

信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	6
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	30
7.3 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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
7.6 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	33
7.7 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	34
7.8 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	34
7.9 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	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	34
7.12 投资组合报告附注	35
§ 8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	36
8.2 期末上市基金前十名持有人	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	36
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	37
§ 9 开放式基金份额变动	37
§ 10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议	37
10.2 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	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	37
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8 其他重大事件	38
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	38
§ 12 备查文件目录	39
12.1 备查文件名称	39
12.2 备查文件存放地点	39
12.3 备查文件查阅方式	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信诚鼎利定增
场内简称	信诚定增
基金主代码	165528
基金运作方式	契约型基金。基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。
基金合同生效日	2016年5月24日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,216,702,748.19份
基金合同存续期	不定期

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投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在基金合同生效后 18 个月内,将积极参与上市公司的定向增发。通过宏观经济、行业分析、实施定向增发公司的定增条款和基本面深入研究基础上,利用定向增发项目的事件性特征与折价优势,优选具有较高折价保护并通过定向增发能够改善企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资,同时考虑行业偏离及风险,用量化的方法进行组合配置,规避非系统风险。本基金转为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,投资策略相应调整。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。
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,属于较高风险、较高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	郭明
	联系电话	021-68649788	(010) 66105799
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0066	95588
传真		021-50120888	(010) 66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	大楼 9 层	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	张翔燕	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-17,078,149.13
本期利润	-36,335,843.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0299
本期加权平均净值利润率	-2.95%
本期基金份额净值增长率	-2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-24,086,825.17
期末可供分配基金份额利润	-0.0198
期末基金资产净值	1,192,615,923.02
期末基金份额净值	0.980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.00%

注：1、上述基金业绩指标不包括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。

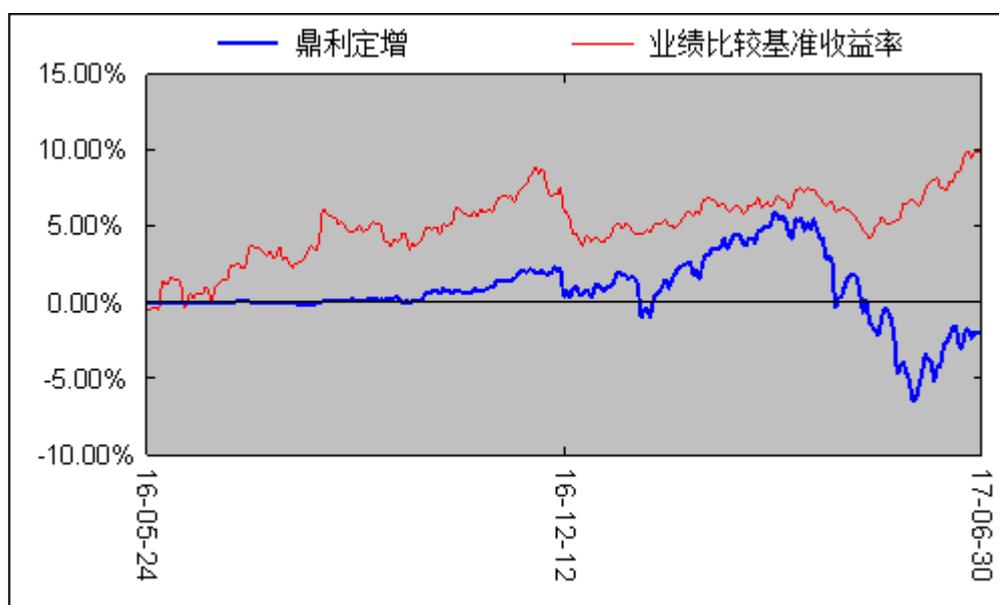
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.38%	0.74%	3.01%	0.34%	0.37%	0.40%
过去三个月	-6.04%	0.81%	3.16%	0.32%	-9.20%	0.49%
过去六个月	-2.97%	0.66%	5.36%	0.29%	-8.33%	0.37%
过去一年	-2.00%	0.48%	8.32%	0.35%	-10.32%	0.13%
自基金合同生效起至今	-2.00%	0.46%	9.89%	0.37%	-11.89%	0.09%

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



注:1、本基金建仓期自 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 11 月 24 日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 70 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、信诚中证建筑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、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信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		
杨旭	本基金基金经理, 兼任信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金及信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证建筑工程指数型基	2016 年 5 月 24 日	-	4	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司, 担任数量分析师; 于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司, 担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入信诚基金, 历任助理投资经理、专户投资经理。现任数量投资副总监, 信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中

	金 (LOF)、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金的基金经理				证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证建筑工程指数型基金 (LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金的基金经理。
殷孝东	本基金基金经理, 信诚多策略灵活配置混合基金的基金经理, 投资银行部董事总经理	2016 年 12 月 16 日	-	14	工商管理硕士。曾任职于大鹏证券有限公司, 担任资讯部分析师; 于中信证券股份有限公司, 历任研究部行业首席分析师、研究部执行总经理、研究部运营负责人、投行委能源化工组执行总经理、经发管委执行总经理等职。2016 年 3 月加入信诚基金管理有限公司, 担任投资银行部董事总经理。现兼任信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合基金的基金经理。

注: 1. 经基金业协会批准, 韩益平先生于 2017 年 7 月 4 日正式注册为本基金的基金经理。截至本报告披露日, 本基金由韩益平、杨旭和殷孝东共同管理。

2. 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。

3. 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合规守信情况的说明

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《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金》、《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, 未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 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

上半年,市场经过了一季度的短暂反弹和第二季度的深度调整,市场整体波动较大,且风格分化非常明显,低估值价值蓝筹大幅跑赢成长和周期板块。本产品定增投资占非现金资产的 80%以上,仓位较高无流动性,且定增相关资产主要集中于成长和周期板块,因此在第二季度的市场调整中,本产品业绩波动较大。但是由于我们在定增投资个股上的精选,二季度末产品业绩伴随市场触底快速反弹,在同类产品中表现较为领先。我们认为虽然因为定增投资仓位的限制,上半年无法深度参与白酒、医药、家电等传统蓝筹板块的行情,但是全年来看我们在周期板块和成长板块精选的个股有望会跑赢指数。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-2.97%,同期业绩比较基准收益率为 5.36%,基金落后业绩比较基准 8.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们依然相信行情整体震荡中逐步走向“慢牛”,市场关注方向将从绝对估值较低的蓝筹板块向高业绩成长板块,重点配置新能源产业链、消费电子、医药和高端装备领域。同时伴随市场风险偏好逐步提升,我们认为受益于改革持续推进的军工板块、国企改革板块将逐步配置时点,将会择机择优配置。目前本基金已经完成定增权益类资产投资的预期目标,未来将迎来定增个股的集中解禁期,我们会积极合理调整仓位,做好部分浮盈较大的定增个股的退出管理,并积极布局高业绩成长和受益改革的精选个股。

4.6 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。

基金管理人会对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。

4.7 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、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该次每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配，该处理符合基金利润分配原则。

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

本报告期内，本基金未出现连续 20 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

本报告期内，本基金托管人在对信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的管理人——信诚基金管理有限公司在信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对信诚基金管理有限公司编制和披露的信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	19,809,786.96	102,998,999.62
结算备付金		38,823,733.86	308,619.14
存出保证金		63,389.73	45,884.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,021,400,128.27	1,127,245,007.10
其中: 股票投资		1,021,400,128.27	1,087,285,007.10
基金投资		-	-
债券投资		-	39,960,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	134,400,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	42,235.13	768,621.32
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,214,539,273.95	1,231,367,131.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,459,680.70	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,445,700.80	1,565,041.88
应付托管费		240,950.12	260,840.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	213,569.08	154,140.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	563,450.23	435,343.17
负债合计		21,923,350.93	2,415,365.76
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
未分配利润	6.4.7.10	-24,086,825.17	12,249,017.91
所有者权益合计		1,192,615,923.02	1,228,951,766.10

负债和所有者权益总计		1, 214, 539, 273. 95	1, 231, 367, 131. 86
------------	--	----------------------	----------------------

注：截止本报告期末, 基金份额净值 0. 980 元, 基金份额总额 1, 216, 702, 748. 19 份。

6.2 利润表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日(基金合同 生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-24, 839, 046. 09	2, 657, 757. 84
1. 利息收入		877, 664. 32	2, 633, 877. 84
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	462, 278. 23	2, 430, 355. 89
债券利息收入		168, 142. 47	7, 604. 13
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		247, 243. 62	195, 917. 82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-6, 459, 016. 46	-
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	-9, 373, 344. 17	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	83, 920. 00	-
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 13. 1	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 14	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 15	-1, 279, 340. 00	-
股利收益	6. 4. 7. 16	4, 109, 747. 71	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	-19, 257, 693. 95	23, 880. 00
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6. 4. 7. 18	-	-
减：二、费用		11, 496, 796. 99	2, 221, 382. 44
1. 管理人报酬		9, 147, 273. 93	1, 845, 249. 82
2. 托管费		1, 524, 545. 60	307, 541. 64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	577, 887. 00	300. 00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 其他费用	6. 4. 7. 20	247, 090. 46	68, 290. 98

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-36,335,843.08	436,375.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-36,335,843.08	436,375.40

注：本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日。上年度可比期间自 2016 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,216,702,748.19	12,249,017.91	1,228,951,766.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,335,843.08	-36,335,843.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,216,702,748.19	-24,086,825.17	1,192,615,923.02
项目	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 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）	1,216,702,748.19	-	1,216,702,748.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	436,375.40	436,375.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,216,702,748.19	436,375.40	1,217,139,123.59

注：本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日。上年度可比期间自 2016 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吕涛	陈逸辛	刘卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚鼎利定增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”）《关于准予信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]751 号文）和《关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]1102 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《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 5 月 24 日生效。本基金为契约型基金，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 5 月 17 日募集，募集的净认购金额 1,216,348,748.86 元，募集期间认购利息转份额 353,999.33 元，募集规模为 1,216,702,748.19 份。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（2016）第 490 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《信诚鼎利定增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、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、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：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）后股票资产占基金资产的比例范围为 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规或监管机构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。

本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚鼎利定增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基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求,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 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25% 计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。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。

(5) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	19,809,786.96
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	19,809,786.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,029,627,135.80	1,021,400,128.27	-8,227,007.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,029,627,135.80	1,021,400,128.27	-8,227,007.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场买入返售金融资产	-	-
交易所市场买入返售金融资产	134,400,000.00	-
合计	134,400,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末，未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,518.99
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	31.41
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	18,106.72
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20,578.01
合计	42,235.13

注：其他指应收结算保证金利息、应收中金所备付金利息。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	212,741.46
银行间市场应付交易费用	827.62
合计	213,569.08

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	448,765.71
基金上市费	29,752.78
其他	35,343.17
合计	563,450.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,218,331.49	11,030,686.42	12,249,017.91
本期利润	-17,078,149.13	-19,257,693.95	-36,335,843.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,859,817.64	-8,227,007.53	-24,086,825.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	410,951.35

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	2,579.44
其他	48,747.44
合计	462,278.23

注：其他指中金所存款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	204,024,606.92
减：卖出股票成本总额	213,397,951.09
买卖股票差价收入	-9,373,344.17

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	83,920.00
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	83,920.00

6.4.7.13.2 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1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,916,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,916,080.00
减：应收利息总额	916,000.00
买卖债券差价收入	83,920.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-

减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	-1,279,340.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,109,747.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,109,747.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-19,257,693.95
——股票投资	-19,213,773.95
——债券投资	-43,920.00
——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	-19,257,693.95

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	574,715.75
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	3,171.25
合计	577,887.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行费用	483.40
债券帐户维护费	18,000.00
基金上市费	29,752.78
其他	500.00
合计	247,090.46

6.4.7.21 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

6.4.10.1.2 权证交易

6.4.10.1.3 债券交易

6.4.10.1.4 债券回购交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年5月24日(基金合同生 效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,147,273.93	1,845,249.82
其中：支付销售机构的客户维护费	2,281,321.01	483,990.47

注：1. 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 1.5% 的年费率每日计提,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×1.5%/当年天数。

2. 注：本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日,上年度可比期间自 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年5月24日(基金合同生 效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,524,545.60	307,541.64

注：1. 支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率每日计提,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×0.25%/当年天数。

2. 注：本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日,上年度可比期间自 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30	上年度可比期间 2016年5月24日(基金合同生
----	---------------------------	-----------------------------

	日	效日)至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2016 年 5 月 24 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,501,602.00	-
报告期间申购/买入总份额	1,431,436.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,933,038.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.65%	-

注: 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上年度可比期间未投资过本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
信诚人寿保险有限公司	20,005,300.00	1.64%	20,005,300.00	1.64%

注: 本基金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, 除上表外, 本基金的其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效 日)至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	19,809,786.96	410,951.35	186,996,918.39	265,883.60

注: 本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金, 于 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 77,542.29 元。(2016 年 6 月 30 日余额为 0 元)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间, 均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2017 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

						单价				
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新股 申购未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下新股 申购未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
600200	江苏吴中	2016-10-17	2017-10-12	非公开定向增发	17.49	13.20	571,755	9,999,994.95	7,547,166.00	-
603618	杭电股份	2016-09-07	2017-08-31	非公开定向增发	13.56	10.37	1,032,448	13,999,994.88	10,706,485.76	-
002528	英飞拓	2016-08-29	2017-08-28	非公开定向增发	6.78	5.93	1,946,903	13,200,002.34	11,545,134.79	-
002746	仙坛股份	2016-09-21	2017-09-20	非公开定向增发	37.25	29.13	536,913	20,000,009.25	15,640,275.69	-
600531	豫光金铅	2016-12-20	2017-12-17	非公开定向增发	7.50	7.36	2,660,402	19,953,015.00	19,580,558.72	-
002169	智光电气	2016-10-11	2017-10-10	非公开定向增发	19.50	7.52	3,189,744	31,100,004.00	23,986,874.88	-
002226	江南化工	2016-10-19	2017-10-19	非公开定向增发	8.14	7.04	4,299,754	34,999,997.56	30,270,268.16	-
002149	西部材料	2016-08-10	2017-08-10	非公开定向增发	24.70	11.42	3,778,618	46,665,932.30	43,151,817.56	-
002099	海翔药业	2016-09-19	2017-09-18	非公开定向增发	10.28	6.66	8,706,226	89,500,003.28	57,983,465.16	-
300259	新天科技	2016-09-27	2017-09-26	非公开定向增发	11.00	10.66	5,727,273	63,000,003.00	61,052,730.18	-
600227	赤天化	2016-10-21	2017-10-18	非公开定向增发	6.01	6.40	11,647,255	70,000,002.55	74,542,432.00	-
002484	江海股份	2016-09-08	2017-09-08	非公开定向增发	12.69	9.87	8,164,000	79,693,200.00	80,578,680.00	-
601137	博威合金	2016-08-18	2017-08-18	非公开定向增发	11.20	11.33	8,616,071	96,499,995.20	97,620,084.43	-
000807	云铝股份	2016-11-18	2017-11-20	非公开定向增发	5.20	6.43	15,384,616	80,000,003.20	98,923,080.88	-
600075	新疆天业	2016-08-23	2017-08-18	非公开定向增发	11.54	8.64	11,767,764	97,000,000.84	101,673,480.96	-
300296	利亚德	2016-09-05	2017-08-28	非公开定向增发	28.40	18.01	5,767,606	81,900,005.20	103,874,584.06	-
002503	搜于特	2016-11-11	2017-11-13	非公开定向增发	12.60	6.76	15,396,826	97,000,003.80	104,082,543.76	-

6.4.12.1.2 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
------	------	-------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300252	金信诺	2017-04-27	筹划重大事项	21.65	2017-07-27	19.49	741,839	22,142,202.94	16,060,814.35	-
600318	新力金融	2017-04-27	筹划重大事项	10.73	2017-08-08	11.50	31,800	474,401.28	341,214.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可用于银行间同业市场交易,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。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 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、结算备付金等。本基金的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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017年6月30 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	19,809,786.96	-	-	-	-	-	19,809,786.96
结算备付金	38,823,733.86	-	-	-	-	-	38,823,733.86
存出保证金	63,389.73	-	-	-	-	-	63,389.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,021,400,128.27	1,021,400,128.27
买入返售金融资产	134,400,000.00	-	-	-	-	-	134,400,000.00

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	42,235.13	42,235.13
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	193,096,910.55	-	-	-	-	1,021,442,363.40	1,214,539,273.95
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19,459,680.70	19,459,680.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,445,700.80	1,445,700.80
应付托管费	-	-	-	-	-	240,950.12	240,950.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	213,569.08	213,569.08
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	563,450.23	563,450.23
负债总计	-	-	-	-	-	21,923,350.93	21,923,350.93
利率敏感度缺口	193,096,910.55	-	-	-	-	999,519,012.47	1,192,615,923.02
上年度末 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	102,998,999.62	-	-	-	-	-	102,998,999.62
结算备付金	308,619.14	-	-	-	-	-	308,619.14
存出保证金	45,884.68	-	-	-	-	-	45,884.68
交易性金融资产	-	39,960,000.00	-	-	-	1,087,285,007.10	1,127,245,007.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	768,621.32	768,621.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	103,353,503.44	39,960,000.00	-	-	-	1,088,053,628.42	1,231,367,131.86
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,565,041.88	1,565,041.88
应付托管费	-	-	-	-	-	260,840.30	260,840.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	154,140.41	154,140.41
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	435,343.17	435,343.17
负债总计	-	-	-	-	-	2,415,365.76	2,415,365.76
利率敏感度缺口	103,353,503.44	39,960,000.00	-	-	-	-1,085,638,262.66	1,228,951,766.10

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。

6.4.13.4.1.2 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6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	市场利率下降25个基点	-	18,520.05
	市场利率上升25个基点	-	-18,502.89

注：本基金于本报告期末未持有对利率敏感的金融资产与金融负债，因此可认为市场利率的变动在本报告期末对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.3 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。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30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	1,021,400,128.27	85.64	1,087,285,007.10	88.47
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	1,021,400,128.27	85.64	1,087,285,007.10	88.47

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	28,438,443.11	5,950,351.97
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-28,438,443.11	-5,950,351.97	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
	2. -		
假设	-		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	-	-	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,021,400,128.27	84.10
	其中：股票	1,021,400,128.27	84.10
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	134,400,000.00	11.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	58,633,520.82	4.83
7	其他各项资产	105,624.86	0.01
8	合计	1,214,539,273.95	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	15,640,275.69	1.31
B	采矿业	2,074,600.00	0.17
C	制造业	990,650,637.75	83.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,046,400.00	0.42
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,987.71	-
J	金融业	341,214.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	41,847.12	-
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	7,547,166.00	0.63
	合计	1,021,400,128.27	85.64

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 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	002503	搜于特	15,396,826	104,082,543.76	8.73
2	300296	利亚德	5,767,606	103,874,584.06	8.71
3	600075	新疆天业	11,767,764	101,673,480.96	8.53
4	000807	云铝股份	15,384,616	98,923,080.88	8.29
5	601137	博威合金	8,616,071	97,620,084.43	8.19
6	002484	江海股份	8,164,000	80,578,680.00	6.76
7	600227	赤天化	11,647,255	74,542,432.00	6.25
8	002099	海翔药业	9,211,346	61,347,564.36	5.14
9	300259	新天科技	5,727,273	61,052,730.18	5.12
10	002149	西部材料	3,778,618	43,151,817.56	3.62
11	002226	江南化工	4,299,754	30,270,268.16	2.54
12	002169	智光电气	3,189,744	23,986,874.88	2.01
13	600531	豫光金铅	2,660,402	19,580,558.72	1.64
14	300252	金信诺	741,839	16,060,814.35	1.35
15	002746	仙坛股份	536,913	15,640,275.69	1.31
16	002528	英飞拓	1,946,903	11,545,134.79	0.97
17	603618	杭电股份	1,032,448	10,706,485.76	0.90
18	300230	永利股份	591,953	9,790,902.62	0.82
19	600200	江苏吴中	571,755	7,547,166.00	0.63
20	002250	联化科技	513,300	7,340,190.00	0.62
21	600584	长电科技	382,200	6,134,310.00	0.51
22	000423	东阿阿胶	84,000	6,038,760.00	0.51
23	002217	合力泰	600,000	5,928,000.00	0.50
24	600114	东睦股份	294,499	5,153,732.50	0.43
25	300197	铁汉生态	380,000	5,046,400.00	0.42
26	002202	金风科技	320,200	4,953,494.00	0.42
27	600967	内蒙一机	220,000	2,998,600.00	0.25
28	300054	鼎龙股份	279,981	2,847,406.77	0.24
29	000426	兴业矿业	230,000	2,074,600.00	0.17
30	600318	新力金融	31,800	341,214.00	0.03
31	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
32	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.01
33	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	-
34	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	-
35	300658	延江股份	1,110	43,101.30	-
36	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	-
37	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	-

38	002877	智能自控	1,436	36,302.08	-
39	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	-
40	300659	中孚信息	776	27,175.52	-
41	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	-
42	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	-
43	002881	美格智能	989	22,608.54	-
44	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	-
45	300669	沪宁股份	841	14,650.22	-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000066	中国长城	20,122,580.63	1.64
2	002099	海翔药业	19,980,252.90	1.63
3	300230	永利股份	14,565,382.10	1.19
4	300252	金信诺	10,874,980.94	0.88
5	600160	巨化股份	10,296,000.00	0.84
6	002250	联化科技	8,988,418.56	0.73
7	002268	卫士通	7,059,517.00	0.57
8	600584	长电科技	5,964,919.59	0.49
9	002217	合力泰	5,901,727.00	0.48
10	000423	东阿阿胶	5,821,205.00	0.47
11	300197	铁汉生态	5,046,349.94	0.41
12	002643	万润股份	4,997,326.00	0.41
13	002202	金风科技	4,994,729.82	0.41
14	600114	东睦股份	4,993,676.00	0.41
15	300351	永贵电器	4,023,054.65	0.33
16	600967	内蒙一机	3,008,396.00	0.24
17	300054	鼎龙股份	2,917,343.01	0.24
18	000426	兴业矿业	2,050,835.98	0.17
19	600879	航天电子	1,943,114.84	0.16
20	600889	南京化纤	800,001.86	0.07

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。

7.4.2 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	600160	巨化股份	21,760,124.67	1.77
2	002099	海翔药业	20,702,899.58	1.68
3	000066	中国长城	18,386,203.69	1.50
4	002643	万润股份	13,779,028.02	1.12

5	300351	永贵电器	13,356,039.74	1.09
6	300230	永利股份	10,985,985.04	0.89
7	300248	新开普	10,727,322.00	0.87
8	600114	东睦股份	10,624,040.00	0.86
9	300316	晶盛机电	10,081,710.12	0.82
10	002130	沃尔核材	8,338,766.64	0.68
11	002268	卫士通	7,194,424.93	0.59
12	002568	百润股份	5,163,300.92	0.42
13	300161	华中数控	5,126,912.68	0.42
14	002226	江南化工	4,617,622.00	0.38
15	002609	捷顺科技	4,161,913.40	0.34
16	600879	航天电子	1,978,778.00	0.16
17	002250	联化科技	1,334,742.00	0.11
18	002045	国光电器	819,246.34	0.07
19	000502	绿景控股	786,668.00	0.06
20	002560	通达股份	755,482.00	0.06

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。

7.4.3 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	166,813,924.21
卖出股票收入（成交）总额	204,024,606.92

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。

7.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	-
股指期货投资本期收益(元)				-1,279,340.00	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-	-

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	-
国债期货投资本期收益(元)				-	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	-

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 利亚德因未按规定期限将暂时出口货物复运进境,违反海关的监管规定,于 2016 年 9 月 23 日收到《行政处罚决定书》。深圳蛇口海关根据《中华人民共和国海关法》第八十六条(三)项、《中华人民共和国海关行政处罚实施条例》第十八条(七)项之规定,处罚款人民币 2.6 万元整。

7.12.2 对利亚德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,该处罚事项未对利亚德的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚鼎利是定增基金,对于利亚德的投资是依据相关原则、结合当时市场情况等综合因素做出的筛选。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。

7.12.3 除此之外,其余本基金投资的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。

7.12.4 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。

7.12.5 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	63,389.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,235.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,624.86

7.12.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.7 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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002503	搜于特	104,082,543.76	8.73	非公开发行有明确锁定期
2	300296	利亚德	103,874,584.06	8.71	非公开发行有明确锁定期
3	600075	新疆天业	101,673,480.96	8.53	非公开发行有明确锁定期
4	000807	云铝股份	98,923,080.88	8.29	非公开发行有明确锁定期
5	601137	博威合金	97,620,084.43	8.19	非公开发行有明确锁定期
6	002484	江海股份	80,578,680.00	6.76	非公开发行有明确锁定期
7	600227	赤天化	74,542,432.00	6.25	非公开发行有明确锁定期

8	300259	新天科技	61,052,730.18	5.12	非公开发行有明确锁定期
9	002099	海翔药业	57,983,465.16	4.86	非公开发行有明确锁定期
10	002149	西部材料	43,151,817.56	3.62	非公开发行有明确锁定期

7.12.8 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,866	94,567.29	333,829,241.81	27.44%	882,873,506.38	72.56%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	广东粤财信托有限公司粤银1号	100,017,000.00	8.22%
2	中国通用技术(集团)控股有限责任公司	25,950,000.00	2.13%
3	信诚人寿保险有限公司	20,005,300.00	1.64%
4	新华人寿保险股份有限公司分红产品	20,003,500.00	1.64%
5	通用技术集团投资管理有限公司	19,000,000.00	1.56%
6	蔡云崽	15,006,750.45	1.23%
7	上海斯诺波投资管理有限公司一私募工场自由之路母基金证券投资基金	13,904,455.00	1.14%
8	泰康人寿保险股份有限公司一分红一个人分红-019L-FH002深	10,710,555.00	0.88%
9	瑞泰人寿保险有限公司(万能险)	10,000,800.00	0.82%
10	申能集团财务有限公司	10,000,800.00	0.82%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,964,188.19	0.24%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年5月24日)基金份额总额	1,216,702,748.19
本报告期期初基金份额总额	1,216,702,748.19
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,216,702,748.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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. 本报告期内,基金管理人无重大人事变动
2. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所。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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券	2	369,136,003.47	100.00%	337,945.53	100.00%	-

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。

10.7.2 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
中信证券	-	-	1,583,400,000.00	100.00%	-	-

10.8 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资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	同上	2017-01-07
3	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要	同上	2017-01-07
4	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第四季度报告	同上	2017-01-20
5	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	同上	2017-03-31
6	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	同上	2017-03-31
7	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-01
8	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-07
9	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告	同上	2017-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- 1、(原) 信诚鼎利定增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、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、信诚鼎利定增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

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

12.3 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。

信诚基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日