

# 信诚新鑫回报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：信诚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 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 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 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 .....	2
§ 2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
3.3 其他指标 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§ 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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
§ 5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
§ 6 审计报告 .....	14

6.1	审计报告基本信息.....	14
6.2	审计报告的基本内容.....	15
§ 7	年度财务报表 .....	16
7.1	资产负债表 .....	16
7.2	利润表 .....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注 .....	19
§ 8	投资组合报告 .....	38
8.1	期末基金资产组合情况.....	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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 .....	39
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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 .....	42
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 .....	42
8.8	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 .....	42
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 .....	43
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
8.12	投资组合报告附注.....	43
§ 9	基金份额持有人信息 .....	44
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	44
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
§ 10	开放式基金份额变动.....	45
§ 11	重大事件揭示 .....	45
11.1	基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
11.4	基金投资策略的改变.....	46
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
11.8	其他重大事件.....	46
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 13	备查文件目录 .....	52
13.1	备查文件名称.....	52
13.2	备查文件存放地点.....	52
13.3	备查文件查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	信诚新鑫混合	
场内简称	-	
基金主代码	001494	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
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	1,606,746,049.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001494	002047
报告期末下属分级基金的份额总额	6,746,049.23 份	1,600,000,000.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	<p>本基金主要通过通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%

风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,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		信诚基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	张燕
	联系电话	021-68649788	0755-83199084
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95555
传真		021-50120888	0755-83195201
注册地址		上海市浦东世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		张翔燕	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	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 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 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	信诚基金管理有限公司	上海市浦东世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 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		2015 年 06 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B
本期已实现收益	381,856.96	52,802,718.47	5,030,803.41	1,796,850.13
本期利润	251,968.32	31,195,271.45	5,004,005.60	5,134,512.26

加权平均基金份额本期利润	0.0334	0.0195	0.0219	0.0022
本期加权平均净值利润率	2.33%	1.92%	2.15%	0.22%
本期基金份额净值增长率	2.27%	1.99%	41.00%	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配利润	2,983,288.33	36,326,647.29	3,254,137.05	2,772,163.72
期末可供分配基金份额利润	0.4422	0.0227	0.4104	0.0017
期末基金资产净值	9,729,337.56	1,636,326,647.29	11,182,749.12	1,605,716,420.10
期末基金份额净值	1.442	1.023	1.410	1.003
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
基金份额累计净值增长率	44.20%	2.30%	41.00%	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,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 2015 年 6 月 29 日。

### 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

信诚新鑫混合 A

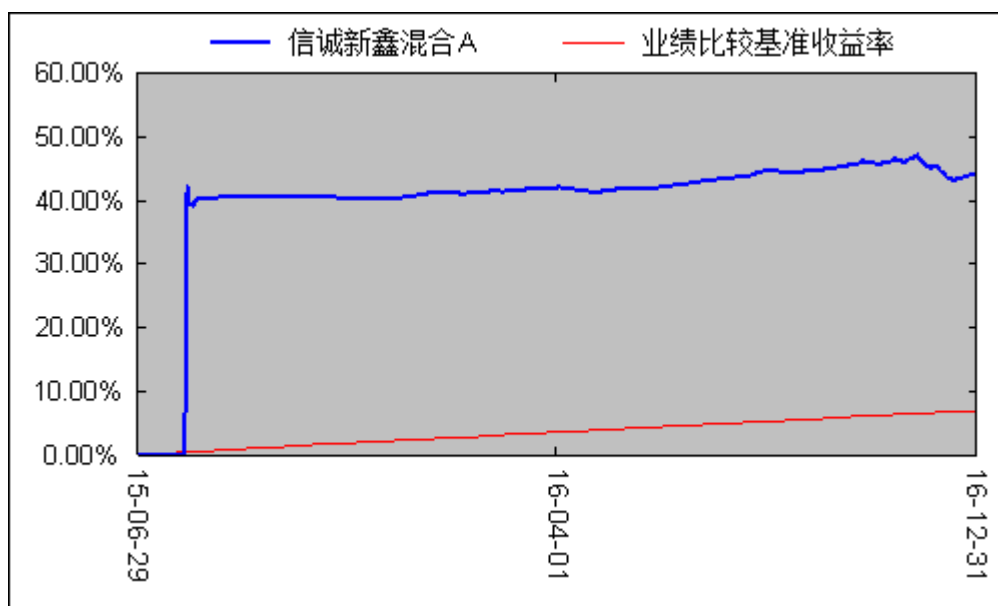
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.69%	0.17%	1.13%	0.02%	-1.82%	0.15%
过去六个月	0.98%	0.13%	2.27%	0.01%	-1.29%	0.12%
过去一年	2.27%	0.10%	4.51%	0.01%	-2.24%	0.09%
自基金合同生效起至今	44.20%	2.04%	6.93%	0.01%	37.27%	2.03%

信诚新鑫混合 B

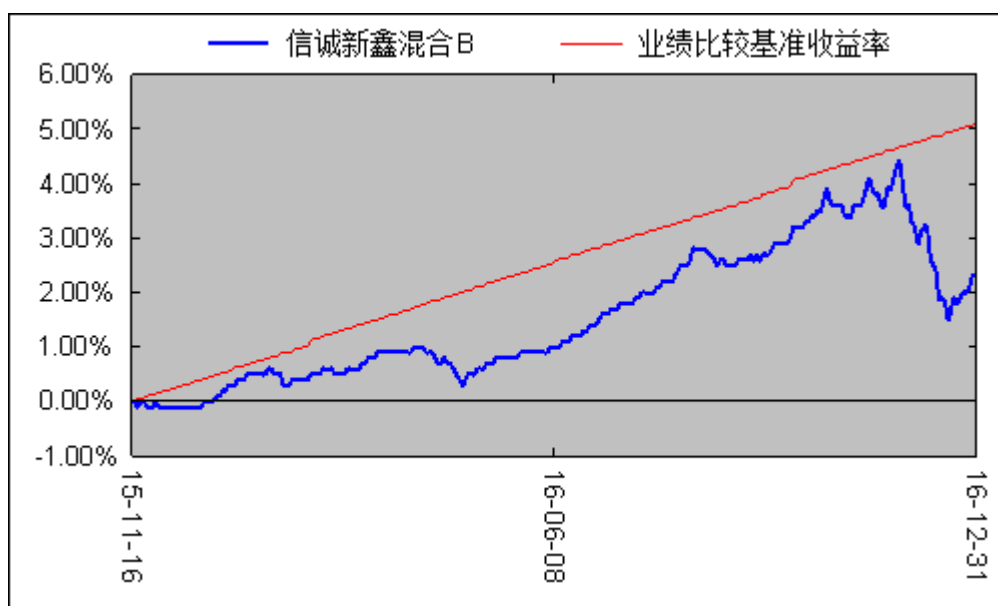
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.68%	0.18%	1.13%	0.02%	-1.81%	0.16%
过去六个月	0.89%	0.13%	2.27%	0.01%	-1.38%	0.12%
过去一年	1.99%	0.10%	4.51%	0.01%	-2.52%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.10%	5.08%	0.01%	-2.78%	0.09%

注:业绩比较基准为人民币一年期银行定期储蓄存款利率(税后)+3%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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  
信诚新鑫混合 A



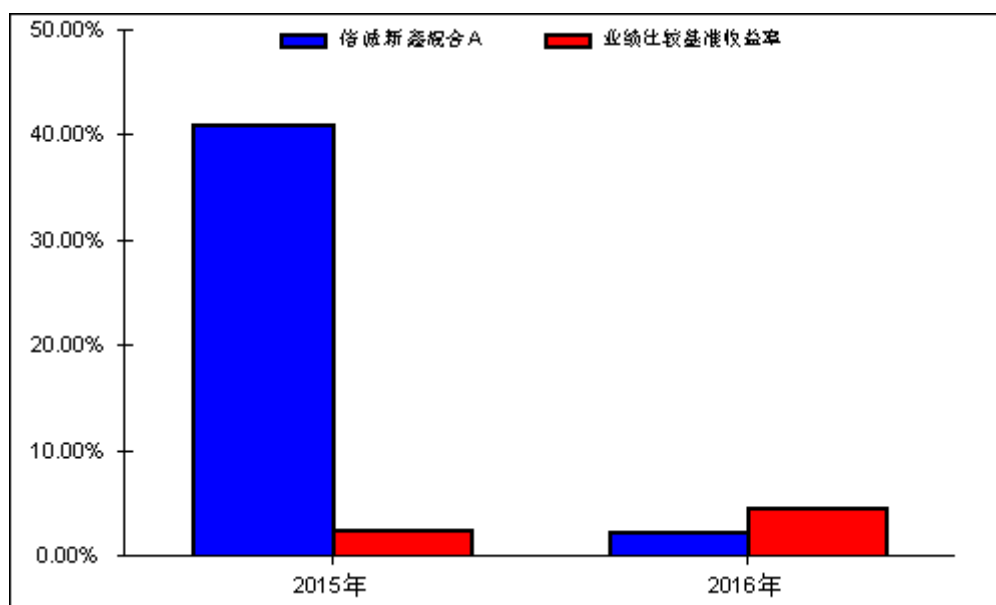
信诚新鑫混合 B



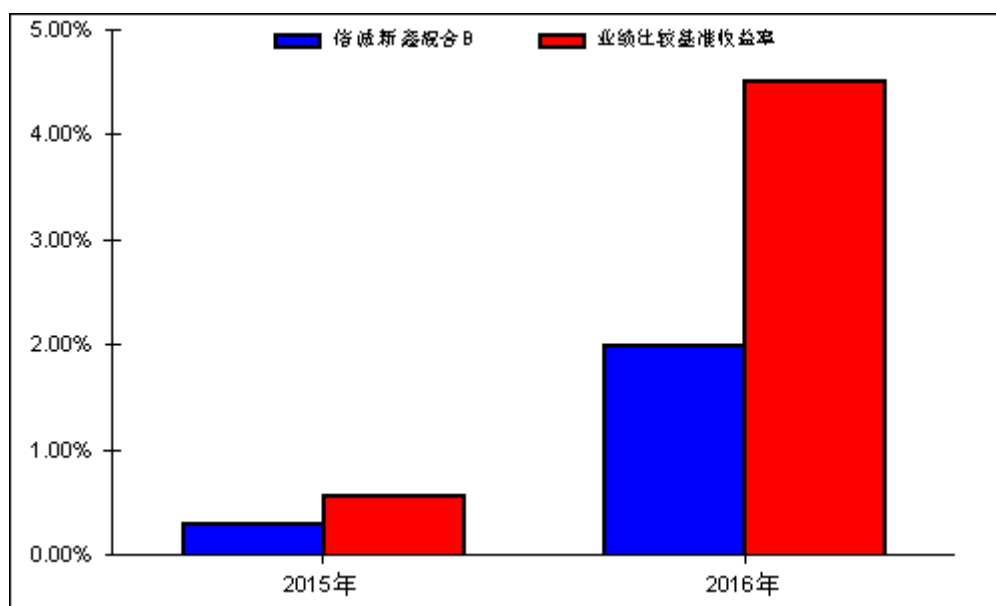
注：1. 本基金于 2015 年 11 月 16 日起新增 B 类份额。

2. 本基金建仓期自 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 月 29 日, 建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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  
信诚新鑫混合 A



信诚新鑫混合 B



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

信诚新鑫混合 A

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配	备注



	额分红数	总额	放总额	合计	
2016	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2015	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近两年未进行利润分配

## 信诚新鑫混合 B

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额 额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2016	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2015	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近两年未进行利润分配

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

## § 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

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。截至 2016 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 55 只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券性证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、信诚

新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
王旭巍	本基金基金经理、信诚添金分级债券基金和信诚增强收益债券基金 (LOF)、信诚新双盈分级债券基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚薪金宝货币市场基金的基金经理，信诚基金管理有限公司副首席投资官	2015年6月29日	2016年8月5日	22	经济学硕士，22年金融、证券、基金行业从业经验。曾先后任职于中国（深圳）物资工贸集团有限公司大连期货部、宏达期货经纪有限公司、中信证券资产管理部和华宝兴业基金管理有限公司。2010年3月至2016年9月任职于信诚基金管理有限公司，担任副首席投资官，基金经理。
杨立春	本基金基金经理，信诚双盈债券基金 (LOF)、信诚新双盈分级债券基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、	2015年6月29日	-	5	复旦大学经济学博士。2005年7月至2011年6月期间于江苏省社会科学院担任助理研究员，从事产业经济和宏观经济研究工作。2011年7月加入信诚基金管理有限公司，担任固定收益分析师。现任信诚双盈债券基金 (LOF)、信诚新

	信诚惠泽债券基金的基金经理			双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金的基金经理。
--	---------------	--	--	--

注:1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业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遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期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、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整

体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价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 5% 的交易(完全复制的指数基金除外)。

#### 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 年以来,债市经历了由牛市到熊市的快速下跌过程。2016 年三季度之前,债市持续牛市格局缓慢上涨,下半年随着各地楼市限购限贷政策频繁出台,市场预期基本面进一步下行、资产荒加剧,虽然资金利率长期处于高位,但短期内信用债和利率债无视资金面紧张格局,到期收益率创年内低点。随后市场对银行间监管和去杠杆的担忧逐渐升温,表外理财纳入 MPA 考核,央行推动市场去杠杆的压力逐步累积,并进一步通过放长收短的方式收紧流动性,带动银行间回购利率明显上行,利率债的估值收益率大幅跳升。此外,美国总统大选等地缘政治因素进一步引发了全球风险偏好以及再通胀担忧,人民币汇率持续贬值,全球避险资产尤其是债券市场急速下跌。在年末冲规模需求下,同业理财、存单利率飙升;非银机构银行间融资难度上升,流动性极度紧张,公募基金被大量赎回,引发市场踩踏,到期收益率快速上行,市场进入了大跌、赎回、负偏离、国债期货跌停的正反馈。直至监管机构出面协调、央行投放流动性、债券收益率逐步企稳,市场情绪得以修复,债市进入盘整期,资金成本下行、交投活跃度回升。

报告期内信诚新鑫回报基金对减仓了债券仓位,降低了组合杠杆及组合久期,在仓内短端品种到期后采取相对保守的操作,以流动性管理和投资短端品种为主。权益方面,基金基于绝对收益的思路对权益仓位进行主动投资操作,结合网下新股申购策略增厚投资收益,在股市债市双双下行的背景下,努力控制基金净值回撤。目前投资组合的债券投资以高等级信用债为主,未来将继续择机增仓短久期交易所公司债及短融,保持适度组合久期,结合利率债波段操作,提高组合收益率,并通过分散化投资及加大信用风险筛查力度,规避可能的信用风险冲击。

##### 4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内,本基金 A、B 份额净值增长率分别为 2.27%、1.99%,同期业绩比较基准收益率为 4.51%。基金 A、B 份额落后业绩比较基准分别为 2.24%、2.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在债市到期收益率大幅回升的背景下,2017 年债券的配置价值显著抬升,债券配置和投资需求将逐渐得到释放。但与此同时债券市场的波动也明显加大,未来波段操作将会更为困难。经济基本面、资金面和政策面等多因素交杂影响下,投资者对债市后续走势仍普遍谨慎。当前经济基本面偏弱背景下,市场对财政政策存在乐观预期,但考虑到较高的赤字率水平,未来赤字财政难有大的作为。此外,通货膨胀走势、资金流向、投资者结构、监管政策也是关注的重点,影响基准收益率并决定各种利差。总体看来,虽然债市基本面没有明显的利好因素驱动,但随着境内资本面压力的缓解,债券到期收益率水平已有较好的配置价值,债市风险已得到了有效释放。

随着未来去产能的继续推进,企业盈利状况将会有所好转,信用债基本面总体向好,预期内违约仍将发生,但是对市场冲击不大;短期内依然关注流动性的波动和银行负债端监管的变化对信用债带来的影响。目前看来,债市的好转有待于经济基本面的超预期下行、货币政策的边际放松、CPI 低于预期等多因素的综合影响。就目前而言,市场配置价值有所回升,但趋势仍未形成,我们将根据产品属性和仓位选择操作,积极配置流动性较好的高等级品种,控制组合久期,同时视市场情况逢高减持长久期利率及信用债,待市场充分调整并形成趋势后,再关注进一步介入的机会。信用品选择方面,积极规避存在业绩风险和产能过剩行业的品种,通过精细化信用分析,谨慎甄选投资标的,严控信用风险并平滑组合净值波动。权益方面,对权益资产投资保持谨慎,积极参与转债网下申购的套利机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度内,依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1、对公司规章制度体系不断补充和完善。

公司监察稽核部组织各业务部门对公司相关规章制度进行梳理补充和完善,主要包括投资、财务、风控、产品、人力资源、监察稽核等业务范畴。推进了公司规章制度建设,完善了公司规章制度体系。

2、开展各类合规监察工作。

监察稽核部严格遵照法律法规和公司制度,对基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况进行监督检查,防范内幕交易,防范不正当关联交易和利益输送,确保基金运作的独立性、公平性及合规性,维护基金份额持有人的合法权益。

3、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时将新颁布的监管法规传递给公司相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4、开展各类内外部审计工作,包括 4 次常规审计、12 项专项检查、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成多项自查工作等。

5、完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法规要求进行信息披露和公告,并按法律法规规定报监管机构备案。

6、牵头开展反洗钱的各项工作,进一步更新完善了反洗钱制度,按照相关规定将可疑交易报告及时上报中国反洗钱监测中心,根据中国人民银行通知要求组织开展反洗钱培训和宣传工作。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人将基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

##### 2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

##### 3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

##### 4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

#### 5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

- 1、《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,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本报告期末进行过利润分配,该处理符合本基金利润分配原则。

#### 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

本报告期内,本基金未出现过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)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(2017)第 20092 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	信诚新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
引言段	我们审计了后附的信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚新鑫回报基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016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。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是信诚新鑫回报基金的基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为,上述信诚新鑫回报基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了信诚新鑫回报基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	薛竞	赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信诚新鑫回报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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	22,113,690.67	1,496,525,895.28
结算备付金		6,146,705.01	2,091,419.22
存出保证金		100,091.15	126,141.09
交易性金融资产	7.4.7.2	1,305,644,750.98	116,705,860.56
其中：股票投资		124,570,367.76	10,968,983.96
基金投资		-	-
债券投资		1,181,074,383.22	105,736,876.60
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	415,421,183.13	-
应收证券清算款		14,534,331.83	2,640,876.88
应收利息	7.4.7.5	22,360,353.60	1,682,850.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	9,911.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,786,321,106.37	1,619,782,954.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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		138,600,000.00	-
应付证券清算款		-	-



应付赎回款		1,019.75	11,336.19
应付管理人报酬		838,323.41	1,741,676.67
应付托管费		279,441.12	387,039.27
应付销售服务费		138,881.97	192,539.72
应付交易费用	7.4.7.7	120,263.10	358,178.97
应交税费		-	-
应付利息		127,192.17	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,000.00	193,014.77
负债合计		140,265,121.52	2,883,785.59
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,606,746,049.23	1,608,511,094.66
未分配利润	7.4.7.10	39,309,935.62	8,388,074.56
所有者权益合计		1,646,055,984.85	1,616,899,169.22
负债和所有者权益总计		1,786,321,106.37	1,619,782,954.81

注：截止本报告期末，基金份额总额 1606746049.23 份。下属分级基金：信诚新鑫混合 A 份额的份额总额为 6746049.23 份，份额净值 1.442 元；信诚新鑫混合 B 份额的份额总额为 1600000000 份，份额净值 1.023 元。

## 7.2 利润表

会计主体：信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		55,163,476.27	15,514,847.08
1. 利息收入		52,552,819.37	5,110,553.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,721,144.68	4,572,430.60
债券利息收入		48,213,036.80	275,072.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,618,637.89	263,050.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,324,841.44	2,298,678.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,078,490.15	2,162,511.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,136,466.79	136,166.53

资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,109,884.50	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-21,737,335.66	3,310,864.32
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	23,151.12	4,794,751.04
<b>减：二、费用</b>		23,716,236.50	5,376,329.22
1. 管理人报酬		13,918,520.79	3,494,437.68
2. 托管费		3,277,472.18	776,541.73
3. 销售服务费		1,627,901.39	281,523.37
4. 交易费用	7.4.7.19	754,136.07	586,472.32
5. 利息支出		3,905,084.79	37,644.91
其中：卖出回购金融资产 支出		3,905,084.79	37,644.91
6. 其他费用	7.4.7.20	233,121.28	199,709.21
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		31,447,239.77	10,138,517.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		31,447,239.77	10,138,517.86

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1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）	1,608,511,094.66	8,388,074.56	1,616,899,169.22
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数（本 期利润）	-	31,447,239.77	31,447,239.77
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）	-1,765,045.43	-525,378.71	-2,290,424.14

其中：1. 基金申购款	4,196,564.59	1,788,781.27	5,985,345.86
2. 基金赎回款	-5,961,610.02	-2,314,159.98	-8,275,770.00
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）	1,606,746,049.23	39,309,935.62	1,646,055,984.85
项目	上年度可比期间		
	2015年6月29日(基金合同生效日)至2015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）	1,201,572,430.13	-	1,201,572,430.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,138,517.86	10,138,517.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	406,938,664.53	-1,750,443.30	405,188,221.23
其中：1. 基金申购款	2,539,420,019.16	11,149,191.16	2,550,569,210.32
2. 基金赎回款	-2,132,481,354.63	-12,899,634.46	-2,145,380,989.09
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）	1,608,511,094.66	8,388,074.56	1,616,899,169.22

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：

吕涛 \_\_\_\_\_ 陈逸辛 \_\_\_\_\_ 时慧 \_\_\_\_\_  
 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

信诚新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”)《关于准予信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1136号文)和《关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》(机构部函[2015]1996号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年6月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于2015年6月23日至2015年6月26日募集,首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币1,201,410,355.65元,利息人民币162,074.48元,共计人民币1,201,572,430.13元。上述认购资金折合1,201,572,430.13份基金份额。上述募集资金已由普华

永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2015)第 843 号验资报告。

根据《关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金增加B类份额并修改基金合同的公告》,自 2015 年 11 月 6 日起,本基金根据认购费、申购费与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、证券公司短期债及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 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,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%。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较标准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 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》、《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

#### 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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 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、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、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

本基金持有的金融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,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。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用

估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

金融工具公允价值计量的方法:

(1) 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: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层次: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(2) 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, 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, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(3) 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。

#### 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认列。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认列, 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。

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 B 类份额的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

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、《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,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;3、同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本报告期内未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

#### 7.4.4.12 分部报告

#### 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,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[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》提供的根据具体情况采用《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) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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),按照中央国债登记结算有限责任公司根据《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》所独立提供的债券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

本基金在报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错。

#### 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[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,包括买卖债券的差价收入,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。

#### 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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	22, 113, 690. 67	1, 046, 525, 895. 28
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	450, 000, 000. 00
合计	22, 113, 690. 67	1, 496, 525, 895. 28

注: 其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

##### 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		124, 657, 885. 65	124, 570, 367. 76	-87, 517. 89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	659, 678, 755. 42	646, 589, 383. 22	-13, 089, 372. 20
	银行间市场	539, 734, 581. 25	534, 485, 000. 00	-5, 249, 581. 25
	合计	1, 199, 413, 336. 67	1, 181, 074, 383. 22	-18, 338, 953. 45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1, 324, 071, 222. 32	1, 305, 644, 750. 98	-18, 426, 471. 34
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7, 817, 778. 39	10, 968, 983. 96	3, 151, 205. 57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	105, 577, 217. 85	105, 736, 876. 60	159, 658. 75
	银行间市场	-	-	-
	合计	105, 577, 217. 85	105, 736, 876. 60	159, 658. 75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-



其他	-	-	-
合计	113,394,996.24	116,705,860.56	3,310,864.32

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期上年可比期间均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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
R014	190,140,485.21	-
R0006	150,000,345.00	-
R028	56,280,204.42	-
R0007	19,000,148.50	-
合计	本期买入返售金融资产合计本期末账面余额	本期买入返售金融资产合计其中买断式逆回购

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期及上年可比期间均未持有买断式逆回购债券。

#### 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	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	3,690.89	224,584.76
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	218,750.00
应收结算备付金利息	3,042.71	1,035.21
应收债券利息	21,673,077.96	1,238,417.38
应收买入返售证券利息	680,492.54	-
应收申购款利息	-	0.80
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	49.50	62.48
合计	22,360,353.60	1,682,850.63

注：其他指应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	107,000.95	358,178.97
银行间市场应付交易费用	13,262.15	-
合计	120,263.10	358,178.97

#### 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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	14.77
预提审计费	100,000.00	133,000.00
预提信息披露费	60,000.00	60,000.00
合计	160,000.00	193,014.77

#### 7.4.7.9 实收基金

信诚新鑫混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,928,612.07	7,928,612.07
本期申购	4,196,564.59	4,196,564.59
本期赎回（以“-”号填列）	-5,379,127.43	-5,379,127.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,746,049.23	6,746,049.23

信诚新鑫混合 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,600,582,482.59	1,600,582,482.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-582,482.59	-582,482.59
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00
-----	------------------	------------------

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

信诚新鑫混合 A

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
上年度末	3,269,396.07	-15,259.02	3,254,137.05
本期利润	381,856.96	-129,888.64	251,968.32
本期基金份额交易产生的变动数	-526,529.64	3,712.60	-522,817.04
其中：基金申购款	1,803,104.38	-14,323.11	1,788,781.27
基金赎回款	-2,329,634.02	18,035.71	-2,311,598.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,124,723.39	-141,435.06	2,983,288.33

信诚新鑫混合 B

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
上年度末	2,772,163.72	2,361,773.79	5,133,937.51
本期利润	52,802,718.47	-21,607,447.02	31,195,271.45
本期基金份额交易产生的变动数	-3,076.93	515.26	-2,561.67
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,076.93	515.26	-2,561.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,571,805.26	-19,245,157.97	36,326,647.29

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	745,268.97	1,398,020.64
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,898,472.22	3,154,999.99
结算备付金利息收入	75,408.51	19,125.93
其他	1,994.98	284.04
合计	2,721,144.68	4,572,430.60

注：其他指申购款利息收入，结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	211,485,933.98	193,330,962.41
减：卖出股票成本总额	191,407,443.83	191,168,450.86
买卖股票差价收入	20,078,490.15	2,162,511.55

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效 日)至 2015 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	3,136,466.79	136,166.53
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	3,136,466.79	136,166.53

##### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	1,905,479,473.22	15,892,977.55
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	1,872,637,964.77	15,498,387.68
减：应收利息总额	29,705,041.66	258,423.34
买卖债券差价收入	3,136,466.79	136,166.53

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期和上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期和上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,109,884.50	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,109,884.50	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-21,737,335.66	3,310,864.32
——股票投资	-3,238,723.46	3,151,205.57
——债券投资	-18,498,612.20	159,658.75
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-21,737,335.66	3,310,864.32

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
----	---------------------------------	--

基金赎回费收入	22,934.65	4,786,352.17
转换费收入	216.47	8,212.93
其他	-	185.94
合计	23,151.12	4,794,751.04

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	736,286.07	586,472.32
银行间市场交易费用	17,850.00	-
合计	754,136.07	586,472.32

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	133,000.00
信息披露费	60,000.00	60,000.00
银行费用	37,621.28	6,309.21
债券账户维护费	25,500.00	-
其他	10,000.00	400.00
合计	233,121.28	199,709.21

#### 7.4.7.21 分部报告

#### 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

截至本报告期末,本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日,本基金并无须做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
信诚基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

##### 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

本基金在本年度没有通过关联方的交易单元进行过交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

###### 7.4.10.1.3 债券交易

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

##### 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1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,918,520.79	3,494,437.68
其中:支付销售机构的客户维护费	18,820.79	23,566.20

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.90%/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1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,277,472.18	776,541.73

注:支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

###### 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 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B	合计
信诚基金管理有限公司	-	1,627,886.91	1,627,886.91
合计	-	1,627,886.91	1,627,886.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B	合计
信诚基金管理有限 公司	-	281,523.37	281,523.37
合计	-	281,523.37	281,523.37

注：支付基金销售机构的 B 类基金份额销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信诚基金管理有限公司，再由信诚基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费=前一日 B 类基金资产净值×0.10%/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

本基金在本年度未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金的基金管理人在本年度未投资过本基金 B 份额。

信诚新鑫混合 A

份额单位：份

##### 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

信诚新鑫混合 A

份额单位：份

1、本基金除基金管理人之外的其它关联方在本年末未持有本基金。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

#### 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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 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	22,113,690.67	745,268.97	1,046,525,895.28	1,398,020.64

注：本基金通过“中国招商银行基金托管结算资金转用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于本报告期末的相关余额为人民币 6,146,705.01 元。(本基金上年度期末余额为人民币 2,091,419.22 元)

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度，在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.11 利润分配情况



本基金本期未进行过利润分配。

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

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
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	网下新股申购未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下新股申购未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	网下新股申购未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	网下新股申购未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-

603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下新股申购未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	网下新股申购未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下新股申购未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-

#### 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场正回购交易而作为抵押的债券。

##### 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,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 138,600,000.00 元,于 2017 年 1 月 3 日、12 日(先后)到期。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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风控与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责，其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国招商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

#### 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与可能遭受的损失。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注 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，均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.4 市场风险

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,113,690.67	-	-	-	-	-	22,113,690.67
结算备付金	6,146,705.01	-	-	-	-	-	6,146,705.01
存出保证金	100,091.15	-	-	-	-	-	100,091.15
交易性金融资产	119,099,962.40	75,126,500.00	244,924,140.02	648,365,275.80	93,558,505.00	124,570,367.76	1,305,644,750.98
买入返售金融资产	415,421,183.13	-	-	-	-	-	415,421,183.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,534,331.83	14,534,331.83
应收利息	-	-	-	-	-	22,360,353.60	22,360,353.60
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	562,881,632.36	75,126,500.00	244,924,140.02	648,365,275.80	93,558,505.00	161,465,053.19	1,786,321,106.37
负债							
卖出回购金融资产款	138,600,000.00	-	-	-	-	-	138,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,019.75	1,019.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	838,323.41	838,323.41
应付托管费	-	-	-	-	-	279,441.12	279,441.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	138,881.97	138,881.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	120,263.10	120,263.10
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	127,192.17	127,192.17
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	138,600,000.00	-	-	-	-	1,665,121.52	140,265,121.52
利率敏感度缺口	424,281,632.36	75,126,500.00	244,924,140.02	648,365,275.80	93,558,505.00	159,799,931.67	1,646,055,984.85
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,496,525,895.28	-	-	-	-	-	1,496,525,895.28
结算备付金	2,091,419.22	-	-	-	-	-	2,091,419.22
存出保证金	126,141.09	-	-	-	-	-	126,141.09
交易性金融资产	99,300,150.00	-	245,472.00	5,511,429.60	679,825.00	10,968,983.96	116,705,860.56
买入返售金融资	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,640,876.88	2,640,876.88
应收利息	-	-	-	-	-	1,682,850.63	1,682,850.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	9,911.15	9,911.15
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,598,043,605.59	-	245,472.00	5,511,429.60	679,825.00	15,302,622.62	1,619,782,954.81
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,336.19	11,336.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,741,676.67	1,741,676.67
应付托管费	-	-	-	-	-	387,039.27	387,039.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-	192,539.72	192,539.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	358,178.97	358,178.97
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	193,014.77	193,014.77
负债总计	-	-	-	-	-	2,883,785.59	2,883,785.59
利率敏感度缺口	1,598,043,605.59	-	245,472.00	5,511,429.60	679,825.00	12,418,837.03	1,616,899,169.22

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降25个基点	6,979,383.16	42,334.93
市场利率上升25个基点	-6,873,566.03	-42,008.76	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 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		上年度末 2015 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	124,570,367.76	7.57	10,968,983.96	0.68
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	124,570,367.76	7.57	10,968,983.96	0.68

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末,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小于 20%,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。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

## §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	124,570,367.76	6.97
	其中：股票	124,570,367.76	6.97
2	固定收益投资	1,181,074,383.22	66.12
	其中：债券	1,181,074,383.22	66.12
	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	415,421,183.13	23.26
	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	28,260,395.68	1.58
7	其他各项资产	36,994,776.58	2.07
8	合计	1,786,321,106.37	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	60,689,697.05	3.69
C	制造业	35,585,945.60	2.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	-
E	建筑业	15,592.23	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	234,875.00	0.01
J	金融业	24,264,980.00	1.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,731,901.54	0.23
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,570,367.76	7.57

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

## 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	601699	潞安环能	4,297,817	34,597,426.85	2.10
2	002142	宁波银行	1,017,500	16,931,200.00	1.03
3	000651	格力电器	499,923	12,308,104.26	0.75
4	000937	冀中能源	1,393,430	9,391,718.20	0.57
5	603808	歌力思	264,800	8,497,432.00	0.52
6	000983	西山煤电	1,000,900	8,467,614.00	0.51
7	600028	中国石化	1,521,800	8,232,938.00	0.50
8	601628	中国人寿	300,000	7,227,000.00	0.44
9	300203	聚光科技	233,200	7,124,260.00	0.43
10	600216	浙江医药	427,980	5,426,786.40	0.33
11	300071	华谊嘉信	378,489	3,731,901.54	0.23
12	000650	仁和药业	200,000	1,410,000.00	0.09
13	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
14	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
15	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
16	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
17	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	-
18	603577	汇金通	2,460	69,642.60	-
19	603218	日月股份	1,652	68,805.80	-
20	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	-
21	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	-
22	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	-
23	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	-
24	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	-
25	300582	英飞特	1,359	35,157.33	-
26	603239	浙江仙通	924	29,059.80	-
27	002835	同为股份	1,126	24,220.26	-
28	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	-
29	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	-
30	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	-
31	002840	华统股份	1,814	11,881.70	-
32	002838	道恩股份	681	10,405.68	-
33	603186	华正新材	1,874	10,063.38	-
34	603032	德新交运	1,628	9,458.68	-
35	300586	美联新材	1,006	9,355.80	-
36	300591	万里马	2,396	7,355.72	-

#### 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	601398	工商银行	35,338,960.00	2.19
2	600900	长江电力	35,237,802.65	2.18
3	601699	潞安环能	34,628,758.38	2.14
4	600060	海信电器	31,014,646.74	1.92
5	600104	上汽集团	30,912,855.99	1.91
6	000937	冀中能源	17,226,652.70	1.07
7	002142	宁波银行	16,556,284.30	1.02
8	000970	中科三环	15,276,057.92	0.94
9	600804	鹏博士	10,461,735.00	0.65
10	000983	西山煤电	9,994,342.00	0.62
11	000651	格力电器	9,315,976.80	0.58
12	600216	浙江医药	8,731,189.00	0.54
13	603808	歌力思	8,312,300.00	0.51
14	600622	嘉宝集团	8,251,124.27	0.51
15	600028	中国石化	8,245,124.83	0.51
16	300203	聚光科技	7,776,011.68	0.48
17	300071	华谊嘉信	7,454,575.54	0.46
18	601628	中国人寿	7,365,000.00	0.46
19	600919	江苏银行	417,525.57	0.03
20	601997	贵阳银行	297,599.97	0.02

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	35,597,312.00	2.20
2	600900	长江电力	35,458,687.33	2.19
3	600104	上汽集团	29,354,982.38	1.82
4	600060	海信电器	29,048,086.60	1.80
5	000970	中科三环	15,543,229.04	0.96
6	600804	鹏博士	11,162,220.84	0.69
7	000937	冀中能源	8,568,650.00	0.53
8	600622	嘉宝集团	8,506,596.08	0.53
9	300071	华谊嘉信	2,986,843.71	0.18
10	600216	浙江医药	2,419,259.00	0.15
11	600418	江淮汽车	1,813,856.04	0.11
12	603508	思维列控	1,647,077.00	0.10
13	300496	中科创达	1,443,204.30	0.09
14	002781	奇信股份	1,299,888.00	0.08
15	600977	中国电影	1,077,698.51	0.07
16	600919	江苏银行	841,157.91	0.05
17	601611	中国核建	822,886.20	0.05

18	603996	中新科技	803,001.00	0.05
19	601997	贵阳银行	672,700.24	0.04
20	601966	玲珑轮胎	654,140.24	0.04

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	302,099,397.80
卖出股票收入（成交）总额	211,485,933.98

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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	148,528,800.00	9.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	157,958,000.00	9.60
	其中：政策性金融债	157,958,000.00	9.60
4	企业债券	586,880,078.22	35.65
5	企业短期融资券	189,650,000.00	11.52
6	中期票据	-	-
7	可转债	197,505.00	0.01
8	同业存单	97,860,000.00	5.95
9	其他	-	-
10	合计	1,181,074,383.22	71.75

#### 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	111609137	16 浦发 CD137	1,000,000	97,860,000.00	5.95
2	019539	16 国债 11	740,000	73,903,800.00	4.49
3	136518	16 鲁高 01	600,000	58,038,000.00	3.53
4	150213	15 国开 13	500,000	50,275,000.00	3.05
5	136061	15 东证债	500,000	49,995,000.00	3.04

#### 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 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进行贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 中国人寿保险股份有限公司(以下简称“中国人寿”)于2016年6月24日发布了关于收到中国保险监督管理委员会《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》(保监罚〔2016〕13号)的公告。中国人寿因采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务,违反了《中华人民共和国保险法》相关规定。

对中国人寿的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,上述处罚事项未对中国人寿的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚新鑫基金对中国人寿的投资仓位不足1%,我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余本基金前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**8.12.2** 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	100,091.15
2	应收证券清算款	14,534,331.83
3	应收股利	-
4	应收利息	22,360,353.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	36,994,776.58
---	----	---------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### §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

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
信诚新鑫混合 A	483	13,966.98	4,278,887.30	63.43%	2,467,161.93	36.57%
信诚新鑫混合 B	1	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00	100.00%	-	-
合计	484	3,319,723.24	1,604,278,887.30	99.85%	2,467,161.93	0.15%

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

#### 9.3 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	信诚新鑫混合 A	30,634.98	0.45%
	信诚新鑫混合 B	-	-
	合计	30,634.98	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚新鑫混合 A	信诚新鑫混合 B
基金合同生效日(2015年6月29日)基金份额总额	1,201,572,430.13	-
本报告期期初基金份额总额	7,928,612.07	1,600,582,482.59
本报告期基金总申购份额	4,196,564.59	-
减：本报告期基金总赎回份额	5,379,127.43	582,482.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	6,746,049.23	1,600,000,000.00

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

依据《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》、《信诚新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,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为自2016年10月11日起至2016年10月31日17:00止。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于2016年11月1日表决通过了《关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。基金管理人于表决通过之日起5日内报中国证监会备案。

本基金管理人根据基金份额持有人大会决议执行基金管理费率的调整事项,将本基金的基金管理费率由0.90%调整为0.60%,正式实施日为2016年11月1日,并在网站上公布了经修改后的上述基金的基金合同。有关本基金召开基金份额持有人大会调整基金管理费率的相关事项详情可参阅本基金于2016年11月2日发布的《信诚基金管理有限公司关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## 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

## 1、报告期内基金管理人的重大人事变动:

经信诚基金管理有限公司董事会审议通过,隋晓炜先生专职担任中信信诚资产管理有限公司总经理,不再兼任信诚基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已于2017年1月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会、中国证券监督管理委员会上海证监局报备。

2、报告期内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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所的报酬为人民币 100,000 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无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	
安信证券	2	513,585,331.78	100.00%	475,794.82	100.00%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估,并综合考虑候选券商的综合实力,由研究总监和投资总监审核批准。

#### 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		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
安信证券	434,419,893.88	100.00%	10,495,881,000.00	100.00%	-	-	
中投证券	-	-	-	-	-	-	

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估,并综合考虑候选券商的综合实力,由研究总监和投资总监审核批准。

### 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	信诚基金管理有限公司旗下证券投	《证券日报》及公司网站	2016-01-04

	资基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	(www.xcfunds.com)	
2	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-04
3	信诚基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	同上	2016-01-06
4	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-07
5	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第四季度报告	同上	2016-01-22
6	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 B 类份额暂停申购业务的公告	同上	2016-02-02
7	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(2016年第1次更新)	同上	2016-02-05
8	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要(2016年第1次更新), 2016年2月5日;	同上	2016-02-05
9	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告, 2016 年 3 月 25 日;	同上	2016-03-19
10	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	同上	2016-03-25
11	信诚基金管理有限公司关于旗下基金参加同花顺申购费率优惠活动的	同上	2016-03-31

	公告		
12	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第一季度报告	同上	2016-04-21
13	关于信诚基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告 20160505	同上	2016-05-05
14	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016-05-31
15	信诚基金管理有限公司关于调整网上直销招商银行卡直联渠道费率优惠折扣的公告	同上	2016-06-02
16	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-06-04
17	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构的公告	同上	2016-06-16
18	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构的公告	同上	2016-06-16
19	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-06-25
20	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金斧子为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-06-25
21	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆金所资管为销售机构	同上	2016-06-25



	并参加基金申购费率优惠活动的公告		
22	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	同上	2016-07-01
23	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构的公告	同上	2016-07-06
24	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众禄金融为销售机构的公告	同上	2016-07-09
25	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-07-13
26	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第二季度报告	同上	2016-07-19
27	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万得投顾为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-07-29
28	信诚基金管理有限公司基金经理变更公告	同上	2016-08-06
29	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新浪仓石为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-08-12
30	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（2016 年第 2 次更新）	同上	2016-08-12
31	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要（2016 年	同上	2016-08-12

	第 2 次更新)		
32	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安证券为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-08-19
33	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加联泰资产基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016-08-23
34	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	同上	2016-08-24
35	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	同上	2016-08-24
36	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-09-07
37	关于旗下部分基金增加浙江金观诚财富管理有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-09-14
38	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-09-20
39	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	同上	2016-09-24
40	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天津银行为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016-09-24
41	信诚基金管理有限公司关于以通讯	同上	2016-09-30

	会议方式召开信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告		
42	信诚基金管理有限公司关于以通讯会议方式召开信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2016-10-10
43	信诚基金管理有限公司关于以通讯会议方式召开信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	同上	2016-10-11
44	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016-10-19
45	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第三季度报告	同上	2016-10-26
46	信诚基金管理有限公司关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	同上	2016-11-02
47	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2016-11-02
48	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加前海凯恩斯为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016-11-07
49	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并参加申购	同上	2016-11-17

	费率优惠活动的公告		
50	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-12-16
51	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加一路财富(北京)信息科技有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2016-12-26
52	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	同上	2016-12-31

## § 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 备查文件名称

- 1、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
- 3、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 13.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

### 13.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。亦可通过公司网站查阅，公司网址为 [www.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司

2017 年 3 月 31 日