

# 信达澳银新财富灵活配置混合基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 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、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。本半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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>

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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信达澳银新财富混合
场内简称	-
基金主代码	003655
交易代码	003655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
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	200,026,593.88 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过对不同类别资产的优化配置，严选安全边际较高的股票、债券等进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险

	与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，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		信达澳银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	张燕
	联系电话	0755-83172666	0755-83199084
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-118	95555
传真		0755-83196151	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层 和第 9 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层 和第 9 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518054	518040
法定代表人		于建伟	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	《上海证券报》《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.fscinda.com

基金半年度报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层
-------------	---

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层



### § 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 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	7,820,483.36
本期利润	25,128,794.29
加权平均基金份额本期利润	0.1256
本期加权平均净值利润率	12.12%
本期基金份额净值增长率	12.82%
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	7,888,216.36
期末可供分配基金份额利润	0.0394
期末基金资产净值	221,796,821.65
期末基金份额净值	1.109
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	10.90%

注：1. 上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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. 期末可供分配利润为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	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	4.13%	0.47%	2.56%	0.33%	1.57%	0.14%
过去三个月	6.84%	0.43%	3.11%	0.31%	3.73%	0.12%
过去六个月	12.82%	0.41%	5.51%	0.29%	7.31%	0.12%
自基金合同 生效起至今	10.90%	0.39%	4.52%	0.31%	6.38%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

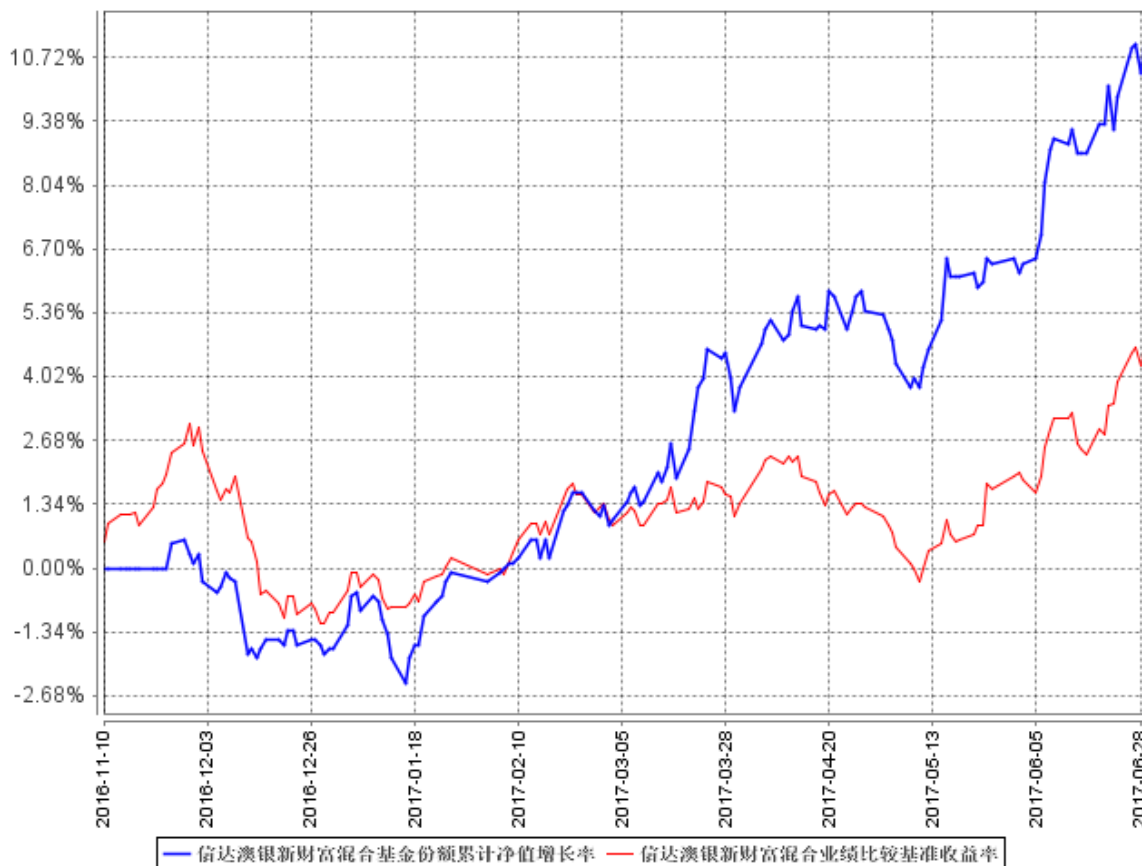
沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，上证国债指数收益率是由上海证券交易所编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和上海证券交易所网站：

<http://www.csindex.com.cn>

<http://www.sse.com.cn>

### 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

信达澳银新财富混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 11 月 10 日生效，2017 年 2 月 10 日开始办理申购、赎回业务。

2、本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%；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%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

## § 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

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共管理十六只基金，包括信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富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		
冯士祯	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理、新目标混合基金的基金经理	2016年11月10日	-	6年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2015年5月9日起至2017年7月7日）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2015年7月1日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2015年8月19日起至2017年7月7日）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2016年9月14日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年10月19日起至今）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2016年11月10日起至今）。

唐弋迅	本基金的基金经理、慧理理财货币基金、新目标混合基金、纯债债券基金的基金经理	2016 年 11 月 25 日	-	5 年	中国人民大学世界经济专业硕士。2012 年 7 月至 2014 年 7 月在第一创业证券,任研究所债券研究员; 2014 年 7 月至 2015 年 9 月在第一创业证券,任固定收益部销售经理、产品经理; 2015 年 9 月至 2016 年 7 月在第一创业证券,任固定收益部债券交易员、投资经理助理。2016 年 8 月加入信达澳银基金,任信达澳银慧理理财货币基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银纯债债券基金基金经理(2017 年 2 月 21 日起至今)。
-----	---------------------------------------	------------------	---	-----	---

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

### 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

本基金管理人对报告期内公司所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）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，经济保持在相对较高增速。“金融去杠杆”政策的接连出台，推动整体收益率上升。

从基本面看，4 月初以来，前期受“供给侧改革”推动的库存周期从阶段高点开始回落，包括钢铁、煤炭等大宗商品价格出现了大幅回调，PPI 开始逐步下滑。剖析原因，在限购政策和信贷收紧的双重压力下，房地产新开工和投资同比逐步下滑，不过，今年三四线房地产接力一、二线，销售仍保持了一定增长。同时，在财政支出高于区间的投放力度下，基建仍给予经济一定的支撑。一季度实际 GDP 同比上升至 6.9%，生产和消费保持在高位。

从政策面看，银监会在 4 月初接连出台“三套利、三违反、四不当”等监管文件，旨在推动银行体系“金融去杠杆”，证监会和保监会也出台相关措施。作为重点监管对象，银行“委外”业务面临自查和监管检查，几乎处于暂停的状态，部分问题较大的机构被要求赎回存量业务。

从资金面看，二季度整体仍较为紧张。银行同业存单发行仍保持较高价格，收益率短期快速上行。从 3 月 27 日到 5 月 10 日阶段高点，10 年国债从 3.25% 上升至 3.69%，上行 44bp，10 年国开债从 4.05% 上升至 4.38%，上行 33bp。另外，4 月初还曝出多家山东民营企业信用风险事件，对区域性信用风险造成了冲击，4 月起信用利差逐步上升。

本基金 2017 年上半年主要是配置了较大比例的价值股票，期间涨幅较高。同时，前期配置部分收益较高的短期债券及申购新股积累也对组合业绩产生了一定贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.109 元，份额累计净值为 1.109 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.82%，业绩比较基准收益率为 5.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，监管成为今年影响债市最大的一个变量。二季度，金融机构去杠杆进入实质性阶段，存款性金融机构和非银机构负债同比持续下滑，广义基金债券托管量持续减少。目前看，监管仍维持较为中性的操作加以推进。因此，并不能断言“去杠杆”完全结束。从基本面看，二季度或为本轮周期高点，受融资成本上升，信用收缩的关系，企业和地产增速震荡下滑或是大概率事件。国际上看，短期人民币相对稳定，美联储上半年两次加息，下半年预计还有一次，并且进入缩表阶段；欧日发达经济体复苏稳定，未来不排除进入削减 QE 进程。

下一阶段，本基金仍采取防守反击的策略，整体控制组合久期，同时，把握下半年机会逐步大于风险的情况下，利用利率债较好的流动性，积极调整产品杠杆和久期水平，通过交易机会增厚收益。目前，中长期低等级信用债并未完全释放，从防范流动性风险的角度考虑，下半年仍慎重择券。另外，虽然新股申购收益有所下滑，但整体上参与仍能累积收益，后期本基金依然会积极参与新股申购。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由分管基金运营的高级管理人员担任；基金估值小组成员若干名，由公募投资总部、专户理财部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

##### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

##### 4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

##### 4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。



#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 7,888,216.36 元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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**

无。

## § 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银新财富灵活配置混合基金

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	497,808.99	11,689,241.47
结算备付金		177,109.38	1,570,513.68
存出保证金		36,226.88	26,466.05
交易性金融资产	6.4.7.2	268,035,033.93	208,021,410.21
其中：股票投资		130,349,869.43	100,168,410.21
基金投资		-	-
债券投资		137,685,164.50	107,853,000.00
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		36,294.52	-
应收利息	6.4.7.5	2,455,632.00	741,795.33
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		271,238,105.70	242,049,426.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		49,049,726.42	44,999,412.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		219.16	-
应付管理人报酬		125,117.36	201,145.92
应付托管费		17,873.91	16,762.15
应付销售服务费		35,747.84	33,524.33
应付交易费用	6.4.7.7	71,524.93	115,216.13
应交税费		-	-
应付利息		8,102.10	8,923.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	132,972.33	-
负债合计		49,441,284.05	45,374,984.93
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	200,026,593.88	200,033,188.40
未分配利润	6.4.7.10	21,770,227.77	-3,358,746.59
所有者权益合计		221,796,821.65	196,674,441.81
负债和所有者权益总计		271,238,105.70	242,049,426.74

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 11 月 10 日，无可比期间数据。

2、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.109 元，基金份额总额 200,026,593.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银新财富灵活配置混合基金

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
<b>一、收入</b>		27,843,594.87
1.利息收入		2,208,733.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,733.51
债券利息收入		2,152,935.17
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		41,064.35
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,326,532.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,787,056.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	148,480.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,390,996.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,308,310.93
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	18.11
<b>减：二、费用</b>		2,714,800.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,012,806.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	102,679.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	205,358.65
4. 交易费用	6.4.7.19	392,850.25
5. 利息支出		839,481.23
其中：卖出回购金融资产支出		839,481.23
6. 其他费用	6.4.7.20	161,625.13

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,128,794.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,128,794.29

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 10 日，无可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银新财富灵活配置混合基金

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）	200,033,188.40	-3,358,746.59	196,674,441.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,128,794.29	25,128,794.29
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）	-6,594.52	180.07	-6,414.45
其中：1.基金申购款	31,472.59	1,044.31	32,516.90
2.基金赎回款	-38,067.11	-864.24	-38,931.35
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)	200,026,593.88	21,770,227.77	221,796,821.65
-----------------	----------------	---------------	----------------

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 10 日，无可比期间数据。

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：

_____ 于建伟	_____ 徐伟文	_____ 刘玉兰
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

信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2163 号《关于准予信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,033,188.40 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第 60467227\_H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2016 年 11 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,033,188.40 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及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、债券、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。本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%；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%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具

体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **6.4.6.2 营业税、增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，



自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

#### **6.4.6.3 企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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	497,808.99
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	497,808.99

**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	116,615,412.24	130,349,869.43	13,734,457.19
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,261,898.23	1,302,164.50
	银行间市场	136,275,687.13	136,383,000.00
	合计	137,537,585.36	137,685,164.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	254,152,997.60	268,035,033.93	13,882,036.33

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本期末无衍生金融资产/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**

本基金期末无买入返售金融资产期末余额

**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	128.40
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	79.70
应收债券利息	2,455,407.60
其他	16.30
合计	2,455,632.00

其他指应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	62,764.78
银行间市场应付交易费用	8,760.15
合计	71,524.93

#### 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	-
预提费用	132,972.33
合计	132,972.33

#### 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	200,033,188.40	200,033,188.40
本期申购	31,472.59	31,472.59
本期赎回(以“-”号填列)	-38,067.11	-38,067.11
- 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	200,026,593.88	200,026,593.88

#### 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	67,528.01	-3,426,274.60	-3,358,746.59
本期利润	7,820,483.36	17,308,310.93	25,128,794.29
本期基金份额交易产生的变动数	204.99	-24.92	180.07
其中：基金申购款	-87.77	1,132.08	1,044.31
基金赎回款	292.76	-1,157.00	-864.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,888,216.36	13,882,011.41	21,770,227.77

#### 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	7,749.49

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	6,584.64
其他	399.38
合计	14,733.51

其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	127,714,266.63
减：卖出股票成本总额	120,927,209.96
买卖股票差价收入	6,787,056.67

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	49,951,831.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	49,211,370.00
减：应收利息总额	591,981.69
买卖债券差价收入	148,480.00

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具投资。

**6.4.7.15 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	1,390,996.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,390,996.13

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	17,308,310.93
——股票投资	17,203,464.66
——债券投资	104,846.27
3. 其他	-
合计	17,308,310.93

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18.11
合计	18.11

**6.4.7.18 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	391,825.25
银行间市场交易费用	1,025.00
合计	392,850.25

#### 6.4.7.19 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	24,795.19
信息披露费	99,177.14
其他	12,400.00
银行手续费	4,252.80
债券托管账户维护费	21,000.00
合计	161,625.13

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，除 6.4.6 税项中披露的事项外，本基金无需要说明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

本基金本报告期内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
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构



金公司”)	
招商银行股份有限公司 (招商银行)	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司 (“信达证券”)	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司 (Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达新兴财富 (北京) 资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 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

本基金本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本期无应支付关联方佣金。

### 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,012,806.02

其中:支付销售机构的客户维护费	35.28
-----------------	-------

注:支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

2、2017 年 4 月 18 日起支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%/当年天数。

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	102,679.30

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达澳银基金公司	205,331.68
招商银行	6.10
信达证券	20.87
合计	205,358.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达澳银基金公司	
招商银行	

信达证券	
合计	0.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日的基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 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

本基金本期无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

本期基金管理人无运用固有资金投资本基金。

##### 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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
	招商银行	497,808.99

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配。

## 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	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满	2017 年	2017	新股流	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	电子	6月27日	7月5日	通受限						
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 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
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事件	5.35	2017年7月26日	5.89	386,000	2,252,463.35	2,065,100.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事件	11.32	-	-	19,000	210,505.38	215,080.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事件	12.59	2017年7月3日	12.70	7,000	96,919.61	88,130.00	-

#### 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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 49,049,726.42 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
111609346	16 浦发 CD346	2017 年 7 月 7 日	96.87	200,000	19,374,000.00
111717067	17 光大银 行 CD067	2017 年 7 月 7 日	97.80	200,000	19,560,000.00
111790665	17 杭州银 行 CD018	2017 年 7 月 7 日	95.74	110,000	10,531,400.00
合计				510,000	49,465,400.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款。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。

#### 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部

具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	137,390,461.00	107,583,000.00
合计	137,390,461.00	107,583,000.00

注：1、本期末未评级债券为超短期融资券、大额可转让同业存单及政策性金融债。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以内(含1年)的债券。

**6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	294,703.50.	-
未评级	-	-
合计	294,703.50.	-

注：长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

**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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的监察稽核部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%；本基金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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

除卖出回购金融资产款余额中有 49,049,726.42 元将在一个月內到期且计息外，本基金持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。



#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	497,808.99	-	-	-	497,808.99
结算备付金	177,109.38	-	-	-	177,109.38
存出保证金	36,226.88	-	-	-	36,226.88
交易性金融资产	137,685,164.50	-	-	130,349,869.43	268,035,033.93
应收证券清算款	-	-	-	36,294.52	36,294.52
应收利息	-	-	-	2,455,632.00	2,455,632.00
资产总计	138,396,309.75	-	-	132,841,795.95	271,238,105.70
负债					
卖出回购金融资产款	49,049,726.42	-	-	-	49,049,726.42
应付赎回款	-	-	-	219.16	219.16
应付管理人报酬	-	-	-	125,117.36	125,117.36

应付托管费	-	-	-	17,873.91	17,873.91
应付销售服务费	-	-	-	35,747.84	35,747.84
应付交易费用	-	-	-	71,524.93	71,524.93
应付利息	-	-	-	8,102.10	8,102.10
其他负债	-	-	-	132,972.33	132,972.33
负债总计	49,049,726.42	-	-	391,557.63	49,441,284.05
利率敏感度缺口	89,346,583.33	-	-	不适用	不适用
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,689,241.47	-	-	-	11,689,241.47
结算备付金	1,570,513.68	-	-	-	1,570,513.68
存出保证金	26,466.05	-	-	-	26,466.05
交易性金融资产	107,853,000.00	-	-	100,168,410.21	208,021,410.21
应收利息	-	-	-	741,795.33	741,795.33
其他资产	-	-	-	20,000,000.00	20,000,000.00
资产总计	121,139,221.20	-	-	120,910,205.54	242,049,426.74
负债					
卖出回购金融资产 款	44,999,412.50	-	-	-	44,999,412.50
应付管理人报酬	-	-	-	201,145.92	201,145.92
应付托管费	-	-	-	16,762.15	16,762.15
应付销售服务费	-	-	-	33,524.33	33,524.33
应付交易费用	-	-	-	115,216.13	115,216.13
应付利息	-	-	-	8,923.90	8,923.90
负债总计	44,999,412.50	-	-	375,572.43	45,374,984.93
利率敏感度缺口	76,139,808.70	-	-	不适用	不适用

**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：人民币万元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	上升约 11.00	上升约 13
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 11.00	下降约 13

**6.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金将在风险管理的前提下进行积极的投资，其投资策略主要包括两个方面：自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股；运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产为基金资产的 0%-95%；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内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**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	130,349,869.43	58.77	100,168,410.21	50.93
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	130,349,869.43	58.77	100,168,410.21	50.93

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	相关风险变量的变动		
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：人民币万元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 613.00	上升约 616.00
	2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 613.00	下降约 616.00

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险****6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## 6.4.14.1 公允价值

## (a) 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贷款及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 127,857,876.33 元，属于第二层次的余额为人民币 1,40,177,157.60 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 17 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	130,349,869.43	48.06
	其中：股票	130,349,869.43	48.06
2	固定收益投资	137,685,164.50	50.76
	其中：债券	137,685,164.50	50.76
	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	-	-
	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	674,918.37	0.25
7	其他各项资产	2,528,153.40	0.93
8	合计	271,238,105.70	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,732,544.00	1.23
C	制造业	67,154,708.18	30.28

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,263,233.96	3.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,675,780.10	4.36
G	交通运输、仓储和邮政业	13,136,334.20	5.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,626,123.62	1.18
J	金融业	12,232,230.00	5.52
K	房地产业	1,068,000.00	0.48
L	租赁和商务服务业	3,401,653.32	1.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,404,260.00	1.08
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	7,655,002.05	3.45
S	综合	-	-
	合计	130,349,869.43	58.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

### 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	601318	中国平安	113,000	5,605,930.00	2.53
2	000063	中兴通讯	200,400	4,757,496.00	2.14

3	000895	双汇发展	190,000	4,512,500.00	2.03
4	601939	建设银行	690,000	4,243,500.00	1.91
5	601607	上海医药	146,600	4,233,808.00	1.91
6	600887	伊利股份	193,000	4,166,870.00	1.88
7	600276	恒瑞医药	77,480	3,919,713.20	1.77
8	600900	长江电力	251,000	3,860,380.00	1.74
9	000581	威孚高科	145,781	3,775,727.90	1.70
10	600196	复星医药	120,206	3,725,183.94	1.68
11	000028	国药一致	42,283	3,420,694.70	1.54
12	600138	中青旅	161,522	3,401,653.32	1.53
13	600166	福田汽车	1,195,700	3,395,788.00	1.53
14	002563	森马服饰	396,914	3,365,830.72	1.52
15	002739	万达电影	64,971	3,311,571.87	1.49
16	600562	国睿科技	117,000	3,222,180.00	1.45
17	600038	中直股份	64,979	2,974,088.83	1.34
18	002003	伟星股份	278,850	2,913,982.50	1.31
19	000661	长春高新	22,500	2,904,975.00	1.31
20	000828	东莞控股	231,955	2,783,460.00	1.25
21	600028	中国石化	460,800	2,732,544.00	1.23
22	300182	捷成股份	273,900	2,618,484.00	1.18
23	000338	潍柴动力	195,000	2,574,000.00	1.16
24	300144	宋城演艺	117,414	2,450,430.18	1.10
25	600054	黄山旅游	140,600	2,404,260.00	1.08
26	600030	中信证券	140,000	2,382,800.00	1.07
27	300408	三环集团	109,845	2,305,646.55	1.04
28	002389	南洋科技	108,021	2,274,922.26	1.03
29	601333	广深铁路	502,000	2,269,040.00	1.02
30	002821	凯莱英	30,400	2,218,288.00	1.00



31	600004	白云机场	119,500	2,205,970.00	0.99
32	000333	美的集团	49,700	2,139,088.00	0.96
33	000601	韶能股份	300,000	2,139,000.00	0.96
34	600452	涪陵电力	46,388	2,118,539.96	0.96
35	600056	中国医药	81,000	2,101,950.00	0.95
36	601919	中远海控	386,000	2,065,100.00	0.93
37	002008	大族激光	57,684	1,998,173.76	0.90
38	300003	乐普医疗	88,222	1,950,588.42	0.88
39	000022	深赤湾A	65,300	1,942,675.00	0.88
40	002343	慈文传媒	50,000	1,893,000.00	0.85
41	000429	粤高速A	218,980	1,870,089.20	0.84
42	000963	华东医药	36,342	1,806,197.40	0.81
43	603160	汇顶科技	16,000	1,604,800.00	0.72
44	002415	海康威视	44,489	1,436,994.70	0.65
45	001979	招商蛇口	50,000	1,068,000.00	0.48
46	000538	云南白药	10,400	976,040.00	0.44
47	603986	兆易创新	11,000	855,910.00	0.39
48	600161	天坛生物	6,760	262,355.60	0.12
49	600655	豫园商城	19,000	215,080.00	0.10
50	600143	金发科技	31,500	189,945.00	0.09
51	000690	宝新能源	24,300	145,314.00	0.07
52	002681	奋达科技	7,000	88,130.00	0.04
53	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.04
54	603555	贵人鸟	2,500	55,900.00	0.03
55	603801	志邦股份	1,405	47,489.00	0.02
56	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
57	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
58	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02

59	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
60	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
61	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
62	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
63	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
64	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
65	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
66	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
67	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
68	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
69	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
70	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
71	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
72	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
73	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 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	000063	中兴通讯	4,053,139.69	2.06
2	002003	伟星股份	4,037,137.28	2.05
3	600196	复星医药	4,027,786.70	2.05
4	600028	中国石化	4,003,296.00	2.04
5	000581	威孚高科	3,969,286.99	2.02
6	002294	信立泰	3,959,690.04	2.01
7	601939	建设银行	3,946,100.00	2.01

8	000661	长春高新	3,942,569.40	2.00
9	600452	涪陵电力	3,611,036.68	1.84
10	600887	伊利股份	3,515,796.00	1.79
11	600276	恒瑞医药	3,515,677.90	1.79
12	300182	捷成股份	3,465,317.00	1.76
13	601333	广深铁路	3,412,316.94	1.74
14	002739	万达电影	3,407,171.09	1.73
15	002389	南洋科技	3,194,687.51	1.62
16	000538	云南白药	3,016,950.00	1.53
17	600660	福耀玻璃	3,015,803.00	1.53
18	601607	上海医药	3,013,750.00	1.53
19	601919	中远海控	3,011,065.00	1.53
20	600054	黄山旅游	2,997,791.21	1.52

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（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	600270	外运发展	4,057,982.00	2.06
2	002294	信立泰	3,818,950.08	1.94
3	600660	福耀玻璃	3,723,375.00	1.89
4	002008	大族激光	3,448,680.15	1.75
5	000963	华东医药	3,273,679.89	1.66
6	300408	三环集团	2,773,936.00	1.41
7	600452	涪陵电力	2,588,474.65	1.32
8	000776	广发证券	2,567,463.00	1.31

9	000538	云南白药	2,507,517.94	1.27
10	300568	星源材质	2,327,363.70	1.18
11	002415	海康威视	2,232,324.60	1.14
12	000429	粤高速 A	2,200,313.20	1.12
13	002202	金风科技	1,958,374.56	1.00
14	000661	长春高新	1,760,925.44	0.90
15	600056	中国医药	1,736,149.34	0.88
16	000028	国药一致	1,461,275.70	0.74
17	600138	中青旅	1,414,618.00	0.72
18	600276	恒瑞医药	1,317,286.23	0.67
19	600196	复星医药	1,297,231.00	0.66
20	600028	中国石化	1,287,959.14	0.65

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（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	133,905,204.52
卖出股票收入（成交）总额	127,714,266.63

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按照买卖成交金额（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	1,007,461.00	0.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,019,000.00	4.52
	其中：政策性金融债	10,019,000.00	4.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,025,000.00	4.52

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.13
8	同业存单	116,339,000.00	52.45
9	其他	-	-
10	合计	137,685,164.50	62.08

## 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（%）
1	111790665	17 杭州银行 CD018	300,000	28,722,000.00	12.95
2	111796433	17 南京银行 CD090	200,000	19,564,000.00	8.82
3	111717067	17 光大银行 CD067	200,000	19,560,000.00	8.82
4	111609346	16 浦发 CD346	200,000	19,374,000.00	8.74
5	111619155	16 恒丰银行 CD155	200,000	19,344,000.00	8.72

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 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	36,226.88
2	应收证券清算款	36,294.52
3	应收股利	-
4	应收利息	2,455,632.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,528,153.40

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中无流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 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

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
222	901,020.69	199,999,000.00	99.99%	27,593.88	0.01%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月10日）基金份额总额	200,033,188.40
本报告期期初基金份额总额	200,033,188.40
本报告期基金总申购份额	31,472.59
减：本报告期基金总赎回份额	38,067.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	200,026,593.88



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于信达澳银新财富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》，本次基金份额持有人大会于 2017 年 4 月 17 日表决通过了该议案，本次大会决议自该日起生效。

### 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

本基金管理人 2017 年 5 月 20 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会第十九次书面决议通过，焦巍先生离任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。

### 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

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员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	
民生证券	2	258,928,173.46	100.00%	241,139.99	100.00%	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
民生证券	1,006,915.00	100.00%	210,400,000.00	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	信达澳银基金管理有限公司旗下	证监会指定信息披	2017 年 1 月 3 日

	基金年度净值公告	露报纸、公司网站	
2	关于增加招商银行为信达澳银新财富基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 1 月 13 日
3	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 1 月 14 日
4	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 1 月 17 日
5	信达澳银旗下证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 1 月 20 日
6	公司对外业务暂停服务公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 1 月 27 日
7	关于信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回及限制大额申购业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 2 月 7 日
8	关于信达澳银新财富混合基金参加信达证券基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 2 月 11 日
9	关于信达澳银新财富混合型证券投资基金召开份额持有人大会的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 3 月 15 日
10	公司对外业务暂停服务公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 3 月 31 日
11	信达澳银旗下证券投资基金 2016 年度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 3 月 31 日
12	信达澳银新财富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	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 4 月 18 日
13	信达澳银旗下证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 4 月 21 日

14	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 4 月 25 日
15	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 4 月 26 日
16	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 5 月 20 日
17	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 5 月 24 日
18	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新) 2017 年第 1 期及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 6 月 20 日
19	公司对外业务暂停服务公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2017 年 6 月 30 日

## § 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者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-0630	199,999,000.00	-	-	199,999,000.00	99.99%
个人							
产品特有风险							

1、赎回申请延期办理的风险

机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；

2、基金净值大幅波动的风险

机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；

3、提前终止基金合同的风险

机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；

4、基金规模过小导致的风险

机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

**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 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)