# 金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:金信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年3月26日

## §1 重要提示

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 金信深圳成长混合 |
| 基金主代码 | 002863 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年12月22日 |
| 基金管理人 | 金信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 150,525,786.31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,从主要业务或者主体位于深圳的上市公司中选择具有持续成长能力的公司进行投资,力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要有以下五个方面:<br>1.大类资产配置策略<br>本基金将通过跟踪考量宏观经济指标以及各项国家政策来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对进行分析评估,制定大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。<br>2.股票投资策略<br>基金以深圳区域为投资主题,投资范围为主要业务或者主体位于深圳的上市公司,深度挖掘深圳在城市提升、改革转型、科技创新以及与世界经济融合发展过程中产生的各类投资机遇,力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。<br>3.债券投资策略<br>在大类资产配置的基础上,本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取的积极投资策略,把握债券市场投资机会,实施积极主动的组合管理,以获取稳健的投资收益。<br>4.资产支持证券投资策略<br>本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前信还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。<br>5.衍生品投资策略<br>1)股指期货投资策略<br>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。<br>2)权证投资策略<br>权证为本基金辅助性投资工具。 |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 金信基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段卓立 | 张燕 |
| | 联系电话 | 0755-82510502 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | jxbao@jxfunds.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-866-2866 | 95555 |
| 传真 | | 0755-82510305 | 0755-83195201 |

2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018年 | 2017年 | 2016年12月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -30,499,385.38 | 590,606.24 | -10,297.65 |
| 本期利润 | -30,933,796.73 | 824,620.47 | -35,668.08 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2294 | 0.0402 | -0.0024 |
| 本期基金份额净值增长率 | -5.41% | 3.71% | -0.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末 | 2017年末 | 2016年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2144 | 0.0183 | -0.0018 |
| 期末基金资产净值 | 147,406,521.54 | 12,048,888.65 | 20,029,576.20 |
| 期末基金份额净值 | 0.979 | 1.035 | 0.998 |

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

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;

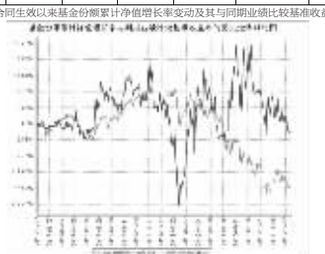
3.期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中,期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

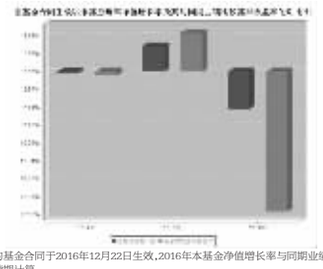
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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标准差③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -9.69% | 1.56% | -8.08% | 1.19% | -1.61% | 0.37% |
| 过去六个月 | -7.29% | 1.93% | -13.45% | 1.06% | 6.16% | 0.87% |
| 过去一年 | -5.41% | 2.09% | -19.53% | 0.97% | 14.12% | 1.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.10% | 1.65% | -16.09% | 0.79% | 13.99% | 0.86% |

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



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



注:本基金的基金合同于2016年12月22日生效,2016年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金的基金合同于2016年12月22日生效,截至2018年12月31日,本基金成立未满三年。自合同生效起,本基金无利润分配事项。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 唐雷 | 本基金基金经理 | 2016年12月22日 | - | 11 | 男,武汉大学物理学理学学士、北京大学光华管理学院工商管理硕士。先后任职于民生加银基金、安信证券资产管理部。限担任金信基金基金经理。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订)等有关法律法规的规定,针对股票、债券市场交易等投资管理活动,以及投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,制定了《金信基金管理有限公司公平交易制度》、《金信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理制度》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的投告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采取自上而下的投资策略,对宏观经济、国家政策、市场趋势和结构进行深度分析的基础上,加强基于行业比较的大类资产配置,同时结合公司的深度研究,采用灵活积极主动的投资策略,在尽力规避市场风险的前提下,力求给投资者带来长期稳定的投资回报。

2018年的A股市场受到经济下行、"去杠杆"政策、中美"贸易战"等等多重负面因素的影响,基本处于单边下行趋势中。我们自上而下的投资框架在2018年取得了较好的投资效果,一方面多次减仓规避系统性风险,另一方面通过行业比较,把握了市场最好的结构性机会。金信深圳成长基金全年收益率-5.41%,相对沪深300指数超额收益19.9个百分点。

我们在一季度布局的高科技成长板块在"贸易战"初期迎市上涨,为投资者取得了较为可观的收益,5月底,通过对"贸易战"、债券市场和宏观经济的前瞻性研究,我们判断市场可能会面临比较大的下行风险,随即开始大幅度降低股票仓位,成功地规避了6月份市场的大幅度下跌。在6月底市场大跌之后,我们把握了市场的做多窗口期,通过配置半导体、云计算领域的高景成长龙头股获取了显著的超额收益。9月中下旬,我们考虑到贸易战升级的可能性,判断市场可能会出现比较大的风险,及时大幅度降低了高弹性的科技成长类股票的仓位,控制系统性风险。随后我们根据政策面的变化,逐步将基金配置重点转移到低估值蓝筹板块。由于四季度政策推出的力度和进度低于预期,很遗憾我们的逻辑没有得到验证,组合的表现平淡。所幸的是,在12月中旬,我们判断市场面临政策低于预期带来的下行风险,及时大幅度降低了权益投资仓位,有效规避了市场风险,维持了净值的相对稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.979元;本报告期基金份额净值增长率为-5.41%,业绩比较基准收益率为-19.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年宏观经济面临不行压力。2019年宏观经济处于短周期下行叠加中周期增速换挡的压力阶段,房地产投资见顶回落,制造业投资继续上升可能性较小;中美贸易战长期化,以及海外经济下行,出口压力增大;消费增长中枢下移,而且消费的后周期属性在今年集中体现。同时,宏观经济下行的压力将带来上市公司企业盈利增速下行。

诸多改革和托底政策有望使宏观经济至少在上半年阶段性企稳。面对巨大的经济下行压力,从2018年底开始,政策改革和托底的力度开始明显加大,个税抵扣、中小企业所得税优惠,以及未来的增值税减税结构稳步出台,户籍制度、土地制度、国有企业、资本市场、金融体系等等方面的改革力度显著增加,货币政策逆周期调节力度增加,结构性去杠杆转为稳杠杆,非标融资收缩趋缓,社融和信贷开始回升,宽货币有望逐步转化为宽信用。积极财政政策发力,基建投资去年四季度开始已经转为正增长,上半年有望有效对冲经济的下行压力。

展望2019年,A股市场面临估值中枢的系统性抬升带来的机会。经过了2018年经济预期的数次下修,市场参与者对于宏观经济的预期已经趋于悲观。除非出现经济失速下行,至少在上半年,宏观经济和企业盈利增速下行对市场的边际冲击将会逐步钝化。更重要的是,在2018年受到多重抑制的估值体系有可能出现系统性抬升,影响市场估值体系的金融监管、资本市场流动性、风险溢价和风险偏好都在好转。

首先,金融监管由去杠杆进入稳杠杆阶段,压制信用扩张的政策因素面临修正。其次,货币政策宽松力度加大,尤其是十年期国债收益率接近3%甚破3%,资本市场的流动性状况将会逐步改善。再次,信用利差和风险溢价处于历史高位,边际上有下行的趋势。最后,经济的阶段性企稳、中美关系的缓解和各项政策的逐步推出有利于权益市场的风险偏好的提升。

基于A股市场面临估值系统性上升的机会的判断,结构上我们重点关注两类投资机会:1)高成长高景气行业的高盈利增速叠加估值提升的戴维斯双击的机会,比如光伏、电动车、特高压、通信等等;2)受政策引导或者宏观经济预期的变化,具有高估值弹性的低估值金融板块可能阶段性面临估值修复,比如券商、保险、银行等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,报告期本基金无利润分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2019)第20973号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"金信深圳成长混合基金")的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会以下简称"中国证监会"),中国证券投资基金业协会以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了金信深圳成长混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。<br>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于金信深圳成长混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | 无。 |
| 其他事项 | 无。 |
| 其他信息 | 无。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 金信深圳成长混合基金的基金管理人金信基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估金信深圳成长混合基金持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算金信深圳成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督金信深圳成长混合基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。<br>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:<br>(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。<br>(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。<br>(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。<br>(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,就可能导致对金信深圳成长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,则需在财要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致金信深圳成长混合基金不能持续经营。<br>(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。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 陈麟 陈巍巍 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 |
| 审计报告日期 | 2019年3月25日 |

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 136,938,336.94 | 729,013.79 |
| 结算备付金 | | 941,054.28 | 449,044.20 |
| 存出保证金 | | 241,423.02 | 20,126.66 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 33,440,315.30 | 11,034,559.62 |
| 其中:股票投资 | | 33,440,315.30 | 11,034,559.62 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 31,906.79 | 779.92 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 61,359.47 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 171,654,395.80 | 12,233,524.19 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 22,169,951.59 | - |
| 应付赎回款 | | 1,538,592.94 | 1,892.98 |
| 应付管理人报酬 | | 200,879.99 | 26,750.55 |
| 应付托管费 | | 33,479.99 | 4,458.45 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 211,388.32 | 71,533.56 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 93,581.43 | 80,000.00 |
| 负债合计 | | 24,247,874.26 | 184,635.54 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 150,525,786.31 | 11,638,057.59 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -3,119,264.77 | 410,831.06 |
| 所有者权益合计 | | 147,406,521.54 | 12,048,888.65 |
| 负债和所有者权益总计 | | 171,654,395.80 | 12,233,524.19 |

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.979元,基金份额总额150525786.31份。

7.2 利润表

会计主体:金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -27,128,823.00 | 1,617,834.45 |
| 1.利息收入 | | 492,812.27 | 97,777.18 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 186,415.28 | 33,024.19 |
| 债券利息收入 | | 242,016.76 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 64,380.23 | 64,752.99 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -30,926,889.29 | 1,256,446.78 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | -31,337,226.79 | 1,026,919.09 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -34,432.70 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | 126,640.78 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 318,129.42 | 229,527.69 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 7.4.7.17 | -434,411.35 | 234,014.23 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 7.4.7.18 | 3,739,665.37 | 29,596.26 |
| 减:二、费用 | | 3,804,973.73 | 793,213.98 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,756,495.47 | 318,560.59 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 292,749.23 | 53,093.41 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 1,586,705.26 | 340,929.98 |
| 5. 利息支出 | | 73,303.93 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 73,303.93 | - |
| 6. 税金及附加 | | 455.89 | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 95,263.95 | 80,630.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -30,933,796.73 | 824,620.47 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -30,933,796.73 | 824,620.47 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 11,638,057.59 | 410,831.06 | 12,048,888.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -30,933,796.73 | -30,933,796.73 |
| 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) | 138,887,728.72 | 27,403,700.90 | 166,291,429.62 |
| 其中:1.基金申购款 | 675,842,253.54 | 67,429,761.41 | 743,272,014.95 |
| 2.基金赎回款 | -536,954,524.82 | -40,026,060.51 | -576,980,585.33 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 150,525,786.31 | -3,119,264.77 | 147,406,521.54 |

| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 20,065,244.28 | -35,668.08 | 20,029,576.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 824,620.47 | 824,620.47 |
| 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) | -8,427,186.69 | -378,121.33 | -8,805,308.02 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,118,000.07 | 301,096.68 | 4,419,096.75 |
| 2.基金赎回款 | -12,545,186.76 | -679,218.01 | -13,224,404.77 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 11,638,057.59 | 410,831.06 | 12,048,888.65 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署:

_____股克胜_____ _____股克胜_____ _____陈瑾_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]1135号《关于准予金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由金信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,066,237.50元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]02230518号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,066,244.28份基金份额,其中认购资金利息折合6.78份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票),固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)),资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于本基金合同界定的深圳或长主题的证券不低于非现金基金资产的80%,权证投资占基金净资产的比例不高于3%,每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律规定;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:深证成份指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×35%。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金信深圳成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,发起式基金的基金合同生效三年后,若基金资产净值低于人民币两亿元的,基金合同自动终止,于2018年12月31日,本基金的基金资产净值为147,406,521.54元,且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年,本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元,故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者