

# 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:创金合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:2018 年 03 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
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	16
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	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	60
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	60
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
§9 基金份额持有人信息.....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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情况.....	63
§10 开放式基金份额变动.....	63
§11 重大事件揭示.....	63
11.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
11.8 其他重大事件.....	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§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	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信鑫回报混合	
基金主代码	003190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年08月22日	
基金管理人	创金合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	497,325,908.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C
下属分级基金的交易代码	003190	003191
报告期末下属分级基金的份额总额	497,255,321.89份	70,586.54份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架，基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法，综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素，形成各资产类别预期收益与预期风险的判断，并进而确定股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30% + 一年期人民币定期存款利率（税后）×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	创金合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	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-868-0666		95555
传真	0755-25832571		0755-83195201
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福华一路 15 号投行大厦 15 层		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518000		518040
法定代表人	刘学民		李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 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	2017年		2016年8月22日（基金合同生效日）-2016年12月31日	
	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C
本期已实现收益	15,722,450.95	2,425.95	14,083,869.70	6,280.88
本期利润	6,704,345.70	874.76	1,042,510.61	196.12
加权平均基金份额本期利润	0.0135	0.0092	0.0022	0.0006
本期加权平均净值利润率	1.34%	0.93%	0.22%	0.06%
本期基金份额净值增长率	1.29%	1.10%	0.40%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	8,546,331.41	594.89	1,841,339.02	-511.21
期末可供分配基金份额利润	0.0172	0.0084	0.0037	-0.0031
期末基金资产净值	505,801,653.30	71,181.43	499,337,664.85	164,313.12
期末基金份额净值	1.017	1.008	1.004	0.997
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	1.70%	0.80%	0.40%	-0.30%

注：1. 上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。

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. 期末可供分配利润是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。

4. 本基金合同生效日为2016年8月22日，上年度可比期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

创金合信鑫回报混合A

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	-0.39%	0.14%	1.80%	0.24%	-2.19%	-0.10%
过去六个月	1.60%	0.14%	3.49%	0.21%	-1.89%	-0.07%
过去一年	1.29%	0.15%	7.32%	0.19%	-6.03%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.70%	0.15%	7.24%	0.20%	-5.54%	-0.05%

创金合信鑫回报混合C

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	-0.49%	0.14%	1.80%	0.24%	-2.29%	-0.10%
过去六个月	1.41%	0.14%	3.49%	0.21%	-2.08%	-0.07%
过去一年	1.10%	0.15%	7.32%	0.19%	-6.22%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.15%	7.24%	0.20%	-6.44%	-0.05%

#### 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



创金合鑫回报混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年08月22日-2017年12月31日)

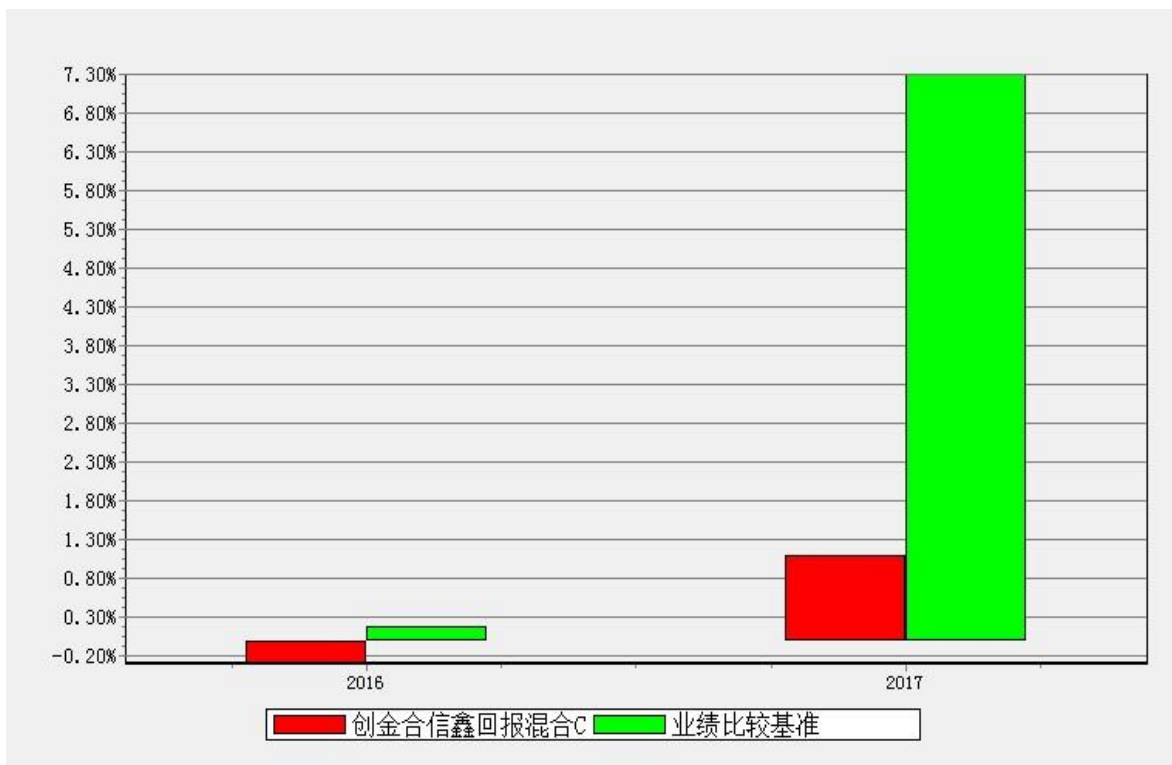
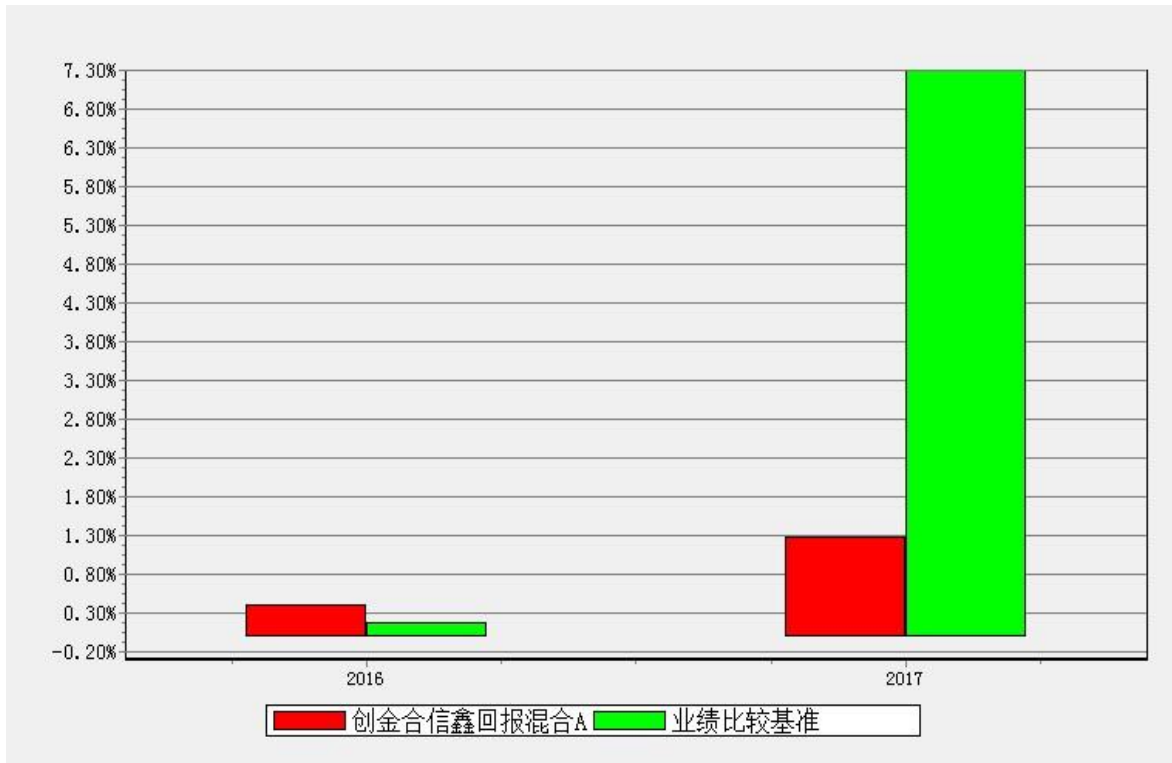


创金合鑫回报混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年08月22日-2017年12月31日)



### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2016年8月22日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2017年12月31日，本公司共管理29只公募基金，其中混合型产品11只、指数型产品4只、债券型产品8只、股票型产品4只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约149.41亿元。

### 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		
李晗	本基金经 理	2016-08- 22	-	10年	李晗先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士，金融风险管理师（FRM），权益投资基金经理。投资中注重基本面研究，寻找行业和企业发展的拐点，擅长挖掘估值合理的持续成长股，与优质企业共同成长中获取丰厚回报。曾任职于海航集团从事并购整合业务。此后任职于鹏华基金，从事专户业务、企业年金业务的研究工作。2009年11月加盟第一创业证券资产管理部，曾担任多个集合理财产品投资主办，投资经验丰富。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
庞世恩	本基金经	2016-09-	-	6年	庞世恩先生，中国国籍，中国

	理	05			中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
蒋小玲	本基金经理	2016-09-05	-	15年	蒋小玲女士，中国国籍，2002年9月-2009年12月任职于武汉农村商业银行，2010年1月-2015年8月任职于江苏江南农村商业银行股份有限公司，历任金融市场部同业经理、交易员、投资经理等职务。2015年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本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，未发现损害基金持有人利益的行为。本基金的投资范围、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 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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证

券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时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。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司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）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及

分析手段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投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共9次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

回顾2017年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

回顾2017年全年，经济整体运行稳中向好，顺利实现全年GDP增速6.9%的增长目标。全年来看，基建投资和房地产投资保持平稳，民间投资和制造业投资经过前期连续下滑开始企稳；工业生产量稳价升带动企业盈利改善明显；消费总体保持稳定较快的增长，已成为经济增长的主要驱动力。伴随着经济的企稳向好，金融去杠杆仍在进行时。为了配合金融去杠杆的金融环境，2017年央行通过加大MLF操作力度、拉长期限、缩短放长的形式提高资金成本，货币政策全年保持稳健中性的基调，对于央行去杠杆和防范金融资产价格泡沫的决心，市场已形成了较为一致的预期。债券市场方面，在去杠杆的大背景下，债券全年继续震荡上行，十年国债收益债从年初的3.10%上行至年末的3.95%左右。去年市场有两次快速的调整，一次是3月底由于委外监管政策出台，引发机构赎回，触发了市场抛压；另一次是10月份开始机构对于四季度经济向下悲观预期的修正，引发市场收益剧烈的调整；叠加美国税改和加息周期，债券收益率快速上行。在操作方面，组合采用较为稳健的操作策略，以中高信用等级信用债作为主要配置标的并严格控制组合久期。四季度面临市场剧烈调整的压力，采取了稳健偏防守的策略，一定程度上控制了组合的回撤。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫回报混合A基金份额净值为1.017元；本报告期内，基金份额净值增长率为1.29%，同期业绩比较基准收益率为7.32%；截至报告期末创金合信鑫回

报混合C基金份额净值为1.008元;本报告期内,基金份额净值增长率为1.1%,同期业绩比较基准收益率为7.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观上看,经济基本面韧性较强,全年增长率超预期。考虑到在房地产政策趋紧的情况下,房地产成交量萎缩,投资房市的资金需要重新配置,在海外投资受限的情况下,权益类资产有望在投资者投资配置中提升权重。从投资情绪来看,市场已在一定程度上回暖,投资者风险偏好提升,爆款基金密集发行,增量资金入市情况明显。

展望未来,供给侧改革仍为主线,2018年要打好防范化解重大风险、精准脱贫、污染防治三大攻坚战。当前经济有韧性,从高速转向高质,未来一段时间内经济向上动能仍然存在;政策基调近期仍以去杠杆、防风险为主,货币政策预计仍将维持中性偏紧状态。在上述基本面和政策面组合下,我们认为周期性行业龙头获利明显,权益市场机会大于债券市场,债券市场难有确定性的反转机会,应当以防御为主。我们会采取相对谨慎的操作策略,严格控制组合杠杆和久期,积极挖掘短久期、高票息的债券,在久期风险可控的情况下力求提高组合静态收益。除此之外,我们还会密切跟踪市场,关注行业安全边际较高的偏股型转债,择机参与波段交易以增厚组合收益。

展望未来,供给侧改革仍为主线,2018年要打好防范化解重大风险、精准脱贫、污染防治三大攻坚战。当前经济有韧性,从高速转向高质,未来一段时间内经济向上动能仍然存在;政策基调近期仍以去杠杆、防风险为主,货币政策预计仍将维持中性偏紧状态。在上述基本面和政策面组合下,我们认为周期性行业龙头获利明显,权益市场机会大于债券市场,债券市场难有确定性的反转机会,应当以防御为主。我们会采取相对谨慎的操作策略,严格控制组合杠杆和久期,积极挖掘短久期、高票息的债券,在久期风险可控的情况下力求提高组合静态收益。除此之外,我们还会密切跟踪市场,关注行业安全边际较高的偏股型转债,择机参与波段交易以增厚组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规,坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下:

(1) 开展全面自查工作,排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患,制定整改计划,并督促按计划完成整改;

(2) 开展公司专项稽核工作,了解合规风险现状、发现薄弱环节,并持续督导改进;

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。修订完善《信息披露制度》等制度，建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、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

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 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，在本报告期内，基金托管人—招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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、利润分配、投资组合报告等内容真实、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(2018)第21825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	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“创金合信鑫回报混合基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017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。(二) 我们的意见 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

	<p>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,公允反映了创金合信鑫回报混合基金2017年12月31日的财务状况以及2017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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信鑫回报混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>创金合信鑫回报混合基金的基金管理人创金合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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创金合信鑫回报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创金合信鑫回报混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督创金合信鑫回报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	<p>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</p>

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，就可能对创金合信鑫回报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创金合信鑫回报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	曹翠丽、边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2018-03-27

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,944,521.02	7,501,057.65
结算备付金		476,334.39	336,381.80
存出保证金		3,493.98	22,215.16
交易性金融资产	7.4.7.2	479,296,710.91	512,832,279.32
其中：股票投资		69,767,710.91	66,865,279.32
基金投资		-	-
债券投资		409,529,000.00	445,967,000.00
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	12,610,138.92	-
应收证券清算款		-	105,866.23
应收利息	7.4.7.5	9,270,322.95	9,352,484.27
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		506,601,522.17	530,150,284.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	29,999,715.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		257,379.91	253,423.70
应付托管费		85,793.29	84,474.59
应付销售服务费		12.09	31.39
应付交易费用	7.4.7.7	216,502.15	207,564.72
应交税费		-	-
应付利息		-	29,097.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	169,000.00	74,000.00
负债合计		728,687.44	30,648,306.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	497,325,908.43	497,661,150.16
未分配利润	7.4.7.1 0	8,546,926.30	1,840,827.81
所有者权益合计		505,872,834.73	499,501,977.97
负债和所有者权益总计		506,601,522.17	530,150,284.43

注：1. 报告截止日2017年12月31日，基金份额总额497,325,908.43份，其中A类基金份额的份额总额为497,255,321.89份，份额净值1.017元；C类基金份额的份额总额为70,586.54份，份额净值1.008元。

2. 本基金合同生效日为2016年8月22日，上年度可比期间为2016年8月22日至2016年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		13,268,475.85	3,266,273.31
1. 利息收入		21,869,551.78	7,000,941.01
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	87,731.78	160,704.48
债券利息收入		21,647,320.84	6,603,710.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		134,499.16	236,525.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		418,218.44	6,670,978.08
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-199,779.86	6,665,106.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-906,113.25	-4,070.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	1,524,111.55	9,942.00

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 6	-9,019,656.44	-13,047,443.85
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 7	362.07	2,641,798.07
<b>减：二、费用</b>		6,563,255.39	2,223,566.58
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	3,007,040.50	1,007,482.63
2. 托管费	7.4.10. 2.2	1,002,346.93	335,827.58
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	190.65	222.06
4. 交易费用	7.4.7.1 8	1,507,841.40	386,442.18
5. 利息支出		840,079.85	384,303.22
其中：卖出回购金融资产支出		840,079.85	384,303.22
6. 其他费用	7.4.7.1 9	205,756.06	109,288.91
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		6,705,220.46	1,042,706.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		6,705,220.46	1,042,706.73

注：本基金合同生效日为2016年8月22日，上年度可比期间为2016年8月22日至2016年12月31日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
	2017年01月01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)	497,661,150.16	1,840,827.81	499,501,977.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,705,220.46	6,705,220.46
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)	-335,241.73	878.03	-334,363.70
其中：1. 基金申购款	14,757.29	116.53	14,873.82
2. 基金赎回款	-349,999.02	761.50	-349,237.52
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	497,325,908.43	8,546,926.30	505,872,834.73
项 目	上年度可比期间 2016年08月22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)	500,781,246.31	-	500,781,246.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,042,706.73	1,042,706.73
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)	-3,120,096.15	798,121.08	-2,321,975.07
其中：1. 基金申购款	497,392,445.44	2,785,591.16	500,178,036.60
2. 基金赎回款	-500,512,541.59	-1,987,470.08	-502,500,011.67
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）	497,661,150.16	1,840,827.81	499,501,977.97
-----------------	----------------	--------------	----------------

注：本基金合同生效日为2016年8月22日，上年度可比期间为2016年8月22日至2016年12月31日。

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：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

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

创金合信鑫回报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]1644号《关于准予创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]1425号《关于创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由创金合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《创金合信鑫回报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500,713,694.31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1108号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为500,781,246.31份基金份额,其中认购资金利息折合67,552.00份基金份额。本基金的基金管理人为创金合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(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫回报灵活配置混合型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(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)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相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30% + 一年期人民币定期存款利率(税后)×70%。

## 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》、《创金合信鑫回报灵活配置混合型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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

### 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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确认，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、托管费和销售服务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

本基金的收益分配政策为：(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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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) 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央国债登记结算有限责任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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以

内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	4,944,521.02	7,501,057.65
定期存款	-	-
其中:存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	4,944,521.02	7,501,057.65

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	71,228,042.00	69,767,710.91	-1,460,331.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	54,000.00	54,000.00	
	银行间市场	430,081,769.20	409,475,000.00	-20,606,769.20
	合计	430,135,769.20	409,529,000.00	-20,606,769.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	501,363,811.20	479,296,710.91	-22,067,100.29
项目	上年度末2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	68,530,636.81	66,865,279.32	-1,665,357.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	457,349,086.36	445,967,000.00
	合计	457,349,086.36	445,967,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	525,879,723.17	512,832,279.32	-13,047,443.85

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	12,610,138.92	-
合计	12,610,138.92	-
项目	上年度末2016年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-



**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,060.31	1,971.41
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	235.84	166.54
应收债券利息	9,247,352.48	9,350,335.32
应收买入返售证券利息	21,672.56	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.76	11.00
合计	9,270,322.95	9,352,484.27

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	215,617.53	204,053.81
银行间市场应付交易费用	884.62	3,510.91
合计	216,502.15	207,564.72

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 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	169,000.00	74,000.00
合计	169,000.00	74,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 创金合信鑫回报混合A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信鑫回报混合A)	本期2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	497,496,325.83	497,496,325.83
本期申购	6,966.65	6,966.65
本期赎回(以“-”号填列)	-247,970.59	-247,970.59
本期末	497,255,321.89	497,255,321.89

## 7.4.7.9.2 创金合信鑫回报混合C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信鑫回报混合C)	本期2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	164,824.33	164,824.33
本期申购	7,790.64	7,790.64
本期赎回(以“-”号填列)	-102,028.43	-102,028.43
本期末	70,586.54	70,586.54

注：申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 创金合信鑫回报混合A

单位：人民币元

项目 (创金合信鑫回报混合 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,024,806.86	-13,183,467.84	1,841,339.02
本期利润	15,722,450.95	-9,018,105.25	6,704,345.70
本期基金份额交易产 生的变动数	-8,188.28	8,834.97	646.69
其中：基金申购款	350.70	-225.87	124.83
基金赎回款	-8,538.98	9,060.84	521.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,739,069.53	-22,192,738.12	8,546,331.41

##### 7.4.7.10.2 创金合信鑫回报混合C

单位：人民币元

项目 (创金合信鑫回报混合 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,833.20	-4,344.41	-511.21
本期利润	2,425.95	-1,551.19	874.76
本期基金份额交易产 生的变动数	-2,535.66	2,767.00	231.34
其中：基金申购款	249.71	-258.01	-8.30
基金赎回款	-2,785.37	3,025.01	239.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,723.49	-3,128.60	594.89

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年08月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	79,099.29	155,847.62
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	8,311.19	4,786.41
其他	321.30	70.45
合计	87,731.78	160,704.48

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	547,663,878.14	114,630,212.40
减：卖出股票成本总额	547,863,658.00	107,965,106.32
买卖股票差价收入	-199,779.86	6,665,106.08

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2 017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券 （、债转股及债券到期兑付） 差价收入	-906,113.25	-4,070.00
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价	-	-

收入		
合计	-906,113.25	-4,070.00

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2 017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22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	113,280,567.86	10,143,979.73
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	110,852,357.16	10,006,910.00
减：应收利息总额	3,334,323.95	141,139.73
买卖债券差价收入	-906,113.25	-4,070.00

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本期及上年度可比期间均未发生衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22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	1,524,111.55	9,942.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,524,111.55	9,942.00

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-9,019,656.44	-13,047,443.85
——股票投资	205,026.40	-1,665,357.49
——债券投资	-9,224,682.84	-11,382,086.36
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-9,019,656.44	-13,047,443.85

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	362.07	2,641,798.07
合计	362.07	2,641,798.07

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,506,741.40	381,929.68
银行间市场交易费用	1,100.00	4,512.50

合计	1,507,841.40	386,442.18
----	--------------	------------

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	65,000.00
信息披露费	100,000.00	30,000.00
汇划手续费	8,556.06	4,888.91
账户维护费	36,000.00	9,400.00
查询服务费	1,200.00	-
合计	205,756.06	109,288.91

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

关联方名称	与本基金的关系
创金合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（“招商银行”）	基金托管人
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日		上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同 生效日）至2016年12月31日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成 交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	774,81 8,267.6 1	70.79%	125,506, 630.74	43.35%

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期佣 金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
第一创业证券股份有限公 司	565,09 2.75	65.56%	150,662.1 1	69.87%
关联方名称	上年度可比期间 2016年08月22日至2016年12月31日			
	当期佣 金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
第一创业证券股份有限公 司	90,63 1.43	37.51%	53,071.05	26.01%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。



2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日		上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同 生效日）至2016年12月31日	
	成交金 额	占当期债券买 卖成交总额的 比例	成交 金额	占当期债券买卖成 交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	3,040, 408.10	80.53%	-	-

#### 7.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日		上年度可比期间 2016年08月22日（基金合同 生效日）至2016年12月31日	
	成交金 额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交金 额	占当期债券回购 成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	199,30 0,000.0 0	92.57%	375,00 0,000.0 0	100.00%

#### 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 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年08月22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	3,007,040.50	1,007,482.63

其中：支付销售机构的客户维护费	591.39	609.03
-----------------	--------	--------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年08月22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	1,002,346.93	335,827.58

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C	合计
创金合信直销	-	5.18	5.18
合计	-	5.18	5.18

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年08月22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销售服务费		
	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C	合计
创金合信直销	-	39.57	39.57
合计	-	39.57	39.57

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值× 0.2%/ 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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		上年度可比期间	
	2017年01月01日至2017年12月31日		2016年08月22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	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,944,521.02	79,099.29	7,501,057.65	155,847.62

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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	备注
600057	象屿股份	2017-12-28	2018-01-08	新发流通受限	6.10	8.09	18,750	114,375.00	151,687.50	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新发流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113503	泰晶转债	2017-12-19	2018-01-02	新发流通受限	100.00	100.00	540	54,000.00	54,000.00	-

##### 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

6006 64	哈药 股份	2017 -09- 28	重大 事项 停牌	5.81	2018 -02- 27	6.00	115,600	671, 844. 00	671, 636. 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2017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为0.00,无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00,无抵押债券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 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和债券的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所(场内)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,违约风险很小;在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

注：

- 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级，依照在一个会计年度孰新孰低原则，若此会计年度无评级，则追溯上一会计年度，上一会计年度无评级则为无评级。
- 2、未评级债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单等债券。
- 3、债券投资以净价列示。
- 4、若出现期限为1年以内的债券评级为长期信用评级的标志，不进行评级等同。

#### 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	270,577,000.00	298,633,000.00
AAA以下	98,922,000.00	107,246,000.00
未评级	40,030,000.00	40,088,000.00
合计	409,529,000.00	445,967,000.00

注：

- 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级，依照在一个会计年度孰新孰低原则，若此会计年度无评级，则追溯上一会计年度，上一会计年度无评级则为无评级。
- 2、未评级债券为期限一年以上的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单等债券。
- 3、债券投资以净价列示。
- 4、若出现期限为1年以内的债券评级为长期信用评级的标志，不进行评级等同。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2017年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2017年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为505184495.33元，超过经确认的当日净赎回金额。于2017年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.18%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算

足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017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	4,944,521.02	-	-	-	4,944,521.02
结算备付金	476,334.39	-	-	-	476,334.39
存出保证金	3,493.98	-	-	-	3,493.98
交易性金融资产	180,044,000.00	219,470,000.00	10,015,000.00	69,767,710.91	479,296,710.91
买入返售金融资产	12,610,138.92	-	-	-	12,610,138.92
应收利息	-	-	-	9,270,320.00	9,270,320.00



				2.95	2.95
资产总计	198,078,488.31	219,470,000.00	10,015,000.00	79,038,033.86	506,601,522.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	257,379.91	257,379.91
应付托管费	-	-	-	85,793.29	85,793.29
应付销售服务费	-	-	-	12.09	12.09
应付交易费用	-	-	-	216,502.15	216,502.15
其他负债	-	-	-	169,000.00	169,000.00
负债总计	-	-	-	728,687.44	728,687.44
利率敏感度缺口	198,078,488.31	219,470,000.00	10,015,000.00	78,309,346.42	505,872,834.73
上年度末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	7,501,057.65	-	-	-	7,501,057.65
结算备付金	336,381.80	-	-	-	336,381.80
存出保证金	22,215.16	-	-	-	22,215.16
交易性金融资产	60,286,000.00	385,681,000.00	-	66,865,279.32	512,832,279.32
应收证券清算款	-	-	-	105,866.23	105,866.23
应收利息	-	-	-	9,352,484.27	9,352,484.27
资产总计	68,145,654.61	385,681,000.00	-	76,323,629.82	530,150,284.43

负债					
卖出回购金融资产款	29,999,715.00	-	-	-	29,999,715.00
应付管理人报酬	-	-	-	253,423.70	253,423.70
应付托管费	-	-	-	84,474.59	84,474.59
应付销售服务费	-	-	-	31.39	31.39
应付交易费用	-	-	-	207,564.72	207,564.72
应付利息	-	-	-	29,097.06	29,097.06
其他负债	-	-	-	74,000.00	74,000.00
负债总计	29,999,715.00	-	-	648,591.46	30,648,306.46
利率敏感度缺口	38,145,939.61	385,681,000.00	-	75,675,038.36	499,501,977.97

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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：人民币元)	
		本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,248,143.13	-2,142,662.39
	市场利率下降25个基点	1,256,364.09	2,160,919.16

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

#### 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 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价 值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	69,767,710.91	13.79	66,865,279.32	13.39
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	69,767,710.91	13.79	66,865,279.32	13.39

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2017年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为13.79%(2016年12月31日：13.39%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年12月31日：同)。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值

所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017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68,907,490.96 元，属于第二层次的余额为410,389,219.95 元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次64,804,727.38元，第二层次448,027,551.94元，无第三层次)。

(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2017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(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》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、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营

资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	69,767,710.91	13.77
	其中：股票	69,767,710.91	13.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	409,529,000.00	80.84
	其中：债券	409,529,000.00	80.84
	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	12,610,138.92	2.49
	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	5,420,855.41	1.07
8	其他各项资产	9,273,816.93	1.83
9	合计	506,601,522.17	100.00

### 8.2 报告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

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	-	-
B	采矿业	654,336.00	0.13
C	制造业	32,155,664.30	6.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,871,921.45	0.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,253,412.70	2.03

G	交通运输、仓储和邮政业	7,447,868.76	1.47
H	住宿和餐饮业	683,298.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	696,200.00	0.14
K	房地产业	5,337,242.00	1.06
L	租赁和商务服务业	2,105,416.30	0.42
M	科学研究和技术服务业	1,357,465.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	660,564.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	834,432.00	0.16
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,709,890.40	0.54
S	综合	-	-
	合计	69,767,710.91	13.79

### 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	600661	新南洋	32,800	834,432.00	0.16
2	600486	扬农化工	15,600	775,164.00	0.15
3	600529	山东药玻	34,500	764,520.00	0.15
4	600195	中牧股份	38,600	760,806.00	0.15
5	600057	象屿股份	93,750	758,437.50	0.15
6	603599	广信股份	37,900	740,566.00	0.15
7	601222	林洋能源	73,000	740,220.00	0.15
8	600398	海澜之家	76,000	737,200.00	0.15
9	603936	博敏电子	25,483	732,636.25	0.14
10	600361	华联综超	134,100	730,845.00	0.14
11	603808	歌力思	31,530	725,190.00	0.14
12	603818	曲美家居	49,700	723,632.00	0.14
13	603899	晨光文具	29,200	720,072.00	0.14

14	600035	楚天高速	138,100	719,501.00	0.14
15	600511	国药股份	25,800	717,240.00	0.14
16	600479	千金药业	51,100	716,422.00	0.14
17	601678	滨化股份	87,900	713,748.00	0.14
18	601588	北辰实业	123,200	713,328.00	0.14
19	600729	重庆百货	28,300	709,198.00	0.14
20	600323	瀚蓝环境	44,400	708,180.00	0.14
21	603017	中衡设计	42,500	702,525.00	0.14
22	600998	九州通	37,000	701,150.00	0.14
23	600236	桂冠电力	121,651	699,493.25	0.14
24	600674	川投能源	68,700	699,366.00	0.14
25	600270	外运发展	40,400	698,112.00	0.14
26	603368	柳州医药	14,550	696,508.50	0.14
27	600390	五矿资本	59,000	696,200.00	0.14
28	601566	九牧王	49,000	695,800.00	0.14
29	603701	德宏股份	35,890	694,471.50	0.14
30	600757	长江传媒	99,900	694,305.00	0.14
31	600093	易见股份	64,700	693,584.00	0.14
32	601010	文峰股份	171,000	692,550.00	0.14
33	603738	泰晶科技	28,470	691,251.60	0.14
34	600979	广安爱众	128,700	691,119.00	0.14
35	601158	重庆水务	106,800	689,928.00	0.14
36	601811	新华文轩	51,300	688,959.00	0.14
37	600101	明星电力	74,400	686,712.00	0.14
38	600287	江苏舜天	93,600	685,152.00	0.14
39	600366	宁波韵升	39,100	685,032.00	0.14
40	603167	渤海轮渡	59,400	684,288.00	0.14
41	600697	欧亚集团	26,600	684,152.00	0.14
42	600219	南山铝业	185,900	684,112.00	0.14
43	601007	金陵饭店	63,800	683,298.00	0.14
44	600056	中国医药	27,452	683,280.28	0.14

45	600723	首商股份	83,200	682,240.00	0.13
46	603866	桃李面包	17,500	681,975.00	0.13
47	600982	宁波热电	158,000	680,980.00	0.13
48	600325	华发股份	92,500	680,800.00	0.13
49	600572	康恩贝	96,110	679,497.70	0.13
50	601137	博威合金	58,843	677,871.36	0.13
51	603589	口子窖	14,700	676,935.00	0.13
52	603788	宁波高发	19,200	676,800.00	0.13
53	601965	中国汽研	80,750	676,685.00	0.13
54	600356	恒丰纸业	81,443	675,976.90	0.13
55	600269	赣粤高速	132,000	675,840.00	0.13
56	600561	江西长运	82,300	674,860.00	0.13
57	600665	天地源	158,000	674,660.00	0.13
58	600475	华光股份	46,600	674,302.00	0.13
59	600582	天地科技	144,600	672,390.00	0.13
60	600664	哈药股份	115,600	671,636.00	0.13
61	600551	时代出版	57,000	669,180.00	0.13
62	601515	东风股份	68,200	668,360.00	0.13
63	600350	山东高速	111,500	667,885.00	0.13
64	600713	南京医药	107,300	667,406.00	0.13
65	601518	吉林高速	189,000	667,170.00	0.13
66	600580	卧龙电气	83,200	666,432.00	0.13
67	601107	四川成渝	161,700	666,204.00	0.13
68	600976	健民集团	28,300	666,182.00	0.13
69	600708	光明地产	97,100	665,135.00	0.13
70	600824	益民集团	137,600	664,608.00	0.13
71	601567	三星医疗	68,400	663,480.00	0.13
72	600894	广日股份	70,900	662,915.00	0.13
73	600393	粤泰股份	104,500	662,530.00	0.13
74	600810	神马股份	94,200	662,226.00	0.13
75	603869	北部湾旅	31,100	660,564.00	0.13



76	600750	江中药业	25,900	659,932.00	0.13
77	600279	重庆港九	112,400	659,788.00	0.13
78	600185	格力地产	116,000	658,880.00	0.13
79	600548	深高速	73,300	658,234.00	0.13
80	600020	中原高速	135,400	658,044.00	0.13
81	600308	华泰股份	104,700	657,516.00	0.13
82	600229	城市传媒	85,605	657,446.40	0.13
83	600297	广汇汽车	81,960	657,319.20	0.13
84	603018	中设集团	22,900	654,940.00	0.13
85	603979	金诚信	63,900	654,336.00	0.13
86	600743	华远地产	178,600	653,676.00	0.13
87	600790	轻纺城	109,630	653,394.80	0.13
88	600114	东睦股份	41,200	652,196.00	0.13
89	600382	广东明珠	51,800	651,644.00	0.13
90	600075	新疆天业	83,800	651,126.00	0.13
91	600126	杭钢股份	94,600	649,902.00	0.13
92	603567	珍宝岛	45,900	648,567.00	0.13
93	600704	物产中大	94,900	647,218.00	0.13
94	600727	鲁北化工	86,300	645,524.00	0.13
95	601126	四方股份	82,300	644,409.00	0.13
96	600775	南京熊猫	81,700	643,796.00	0.13
97	603663	三祥新材	31,700	642,242.00	0.13
98	603100	川仪股份	63,600	636,000.00	0.13
99	601677	明泰铝业	48,600	632,772.00	0.13
100	600531	豫光金铅	97,200	629,856.00	0.12
101	600736	苏州高新	106,300	628,233.00	0.12
102	600808	马钢股份	146,400	604,632.00	0.12
103	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
104	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
105	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
106	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.00

107	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
108	603655	朗博科技	881	8,193.30	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	600019	宝钢股份	4,782,925.00	0.96
2	600585	海螺水泥	4,754,330.00	0.95
3	601006	大秦铁路	4,739,598.55	0.95
4	600028	中国石化	4,738,042.00	0.95
5	601225	陕西煤业	4,700,307.00	0.94
6	600637	东方明珠	4,611,038.80	0.92
7	600900	长江电力	4,091,395.00	0.82
8	601899	紫金矿业	4,091,272.00	0.82
9	600023	浙能电力	4,083,842.70	0.82
10	600061	国投资本	4,082,332.35	0.82
11	600999	招商证券	4,076,626.00	0.82
12	600104	上汽集团	4,070,339.04	0.81
13	601088	中国神华	4,067,636.00	0.81
14	600893	航发动力	4,051,681.00	0.81
15	600010	包钢股份	4,013,906.00	0.80
16	603167	渤海轮渡	2,704,376.00	0.54
17	601567	三星医疗	2,699,600.00	0.54
18	600269	赣粤高速	2,660,919.00	0.53
19	601010	文峰股份	2,639,674.04	0.53
20	603518	维格娜丝	2,616,959.30	0.52

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，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	占期初基金资产
----	------	------	---------	---------

			额	净值比例 (%)
1	601225	陕西煤业	5,564,380.88	1.11
2	600585	海螺水泥	5,071,483.00	1.02
3	600019	宝钢股份	5,069,056.00	1.01
4	600637	东方明珠	4,788,111.36	0.96
5	601006	大秦铁路	4,697,213.00	0.94
6	600028	中国石化	4,592,444.00	0.92
7	600893	航发动力	4,537,254.76	0.91
8	601899	紫金矿业	4,282,048.00	0.86
9	600900	长江电力	4,224,468.00	0.85
10	601088	中国神华	4,211,606.00	0.84
11	600104	上汽集团	4,165,372.00	0.83
12	600061	国投资本	4,162,577.46	0.83
13	600010	包钢股份	4,144,934.00	0.83
14	600999	招商证券	4,091,463.00	0.82
15	600023	浙能电力	3,881,230.62	0.78
16	603518	维格娜丝	2,518,800.20	0.50
17	600438	通威股份	2,498,360.00	0.50
18	600218	全柴动力	2,466,138.00	0.49
19	601799	星宇股份	2,405,598.04	0.48
20	601233	桐昆股份	2,289,143.77	0.46

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,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	550,561,063.19
卖出股票收入(成交)总额	547,663,878.14

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,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	69,365,000.00	13.71
	其中：政策性金融债	40,030,000.00	7.91
4	企业债券	18,237,000.00	3.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	321,873,000.00	63.63
7	可转债(可交换债)	54,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	409,529,000.00	80.95

#### 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	101460001	14闽电信MTN001	400,000	40,936,000.00	8.09
2	1382243	13粤城建MTN1	400,000	40,128,000.00	7.93
3	101575004	15金融街MTN002	400,000	39,940,000.00	7.90
4	101465008	14苏交通MTN001	300,000	30,378,000.00	6.01
5	101575002	15沪城控MTN001 (3年期)	300,000	30,099,000.00	5.95

#### 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

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。

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，未出现基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

#### 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	3,493.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,270,322.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,273,816.93

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部	占基金资产净	流通受限情
----	------	------	-------	--------	-------

			分的公允价 值	值比例 (%)	况说明
1	600057	象屿股份	151,687.50	0.03	-

## § 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

份额 级别	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
创金 合信 鑫回 报混 合A	162	3,069,477.30	497,212,925.04	99.99%	42,396.85	0.01%
创金 合信 鑫回 报混 合C	45	1,568.59	-	-	70,586.54	100.00%
合计	201	2,474,258.25	497,212,925.04	99.98%	112,983.39	0.02%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	创金合信鑫回报混合A	29,733.64	0.0100%
	创金合信鑫回报	1,898.55	2.6900%

	混合C		
	合计	31,632.19	0.0100%

### 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情况

项目	份额级别	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	创金合信鑫回报混合A	0~10
	创金合信鑫回报混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信鑫回报混合A	0~10
	创金合信鑫回报混合C	0~10
	合计	0~10

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信鑫回报混合A	创金合信鑫回报混合C
基金合同生效日(2016年08月22日)基金份额总额	500,349,524.01	431,722.30
本报告期期初基金份额总额	497,496,325.83	164,824.33
本报告期基金总申购份额	6,966.65	7,790.64
减：本报告期基金总赎回份额	247,970.59	102,028.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	497,255,321.89	70,586.54

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用60,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为2年。

### 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，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
光大证券	2	319,767,160.49	29.21%	296,809.97	34.44%	-
第一创业证券	2	774,818,267.61	70.79%	565,092.75	65.56%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能为基金提供全面的信息服。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金本报告期内无交易单元变更。

#### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	734,931.26	19.47%	16,000.00	7.43%	-	-	-	-
第一创业证券	3,040,408.10	80.53%	199,300.00	92.57%	-	-	-	-

### 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	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、中国证券报	2017-01-01
2	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告	公司官网、中国证券报	2017-01-23
3	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告	公司官网、中国证券报	2017-03-27
4	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告-摘要	公司官网、中国证券报	2017-03-27
5	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金（2017年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2017-04-08
6	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第1	公司官网、中国证券报	2017-04-08

	号)		
7	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2017-04-21
8	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加安信证券为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-04-26
9	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金及其代销机构一览表的公告	公司官网、中国证券报	2017-06-23
10	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、中国证券报	2017-07-01
11	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年第二季度报告	公司官网、中国证券报	2017-07-19
12	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告	公司官网、中国证券报	2017-08-25
13	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2017-08-25
14	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2017-09-29
15	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（摘要）	公司官网、中国证券报	2017-09-29
16	创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告	公司官网、中国证券报	2017-10-27
17	创金合信基金管理有限公司关于增值税对资产管理产品	公司官网、中国证券报	2017-12-30

	影响告投资者通知书		
--	-----------	--	--

## § 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	20170101-20171231	497,212,925.04	0.00	0.00	497,212,925.04	99.98%

#### 产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

#### 1、大额申购风险

在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；

(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；

(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录.

- 1、《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 13.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十一日