

## 信达澳银消费优选混合型证券投资基金

2016 第四季度报告

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：2017年1月20日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2016年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金名称       | 信达澳银消费优选混合   |
| 场内简称       | 信达消费   |
| 基金代码       | 610007   |
| 交易代码       | 610007   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 报告期末基金份额总额 | 69,138,463.64份   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于中国消费升级和消费升级的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。  |
| 投资策略       | 本基金通过自上而下和自下而上的方法，精选具有成长性的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。本基金主要投资于中国消费升级和消费升级的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准     | 中证800指数收益率×80%+中国国债收益率×20%   |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票型基金，具有较高风险、较高收益的特征。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。   |
| 基金管理人      | 信达澳银基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司   |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

|                     |                                |
|---------------------|--------------------------------|
| 主要财务指标              | 报告期末（2016年10月1日 - 2016年12月31日） |
| 1.本期已实现收益           | 9,397,700.07                   |
| 2.本期公允价值变动收益        | 1,026,366.22                   |
| 3.本期投资收益（含公允价值变动收益） | 6,031.39                       |
| 4.本期基金净值增长率         | 30.634,731.48                  |
| 5.本期基金份额净值增长率       | 3.11%                          |

注：1.上述基金业绩指标不包括基金申购赎回的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费），计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。  
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。  
3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③    | ②-④   |
|-------|-------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.69% | 0.79%    | 1.02%     | 0.56%        | -0.33% | 0.23% |

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目           | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资         | 80,250,138.04 | 87.79        |
| 2  | 其中：股票        | 80,250,138.04 | 87.79        |
| 3  | 固定收益投资       | -             | -            |
| 4  | 其中：债券        | -             | -            |
| 5  | 货币支持证券       | -             | -            |
| 6  | 贵金属投资        | -             | -            |
| 7  | 其中：贵金属投资     | -             | -            |
| 8  | 银行存款和结算备付金合计 | 9,619,576.41  | 10.62        |
| 9  | 其他资产         | 1,636,162.46  | 1.88         |
| 9  | 合计           | 91,485,876.91 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业名称            | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------------|---------------|--------------|
| A  | 农林、牧、渔          | 3,639,140.00  | 4.02         |
| B  | 采矿业             | 5,731,615.00  | 6.32         |
| C  | 制造业             | 57,004,404.24 | 63.89        |
| D  | 电力、热力、燃气生产和供应业  | -             | -            |
| E  | 建筑业             | 7,439,700.00  | 8.21         |
| F  | 批发和零售业          | 3,221,138.10  | 3.56         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业     | 1,124,240.00  | 1.24         |
| H  | 住宿和餐饮业          | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,817.20      | 0.01         |
| J  | 金融业             | 52,300.00     | 0.06         |
| K  | 房地产业            | 1,131,703.10  | 1.26         |
| L  | 租赁和商务服务业        | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业      | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业   | -             | -            |
| O  | 教育、文体、娱乐和休闲业    | -             | -            |
| P  | 卫生和社会工作         | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业       | -             | -            |
| S  | 综合              | -             | -            |

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资组合。  
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300462 | 万孚生物 | 113,032 | 8,391,498.68 | 9.26         |
| 2  | 000790 | 攀钢钒钛 | 364,400 | 4,799,140.00 | 5.30         |
| 3  | 603158 | 腾龙股份 | 169,000 | 4,771,200.00 | 5.28         |
| 4  | 000519 | 贝特瑞  | 189,956 | 4,232,500.00 | 4.67         |
| 5  | 002288 | 锦洲股份 | 197,400 | 3,314,390.00 | 3.68         |
| 6  | 000118 | 华联控股 | 302,540 | 3,236,700.00 | 3.57         |
| 7  | 000616 | 国际医学 | 497,750 | 3,221,138.10 | 3.56         |
| 8  | 000476 | 立讯精密 | 137,500 | 2,853,125.00 | 3.15         |
| 9  | 000261 | 中广核  | 122,300 | 2,803,110.00 | 3.09         |
| 10 | 600362 | 江西铜业 | 162,300 | 2,716,275.00 | 3.00         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。  
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。  
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。  
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。  
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。  
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
注：本基金本报告期末未持有股指期货。  
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金未参与股指期货投资。  
5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未参与国债期货投资。  
5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注：本基金未参与期权投资。  
5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

注：本基金未参与资产支持证券投资。  
5.13 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存保证金    | 121,680.72   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,381,043.48 |
| 3  | 应收利息    | -            |
| 4  | 应收股利    | -            |
| 5  | 其他应收款   | 50,300.00    |
| 6  | 其他流动资产  | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | 1,538,162.46 |
| 9  | 合计      | 1,538,162.46 |

#### 5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。  
5.16 投资组合报告附注其他文字说明部分

由于持仓五只A股原因，分项之和与合计项可能存在误差。  
5.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金的情况  
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：基金管理人运用固有资金投资本基金情况。  
7.3 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.4 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.5 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.6 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.7 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.8 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
7.9 基金管理人持有本基金的情况

注：基金管理人持有本基金的情况。  
8 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录  
9.1 备查文件目录

9.2 备查文件目录  
9.3 备查文件目录

9.4 备查文件目录  
9.5 备查文件目录

9.6 备查文件目录  
9.7 备查文件目录

9.8 备查文件目录  
9.9 备查文件目录

9.10 备查文件目录  
9.11 备查文件目录

9.12 备查文件目录  
9.13 备查文件目录

9.14 备查文件目录  
9.15 备查文件目录

9.16 备查文件目录  
9.17 备查文件目录

9.18 备查文件目录  
9.19 备查文件目录

9.20 备查文件目录  
9.21 备查文件目录

9.22 备查文件目录  
9.23 备查文件目录

9.24 备查文件目录  
9.25 备查文件目录

9.26 备查文件目录  
9.27 备查文件目录

9.28 备查文件目录  
9.29 备查文件目录

9.30 备查文件目录  
9.31 备查文件目录

9.32 备查文件目录  
9.33 备查文件目录

9.34 备查文件目录  
9.35 备查文件目录

### 信达澳银新目标灵活配置混合基金

2016 第四季度报告

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  
报告送出日期：2017年1月20日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2016年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金名称       | 信达澳银新目标混合  |
| 场内简称       | 信达新目标  |
| 基金代码       | 000466   |
| 交易代码       | 000466   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 报告期末基金份额总额 | 2016年10月1日   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于中国消费升级和消费升级的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。  |
| 投资策略       | 本基金通过自上而下和自下而上的方法，精选具有成长性的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。本基金主要投资于中国消费升级和消费升级的行业股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准     | 中证800指数收益率×80%+中国国债收益率×20%   |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票型基金，具有较高风险、较高收益的特征。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。   |
| 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   |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

|                     |                                |
|---------------------|--------------------------------|
| 主要财务指标              | 报告期末（2016年10月1日 - 2016年12月31日） |
| 1.本期已实现收益           | -70,972.29                     |
| 2.本期公允价值变动收益        | -3,368,217.87                  |
| 3.本期投资收益（含公允价值变动收益） | -3,368,217.87                  |
| 4.本期基金净值增长率         | 136,039,985.01                 |
| 5.本期基金份额净值增长率       | 0.00%                          |

注：1.上述基金业绩指标不包括基金申购赎回的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费），计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。  
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。  
3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率  | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------|----------|-----------|--------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -2.00% | 0.20%    | -0.25%    | 0.30%        | -1.75% | -0.10% |

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。

注：1.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。2.本基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较，是指本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差值。