0.06
284	600433	冠豪高新	14,600	117,092.00	0.06
285	600537	亿晶光电	15,700	116,651.00	0.06
286	002161	远望谷	10,000	115,300.00	0.06
287	600053	九鼎投资	2,500	115,150.00	0.06
288	000090	天健集团	11,800	113,988.00	0.06
289	600289	亿阳信通	8,800	113,960.00	0.06
290	000572	海马汽车	21,200	113,632.00	0.06
291	002128	露天煤业	13,200	113,520.00	0.06
291	300147	香雪制药	8,800	113,520.00	0.06
292	000636	风华高科	11,600	113,216.00	0.06
293	000587	金洲慈航	7,600	113,088.00	0.06
294	601886	江河集团	10,600	112,890.00	0.06
295	600460	士兰微	18,100	112,582.00	0.06
296	603188	亚邦股份	6,300	112,518.00	0.06
297	600729	重庆百货	4,800	112,464.00	0.06
298	600894	广日股份	8,200	112,094.00	0.06
299	600220	江苏阳光	25,800	111,972.00	0.06
300	600993	马应龙	5,600	111,832.00	0.06
301	002505	大康农业	31,500	111,510.00	0.06
302	002106	莱宝高科	9,900	111,276.00	0.06
303	000810	创维数字	7,900	111,153.00	0.06
304	600580	卧龙电气	12,200	111,020.00	0.06
305	600006	东风汽车	16,100	110,768.00	0.06
306	002354	天神娱乐	1,600	110,656.00	0.06
307	600259	广晟有色	2,600	110,474.00	0.06
308	002428	云南锗业	8,700	110,229.00	0.06
309	601777	力帆股份	11,500	109,940.00	0.06
310	000900	现代投资	13,600	109,752.00	0.06

311	000830	鲁西化工	19,600	109,564.00	0.06
312	601678	滨化股份	15,000	109,350.00	0.06
313	600458	时代新材	7,700	108,955.00	0.06
314	002190	成飞集成	3,400	108,732.00	0.06
315	300257	开山股份	6,300	108,108.00	0.06
316	002498	汉缆股份	25,100	107,930.00	0.06
317	002063	远光软件	8,200	107,748.00	0.05
318	600351	亚宝药业	10,900	107,692.00	0.05
319	000861	海印股份	22,200	107,670.00	0.05
320	000501	鄂武商 A	5,500	107,360.00	0.05
321	002056	横店东磁	7,700	107,107.00	0.05
322	002414	高德红外	4,700	107,066.00	0.05
323	002269	美邦服饰	21,300	106,713.00	0.05
324	002254	泰和新材	8,600	106,296.00	0.05
325	000897	津滨发展	24,800	106,144.00	0.05
326	600805	悦达投资	12,500	106,125.00	0.05
327	000541	佛山照明	10,700	105,288.00	0.05
328	002005	德豪润达	18,300	105,225.00	0.05
329	601001	大同煤业	17,200	105,092.00	0.05
330	002277	友阿股份	7,300	104,828.00	0.05
331	600750	江中药业	3,400	104,788.00	0.05
332	002344	海宁皮城	9,200	104,144.00	0.05
333	600826	兰生股份	3,800	103,816.00	0.05
334	600869	智慧能源	13,400	103,716.00	0.05
335	600790	轻纺城	14,400	103,680.00	0.05
336	000937	冀中能源	15,300	103,122.00	0.05
337	600481	双良节能	13,700	103,024.00	0.05
338	002242	九阳股份	5,700	102,771.00	0.05
339	600282	南钢股份	33,000	102,300.00	0.05
340	002588	史丹利	9,000	102,150.00	0.05
341	002663	普邦股份	16,800	101,976.00	0.05
342	600761	安徽合力	8,000	101,760.00	0.05
343	600850	华东电脑	4,200	101,556.00	0.05
344	601666	平煤股份	20,800	101,296.00	0.05
345	000726	鲁泰 A	7,900	101,199.00	0.05
346	000681	视觉中国	5,300	101,018.00	0.05
347	000652	泰达股份	18,300	101,016.00	0.05
347	600112	天成控股	9,200	101,016.00	0.05
348	000049	德赛电池	2,400	100,920.00	0.05

349	000596	古井贡酒	2,200	100,100.00	0.05
350	600823	世茂股份	14,200	99,684.00	0.05
351	600300	维维股份	14,900	99,532.00	0.05
352	000088	盐田港	13,900	99,107.00	0.05
353	600812	华北制药	15,800	98,908.00	0.05
354	002371	七星电子	3,700	98,420.00	0.05
355	300032	金龙机电	6,100	98,149.00	0.05
356	002011	盾安环境	10,300	98,056.00	0.05
357	000969	安泰科技	9,300	98,022.00	0.05
358	600496	精工钢构	22,900	98,012.00	0.05
359	600059	古越龙山	9,500	97,280.00	0.05
360	000528	柳工	13,300	97,223.00	0.05
361	000550	江铃汽车	3,600	97,200.00	0.05
362	300039	上海凯宝	9,500	97,185.00	0.05
363	000552	靖远煤电	25,400	96,266.00	0.05
364	000669	金鸿能源	5,600	96,040.00	0.05
365	600563	法拉电子	2,600	95,342.00	0.05
366	600395	盘江股份	11,800	95,226.00	0.05
367	000426	兴业矿业	10,900	95,048.00	0.05
368	000099	中信海直	8,100	94,851.00	0.05
369	600720	祁连山	11,600	94,772.00	0.05
370	600628	新世界	6,700	94,671.00	0.05
371	002642	荣之联	4,700	94,470.00	0.05
372	002064	华峰氨纶	17,200	94,428.00	0.05
373	601233	XD 桐昆股	6,500	93,340.00	0.05
374	002118	紫鑫药业	12,900	92,880.00	0.05
375	600292	远达环保	7,500	92,775.00	0.05
376	002332	仙琚制药	7,200	92,664.00	0.05
377	000620	新华联	10,900	92,432.00	0.05
378	600132	重庆啤酒	5,000	92,250.00	0.05
379	000680	山推股份	16,600	91,798.00	0.05
380	600195	中牧股份	4,300	91,375.00	0.05
381	600754	锦江股份	3,100	91,326.00	0.05
382	000062	深圳华强	3,200	90,912.00	0.05
383	002345	潮宏基	7,500	90,600.00	0.05
384	002681	奋达科技	7,000	90,510.00	0.05
385	002408	齐翔腾达	8,200	90,200.00	0.05
386	600640	号百控股	4,500	89,910.00	0.05
387	002463	沪电股份	18,800	89,864.00	0.05

388	600551	时代出版	4,400	89,408.00	0.05
389	600586	金晶科技	19,300	89,359.00	0.05
390	600831	广电网络	6,800	88,808.00	0.05
391	600428	中远航运	14,400	88,128.00	0.04
392	600757	长江传媒	10,500	87,255.00	0.04
393	000931	中关村	10,300	87,241.00	0.04
394	600596	新安股份	8,500	87,040.00	0.04
395	002727	一心堂	4,100	86,920.00	0.04
396	000869	张裕A	2,400	86,400.00	0.04
397	000030	富奥股份	10,100	85,850.00	0.04
398	002551	尚荣医疗	4,300	85,613.00	0.04
399	002267	陕天然气	8,900	85,351.00	0.04
400	002309	中利科技	6,000	85,260.00	0.04
401	002093	国脉科技	7,700	85,239.00	0.04
402	601965	中国汽研	8,000	85,200.00	0.04
403	600825	新华传媒	9,800	85,162.00	0.04
404	000417	合肥百货	9,800	84,574.00	0.04
405	601369	陕鼓动力	12,300	84,255.00	0.04
406	600236	桂冠电力	13,700	83,570.00	0.04
407	603328	依顿电子	2,600	83,148.00	0.04
408	600748	上实发展	10,100	82,719.00	0.04
409	000877	天山股份	11,700	82,485.00	0.04
410	002251	步步高	5,000	82,250.00	0.04
411	600776	东方通信	9,600	82,176.00	0.04
412	002029	七匹狼	8,000	81,680.00	0.04
413	600639	浦东金桥	4,400	81,664.00	0.04
414	600180	瑞茂通	6,000	81,240.00	0.04
415	601002	晋亿实业	8,400	79,968.00	0.04
416	600466	蓝光发展	8,200	79,294.00	0.04
417	000919	金陵药业	5,800	78,474.00	0.04
418	002342	巨力索具	11,300	78,083.00	0.04
419	603555	贵人鸟	2,500	76,900.00	0.04
420	000158	常山股份	6,100	76,250.00	0.04
421	601908	京运通	10,700	76,184.00	0.04
422	600743	华远地产	17,100	76,095.00	0.04
423	600141	兴发集团	5,000	76,050.00	0.04
424	002194	武汉凡谷	5,900	75,874.00	0.04
425	603699	纽威股份	4,500	75,780.00	0.04
426	600280	中央商场	8,700	74,907.00	0.04

427	600329	中新药业	4,200	73,248.00	0.04
428	600251	冠农股份	9,000	72,990.00	0.04
429	601126	四方股份	7,400	72,002.00	0.04
430	002327	富安娜	8,100	71,280.00	0.04
431	601515	东风股份	5,900	70,623.00	0.04
432	600335	国机汽车	5,800	70,470.00	0.04
433	002293	罗莱生活	5,200	69,940.00	0.04
434	600456	宝钛股份	4,200	69,426.00	0.04
435	603806	福斯特	1,500	69,405.00	0.04
436	603001	奥康国际	3,000	68,700.00	0.04
437	000631	顺发恒业	14,000	68,600.00	0.03
438	002181	粤传媒	8,700	68,556.00	0.03
439	600874	创业环保	8,400	68,292.00	0.03
440	600507	方大特钢	9,900	67,023.00	0.03
441	600425	青松建化	14,300	66,495.00	0.03
442	002216	三全食品	5,400	65,880.00	0.03
443	002646	青青稞酒	3,400	65,450.00	0.03
444	603883	老百姓	1,400	65,310.00	0.03
445	600801	华新水泥	8,400	65,100.00	0.03
446	600184	光电股份	3,000	64,740.00	0.03
447	600397	安源煤业	12,500	64,500.00	0.03
448	600864	哈投股份	5,400	61,668.00	0.03
449	600618	氯碱化工	4,200	61,278.00	0.03
450	603567	珍宝岛	3,100	61,256.00	0.03
451	600483	福能股份	5,500	60,885.00	0.03
452	002698	博实股份	3,900	60,723.00	0.03
453	603698	航天工程	2,200	60,698.00	0.03
454	000517	荣安地产	11,400	59,964.00	0.03
455	600617	国新能源	5,700	59,850.00	0.03
456	600971	恒源煤电	9,400	58,938.00	0.03
457	002392	北京利尔	9,900	57,024.00	0.03
458	002233	塔牌集团	6,000	56,100.00	0.03
459	600468	百利电气	4,300	55,986.00	0.03
460	600088	中视传媒	2,500	54,800.00	0.03
461	002315	焦点科技	900	54,261.00	0.03
462	601226	华电重工	6,600	54,186.00	0.03
463	603005	晶方科技	1,800	54,072.00	0.03
464	002238	天威视讯	3,500	51,275.00	0.03
465	600510	黑牡丹	5,700	49,191.00	0.03

466	002461	珠江啤酒	4,000	48,200.00	0.02
467	002249	大洋电机	5,400	46,602.00	0.02
468	600917	重庆燃气	3,500	46,165.00	0.02
469	002678	珠江钢琴	2,900	43,152.00	0.02
470	603355	莱克电气	800	36,936.00	0.02
471	603589	口子窖	1,100	35,343.00	0.02
472	603568	伟明环保	1,500	34,950.00	0.02
473	603198	迎驾贡酒	1,600	34,480.00	0.02
474	603025	大豪科技	800	31,224.00	0.02
475	600623	华谊集团	1,600	21,504.00	0.01
476	300591	万里马	2,396	7,355.72	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	000895	双汇发展	3,911,467.50	1.99
2	600900	长江电力	3,896,513.00	1.99
3	600270	外运发展	2,430,678.00	1.24
4	600138	中青旅	2,356,679.13	1.20
5	600166	福田汽车	2,318,154.00	1.18
6	002563	森马服饰	2,081,797.00	1.06
7	000429	粤高速 A	2,046,868.60	1.04
8	600276	恒瑞医药	2,039,251.70	1.04
9	601318	中国平安	2,005,765.00	1.02
10	002008	大族激光	2,001,620.00	1.02
11	300408	三环集团	1,933,324.96	0.99
12	000028	国药一致	1,470,952.19	0.75
13	600038	中直股份	1,396,022.98	0.71
14	600562	国睿科技	1,313,422.92	0.67
15	600452	涪陵电力	1,291,552.36	0.66
16	000963	华东医药	1,234,640.48	0.63
17	300072	三聚环保	613,331.76	0.31
18	002466	天齐锂业	576,187.00	0.29
19	600584	长电科技	506,915.00	0.26

20	600522	中天科技	473,032.00	0.24
----	--------	------	------------	------

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（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	002466	天齐锂业	128,384.00	0.07
2	600201	生物股份	120,462.00	0.06
3	600584	长电科技	110,562.00	0.06
4	600487	亨通光电	110,000.00	0.06
5	300072	三聚环保	109,629.00	0.06
6	600522	中天科技	105,030.00	0.05
7	000661	长春高新	92,429.00	0.05
8	002405	四维图新	91,932.97	0.05
9	002310	东方园林	88,816.00	0.05
10	000656	金科股份	87,532.00	0.04
11	600503	华丽家族	87,120.00	0.04
12	300113	顺网科技	86,877.70	0.04
13	002085	万丰奥威	86,045.00	0.04
14	000983	西山煤电	82,458.00	0.04
15	600521	华海药业	82,180.00	0.04
16	600879	航天电子	79,086.00	0.04
17	002340	格林美	76,788.00	0.04
18	002168	深圳惠程	75,519.00	0.04
19	600219	南山铝业	75,336.00	0.04
20	600266	北京城建	74,790.00	0.04

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	118,150,775.05
卖出股票收入（成交）总额	15,144,795.65

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按照买卖成交金额（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 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,917,000.00	5.06
	其中：政策性金融债	9,917,000.00	5.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,986,000.00	5.09
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	87,846,000.00	44.80
9	其他	-	-
10	合计	107,749,000.00	54.95

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	111681906	16 宁波银行 CD239	300,000	29,682,000.00	15.14
2	111619155	16 恒丰银行 CD155	300,000	28,875,000.00	14.73
3	111608317	16 中信 CD317	200,000	19,652,000.00	10.02
4	011697008	16 滨海建投 SCP001	100,000	9,986,000.00	5.09
5	160311	16 进出 11	100,000	9,917,000.00	5.06

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。

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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

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

注：本基金未参与投资国债期货。

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：本基金本报告期末未持有投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

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报告期内没有被监管部门立案调查，也没有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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	22,806.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	618,355.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	641,162.22

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：报告期末前十名股票未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

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 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
257	778,358.30	200,011,598.82	99.99%	26,483.76	0.01%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年10月19日）基金份额总额	200,038,082.58
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	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	200,038,082.58

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

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

本基金管理人双方股东于 2016 年 3 月 28 日作出决议，一致同意黄慧玲女士不再担任信达澳银基金管理有限公司董事。

本基金管理人 2016 年 4 月 12 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，聘任焦巍先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人双方股东于 2016 年 5 月 14 日作出决议，一致同意选举潘广建先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会董事。

本基金管理人 2016 年 12 月 30 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会第十六次书面决议通过，程文卫先生离任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 3 万元。

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

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
兴业证券	2	133,288,214.98	100.00%	124,131.71	100.00%	新增

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

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
兴业证券	-	-	3,740,200,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金托管协议	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 10 日
2	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 10 日
3	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 10 日

4	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 10 日
5	信达澳银基金管理有限公司关于公司总部迁址的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 12 日
6	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 15 日
7	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 20 日
8	信达澳银基金管理有限公司关于增加直销咨询电话的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 24 日
9	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 25 日
10	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 25 日
11	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 14 日
12	信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 11 月 25 日
13	关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 30 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

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。