# 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

2015 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：2016 年 3 月 25 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 2016 年 3 月 24 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 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)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 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遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
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 ..... 13
§5 托管人报告 ..... 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
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 ..... 13
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 ..... 14

§7 年度财务报表 ..... 15
7.1 资产负债表 ..... 15
7.2 利润表 ..... 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 17
7.4 报表附注 ..... 18
§8 投资组合报告 ..... 34
8.1 期末基金资产组合情况 ..... 34
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 ..... 34
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 ..... 35
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 35
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 37
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 ..... 37
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 ..... 37
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 ..... 37
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 ..... 37
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 37
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 38
8.12 投资组合报告附注 ..... 38
§9 基金份额持有人信息 ..... 39
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 39
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 39
9.3 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 ..... 39
§10 开放式基金份额变动 ..... 39
§11 重大事件揭示 ..... 40
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 40
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 ..... 40
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 40
11.4 基金投资策略的改变 ..... 40
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 40
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 ..... 40
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 41
11.8 其他重大事件 ..... 41
§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 43
§13 备查文件目录 ..... 43
13.1 备查文件名称 ..... 43
13.2 备查文件存放地点 ..... 43
13.3 备查文件查阅方式 ..... 43

# §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 | |
| 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 | 1,608,511,094.66 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 |
| 下属分级基金的交易代码 | 001494 | 002047 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,928,612.07 份 | 1,600,582,482.59 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 | 本基金主要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。<br>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。<br>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,将在对权证标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。 |
| 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。 |

注:2015 年 11 月 16 日起本基金基金份额分为不同的类别,基金份额类别包括 A 类和 B 类。详见本基金管理人于 2015 年 11 月 14 日发布的公告

### 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@citicpru.com.cn | 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) | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 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 | 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 |
| 本期已实现收益 | 5,030,803.41 | 1,796,850.13 |
| 本期利润 | 5,004,005.60 | 5,134,512.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0219 | 0.0022 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.15% | 0.22% |
| 本期基金份额净值增长率 | 41.00% | 0.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 3,254,137.05 | 2,772,163.72 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4104 | 0.0017 |

| | | |
|---|---|---|
| 期末基金资产净值 | 11,182,749.12 | 1,605,716,420.10 |
| 期末基金份额净值 | 1.410 | 1.003 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 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

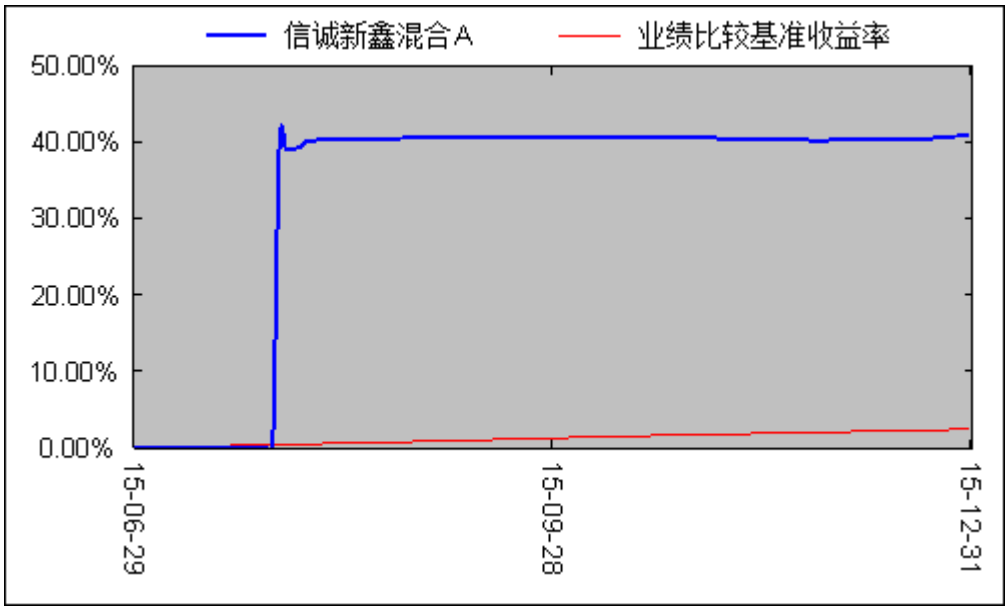
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.21% | 0.04% | 1.15% | 0.01% | -0.94% | 0.03% |
| 过去六个月 | 41.00% | 3.51% | 2.39% | 0.01% | 38.61% | 3.50% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.00% | 3.49% | 2.41% | 0.01% | 38.59% | 3.48% |

信诚新鑫混合 B

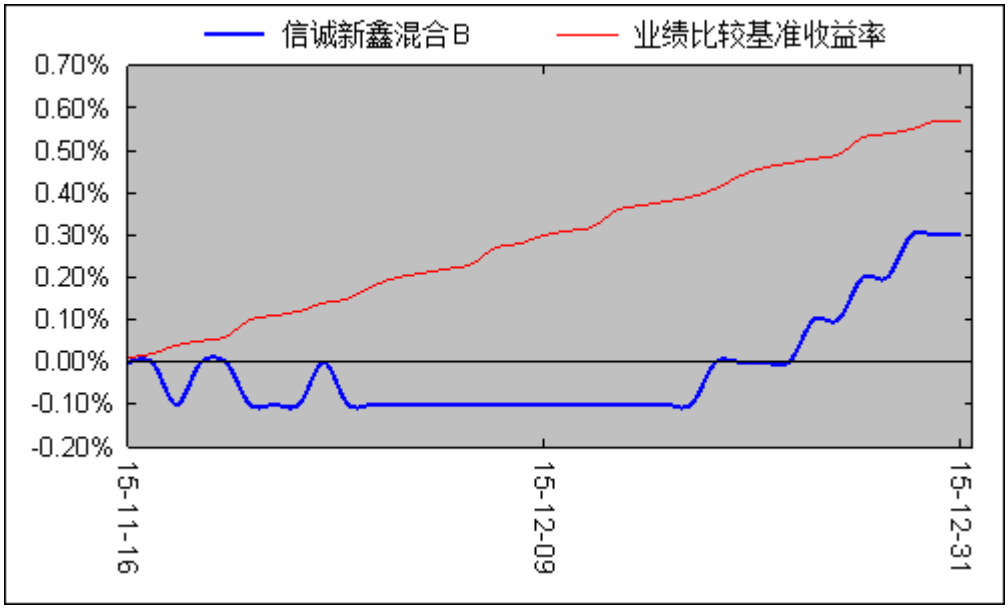
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至今 | 0.30% | 0.05% | 0.57% | 0.01% | -0.27% | 0.04% |

**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

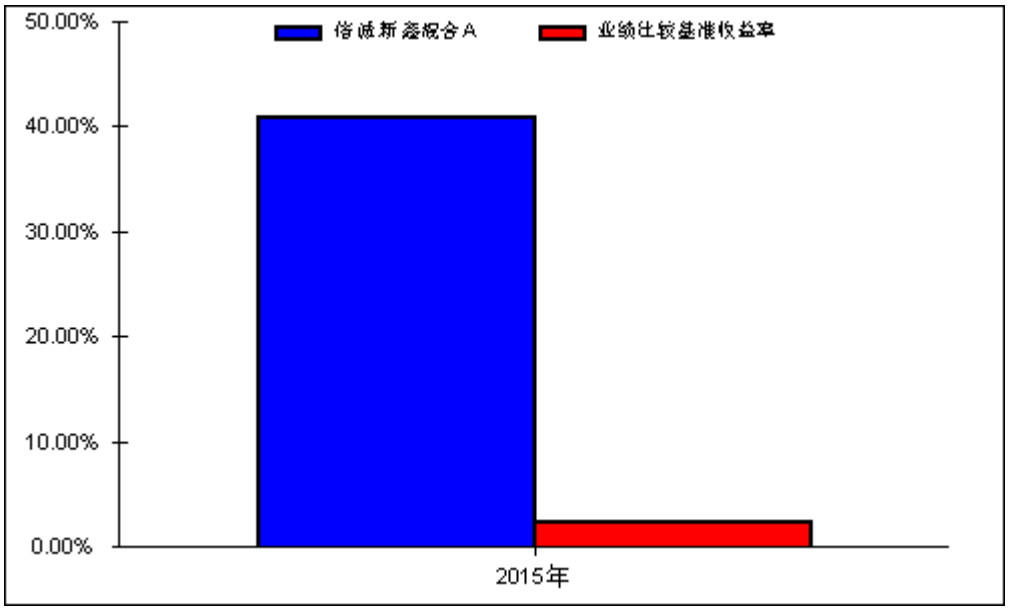



注：1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为 2015 年 6 月 29 日),本基金于 2015 年 11 月 16 日起新增 B 类份额。

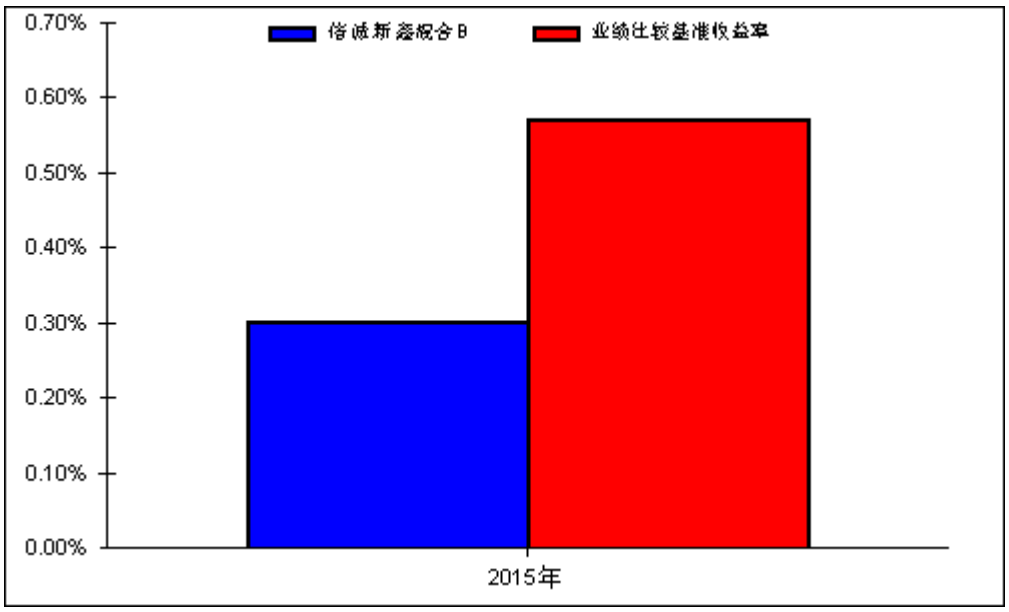
2.本基金建仓期自 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 月 29 日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

**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 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为 2015 年 6 月 29 日,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 2015 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 38 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、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、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和信诚中证基建工程指数分级证券投资基金。

### 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新双盈分级债券基金、信诚增强收益债券型(LOF)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 | 2015 年 6 月 29 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 年加盟信诚基金管理有限公司,现任公司副首席投资官,兼信诚增强收益债券型(LOF)基金、信诚添金分级债券基金、信诚新双盈分级债券基金、信诚新 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 首席投资官 | | | | 锐回报灵活配置混合基金、信诚新鑫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。 |
| 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的基金经理 | 2015 年 6 月 29 日 | - | 4 | 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）、信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金的基金经理。 |

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**

在经历了连续两年的债券大牛市之后,各债券品种收益率已基本处于历史低位。在中国经济处于动能转换、新旧交替时期,经济增长乏力的基本面会长期保持,支撑债市的主要中期因素仍在发挥作用,但在信贷数据大幅超预期、政策从宽货币向宽信用转换的背景下,市场观点已经开始出现分歧,债券市场走势特征将以窄幅波动为主。

**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 41.00%,0.30%,同期业绩比较基准收益率分别为 2.41%,0.57%,基金 A 份额领先业绩比较基准 38.59%,、基金 B 份额落后业绩比较基准 0.27%。

**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 2016 年,中央经济工作会议确定了“去产能”的基调,在经济调结构、清理过剩产能的主旋律下,经济增长的内生增长动力不强,宏观经济低位运行乃至下滑为债牛提供了坚实基础。与此同时 CPI 仍面临进一步下行的压力,央行的宽松货币政策为收益率曲线下移腾出空间。2016 年债市维持牛市的概率较大,但几大风险点将影响债市走势并加大市场波动,包括:(1)汇率风险,2016 年美联储多次加息为大概率事件,中美利差将缩窄甚至倒挂,国内资本流出压力仍然存在,汇率风险上升短期内仍是利率进一步宽松的重大制约;(2)信用风险,随着去产能进程的继续,信用风险将成为债市最为担忧的风险点;(3)货币宽松边际收紧的风险,无论是资本流出,还是基本面好于预期,都可能导致流动性宽松程度低于预期,进而加大市场波动或抑制债市收益率下行空间。

针对当前的市场格局,结合基金合同要求,信诚新鑫回报基金采取了债券投资和网下 IPO 打新相结合的投资方式,目前基金的基本仓位以信用债投资为主,重点选择配置流动性高的利率债、交易所产业债、城投债,以及部分流动性管理。在 IPO 重启之后,本基金在配置股票资产底仓后参与了网下打新,谋取低风险收益。债券投资方面,通过分散化投资和加大信用风险筛查力度,规避信用违约风险,同时波段操作、择机增加债券资产仓位,为客户谋求稳健的投资收益。

基于债券牛市和信用风险加大的基本判断,2016 年本基金将重点投资高评级产业债和优质城投债,采取票息和适度杠杆息差操作,规避评级较低、产能过剩行业的债券品种,通过精细化信用分析,谨慎甄选投资标的。利率债方面可适当关注长久期国债的波段性交易机会;而对权益资产仍谨慎参与,但可积极参与一级市场的新股和转债网下申购,不主动参与权益二级市场投资。

2016 年以来,随着上市公司进入了业绩预告发布的密集期,行业风险的关注度有所上升,本基金将重点关注仓内的信用品种,密切跟踪行业的基本面变化,排除可能的信用风险雷区。从行业角度看,预警为负面(预减、续亏、首亏、略减)的行业主要集中在钢铁、采掘、有色金属等强周期且产能过剩的行业。根据过往经验,盈利能力出现明显恶化的主体,随着 2015 年年报的陆续发布,可能会面临较大的信用评级调降风险。此外,除了产能过剩行业的信用风险外,民营企业的实际控制人风险也在上升,与企业业绩等因素相比,民企发行人不确定性更高且更难预判,信用债防踩雷压力增大。

**4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

2015 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、研究、风控、行政、人力资源、财务、反洗钱等业务范畴。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,确保基金运作的独立性、公平性及合规性。2015 年 3 月底至 4 月初,中国证监会对我公司进行了现场监督检查,监察稽核部对本次现场检查积极配合。通过本次现场检查,能更客观地发现公司各项内控中的薄弱环节,有助于督促公司不断加强制度和风控措施,提高经营效率。

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、13 项专项审计、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成现场检查及多项自查工作等。

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,进一步完善修订了反洗钱制度,按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心,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。

**4.8 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。

本基金于本报告期未进行过利润分配,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,本基金自 2015 年 7 月 29 日起至 2015 年 11 月 16 日止基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## §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(2016)第 20722 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2015年12月31日的资产负债表、2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 | 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:<br><br>(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;<br>(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。 |
| 注册会计师的责任段 | 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。<br><br>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。<br><br>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。 | |
| 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 | |
| 审计报告日期 | 2016 年 3 月 24 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 1,496,525,895.28 |
| 结算备付金 | | 2,091,419.22 |
| 存出保证金 | | 126,141.09 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 116,705,860.56 |
| 其中：股票投资 | | 10,968,983.96 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 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 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 应收证券清算款 | | 2,640,876.88 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 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 | | 1,619,782,954.81 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2015 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 11,336.19 |
| 应付管理人报酬 | | 1,741,676.67 |
| 应付托管费 | | 387,039.27 |
| 应付销售服务费 | | 192,539.72 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 358,178.97 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 193,014.77 |
| 负债合计 | | 2,883,785.59 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,608,511,094.66 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 8,388,074.56 |
| 所有者权益合计 | | 1,616,899,169.22 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,619,782,954.81 |

注：1、截止本报告期末,基金份额总额 1,608,511,094.66 份。下属两级基金:信诚新鑫混合 A 份额的份额总额为 7,928,612.07 份,份额净值 1.410 元;信诚新鑫混合 B 份额的份额总额为 1,600,582,482.59 份,份额净值 1.003 元。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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：2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| **项 目** | **附注号** | **本期<br>2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日** |
|---|---|---|
| **一、收入** | | 15,514,847.08 |

| | | |
|---|---|---|
| 1.利息收入 | | 5,110,553.64 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 4,572,430.60 |
| 债券利息收入 | | 275,072.45 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 263,050.59 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 2,298,678.08 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 2,162,511.55 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 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 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 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 | 4,794,751.04 |
| **减：二、费用** | | 5,376,329.22 |
| 1．管理人报酬 | | 3,494,437.68 |
| 2．托管费 | | 776,541.73 |
| 3．销售服务费 | | 281,523.37 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 586,472.32 |
| 5．利息支出 | | 37,644.91 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 37,644.91 |
| 6．其他费用 | 7.4.7.20 | 199,709.21 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 10,138,517.86 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 10,138,517.86 |

注：1、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,本报告期为 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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：2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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（净值减少以“-”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 |

注：本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

**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和债券,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**

本基金本报告其无需说明的会计估计变更事项。

**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[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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(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。

**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<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 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 | 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<br>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 |

注：本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，无上年可比期间。

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债，本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，无上年可比期间。

**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**

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购债券，本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，无上年可比期间。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 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 | 1,035.21 |
| 应收债券利息 | 1,238,417.38 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.80 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 62.48 |
| 合计 | 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，本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，无上年可比期间。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 358,178.97 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 358,178.97 |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>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 | 133,000.00 |
| 预提信息披露费 | 60,000.00 |
| 合计 | 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<br>2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 1,201,572,430.13 | 1,201,572,430.13 |
| 本期申购 | 38,837,536.57 | 38,837,536.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,232,481,354.63 | -1,232,481,354.63 |
| 本期末 | 7,928,612.07 | 7,928,612.07 |

信诚新鑫混合 B

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | - | - |
| 本期申购 | 2,500,582,482.59 | 2,500,582,482.59 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -900,000,000.00 | -900,000,000.00 |
| 本期末 | 1,600,582,482.59 | 1,600,582,482.59 |

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 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 5,030,803.41 | -26,797.81 | 5,004,005.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,761,407.34 | 11,538.79 | -1,749,868.55 |
| 其中：基金申购款 | 11,155,878.54 | -6,112.63 | 11,149,765.91 |
| 基金赎回款 | -12,917,285.88 | 17,651.42 | -12,899,634.46 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,269,396.07 | -15,259.02 | 3,254,137.05 |

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 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,796,850.13 | 3,337,662.13 | 5,134,512.26 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 975,313.59 | -975,888.34 | -574.75 |
| 其中：基金申购款 | -481.51 | -93.24 | -574.75 |
| 基金赎回款 | 975,795.10 | -975,795.10 | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,772,163.72 | 2,361,773.79 | 5,133,937.51 |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 | 1,398,020.64 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 3,154,999.99 |
| 结算备付金利息收入 | 19,125.93 |
| 其他 | 284.04 |
| 合计 | 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<br>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 | 193,330,962.41 |
| 减：卖出股票成本总额 | 191,168,450.86 |

| | |
|---|---|
| 买卖股票差价收入 | 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<br>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 | 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 | 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<br>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 | 15,892,977.55 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 15,498,387.68 |
| 减：应收利息总额 | 258,423.34 |
| 买卖债券差价收入 | 136,166.53 |

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益,本基金于 2015 年 6 月 29 日成立,无上年可比期间。

**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。

**7.4.7.15 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,本基金于 2015 年 6 月 29 日成立,无上年可比期间。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益,本基金于 2015 年 6 月 29 日成立,无上年可比期间。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>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 | 3,310,864.32 |
| ——股票投资 | 3,151,205.57 |
| ——债券投资 | 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 | 3,310,864.32 |

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 | 4,786,352.17 |
| 转换费收入 | 8,212.93 |
| | 185.94 |
| 其他 | 本期其他收入金额 |
| 合计 | 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<br>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 | 586,472.32 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 586,472.32 |

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 133,000.00 |
| 信息披露费 | 60,000.00 |
| 银行费用 | 6,309.21 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 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**

1、本基金在本年度没有通过关联方的交易单元进行过交易。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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<br>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 | 3,494,437.68 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 23,566.20 |

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 0.90%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。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 | 776,541.73 |

注：1、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。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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<br>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：1、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。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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。

本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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**

1、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。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

信诚新鑫混合 A

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 基金合同生效日(2015 年 6 月 29 日)持有的基金份额 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 4,278,887.30 |
| 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 | 4,278,887.30 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 53.97% |

**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**

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。

3、本基金合同自 2015 年 6 月 11 日起生效,无上年度可比期间。

**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 | 本期 |
|---|---|

| 名称 | 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 |
| 招商银行 | 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 2,091,419.22 元。(本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。)

**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。

本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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（2015 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 |
| 002778 | 高科石化 | 2015-12-28 | 2016-01-06 | 新股申购 | 8.50 | 8.50 | 5,600 | 47,600.00 | 47,600.00 | - |

| 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 |
| | 蓝标转债 | 2015-12-23 | 2016-01-08 | 新债申购 | 100.00 | 100.00 | 6,520 | 652,000.00 | 652,000.00 | - |

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

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**

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

**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发行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。

**7.4.13.3 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**

单位:人民币元

| 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 6 个月以内 | 3 个月-1 年 | 6 个月-1 年 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | | | |
| 资产总计 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 负债 | | | | | | | | | |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 流动性净额 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

**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 2015 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 6 个月以内 | 3 个月 -1 年 | 6 个月-1 年 | 1 年以内 | 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：1、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。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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(2015 年 12 月 31 日) |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 42,334.93 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -42,008.76 |

注：本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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<br>2015 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 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 | 10,968,983.96 | 0.68 |

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

1、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.

2、本基金合同自 2015 年 6 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

**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 | 10,968,983.96 | 0.68 |
| | 其中：股票 | 10,968,983.96 | 0.68 |
| 2 | 固定收益投资 | 105,736,876.60 | 6.53 |
| | 其中：债券 | 105,736,876.60 | 6.53 |
| | 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 | 1,498,617,314.50 | 92.52 |
| 7 | 其他各项资产 | 4,459,779.75 | 0.28 |
| 8 | 合计 | 1,619,782,954.81 | 100.00 |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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 | - | - |
| C | 制造业 | 7,046,750.93 | 0.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,002,328.20 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 222,304.44 | 0.01 |
| 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 | 2,588,208.18 | 0.16 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| M | 科学研究和技术服务业 | 109,392.21 | 0.01 |
| 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 | 10,968,983.96 | 0.68 |

**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 | 600418 | 江淮汽车 | 210,000 | 3,063,900.00 | 0.19 |
| 2 | 000650 | 仁和药业 | 200,000 | 2,114,000.00 | 0.13 |
| 3 | 603508 | 思维列控 | 14,605 | 1,136,853.20 | 0.07 |
| 4 | 300496 | 中科创达 | 6,560 | 918,465.60 | 0.06 |
| 5 | 002781 | 奇信股份 | 21,600 | 807,192.00 | 0.05 |
| 6 | 603996 | 中新科技 | 16,729 | 494,174.66 | 0.03 |
| 7 | 300493 | 润欣科技 | 7,248 | 299,632.32 | 0.02 |
| 8 | 002782 | 可立克 | 13,312 | 283,146.24 | 0.02 |
| 9 | 002786 | 银宝山新 | 9,630 | 263,476.80 | 0.02 |
| 10 | 300497 | 富祥股份 | 5,523 | 237,654.69 | 0.01 |
| 11 | 002780 | 三夫户外 | 3,566 | 222,304.44 | 0.01 |
| 12 | 603778 | 乾景园林 | 7,140 | 195,136.20 | 0.01 |
| 13 | 002787 | 华源包装 | 10,011 | 163,880.07 | 0.01 |
| 14 | 300494 | 盛天网络 | 6,251 | 162,901.06 | 0.01 |
| 15 | 603299 | 井神股份 | 23,499 | 124,779.69 | 0.01 |
| 16 | 300492 | 山鼎设计 | 6,219 | 109,392.21 | 0.01 |
| 17 | 300490 | 华自科技 | 7,127 | 93,292.43 | 0.01 |
| 18 | 300491 | 通合科技 | 6,015 | 90,766.35 | 0.01 |
| 19 | 002777 | 久远银海 | 4,264 | 70,356.00 | - |
| 20 | 002785 | 万里石 | 12,000 | 70,080.00 | - |
| 21 | 002778 | 高科石化 | 5,600 | 47,600.00 | - |

**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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 31,777,826.00 | 1.97 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,907,500.00 | 1.17 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 16,821,716.95 | 1.04 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 4 | 000100 | TCL 集团 | 16,344,958.00 | 1.01 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 12,249,613.24 | 0.76 |
| 6 | 000623 | 吉林敖东 | 12,044,729.53 | 0.74 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 11,048,133.45 | 0.68 |
| 8 | 600309 | 万华化学 | 9,561,578.00 | 0.59 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 9,358,500.00 | 0.58 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶 | 7,277,457.00 | 0.45 |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 5,763,700.00 | 0.36 |
| 12 | 000063 | 中兴通讯 | 5,573,069.40 | 0.34 |
| 13 | 600795 | 国电电力 | 5,227,053.00 | 0.32 |
| 14 | 600418 | 江淮汽车 | 5,128,920.00 | 0.32 |
| 15 | 600583 | 海油工程 | 5,105,400.00 | 0.32 |
| 16 | 600642 | 申能股份 | 5,030,956.50 | 0.31 |
| 17 | 000776 | 广发证券 | 3,843,772.00 | 0.24 |
| 18 | 000883 | 湖北能源 | 3,347,000.00 | 0.21 |
| 19 | 000592 | 平潭发展 | 2,330,309.00 | 0.14 |
| 20 | 601989 | 中国重工 | 2,280,000.00 | 0.14 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 31,801,539.00 | 1.97 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 18,895,500.00 | 1.17 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 16,882,180.46 | 1.04 |
| 4 | 000100 | TCL 集团 | 16,474,210.00 | 1.02 |
| 5 | 000623 | 吉林敖东 | 12,096,813.00 | 0.75 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 11,998,759.40 | 0.74 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 10,165,918.57 | 0.63 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 9,350,000.00 | 0.58 |
| 9 | 600309 | 万华化学 | 8,889,706.07 | 0.55 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶 | 7,426,368.00 | 0.46 |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 5,782,000.00 | 0.36 |
| 12 | 000063 | 中兴通讯 | 5,593,893.00 | 0.35 |
| 13 | 600795 | 国电电力 | 5,173,900.00 | 0.32 |
| 14 | 600583 | 海油工程 | 5,055,000.00 | 0.31 |
| 15 | 600642 | 申能股份 | 4,978,323.25 | 0.31 |
| 16 | 000776 | 广发证券 | 3,755,813.00 | 0.23 |
| 17 | 000883 | 湖北能源 | 3,360,165.74 | 0.21 |
| 18 | 000592 | 平潭发展 | 2,299,557.00 | 0.14 |
| 19 | 601989 | 中国重工 | 2,115,004.00 | 0.13 |
| 20 | 600418 | 江淮汽车 | 1,655,755.60 | 0.10 |

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 | 198,986,229.25 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 193,330,962.41 |

## 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 | 98,800,000.00 | 6.11 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 5,107,651.60 | 0.32 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 1,829,225.00 | 0.11 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 105,736,876.60 | 6.54 |

## 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 | 020081 | 15 贴债 07 | 1,000,000 | 98,800,000.00 | 6.11 |
| 2 | 132005 | 15 国资 EB | 10,000 | 1,149,400.00 | 0.07 |
| 3 | 112232 | 14 长证债 | 10,000 | 1,053,600.00 | 0.07 |
| 4 | 122310 | 13 苏新城 | 8,000 | 917,200.00 | 0.06 |
| 5 | 122607 | PR 渝地产 | 10,000 | 860,300.00 | 0.05 |

## 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** 长江证券于 2015 年 6 月 12 日发布公告,公司因未与部分研究报告转载机构签订协议,违反了《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28 号)第二十一条的相关规定,公司部分研究报告的报送审核人员和对外发送渠道不符合公司内部规定,公司内控制度执行不严格,未能及时识别和防范业务风险,故收到证监会出示警示函的行政监管措施。对 14 长证债的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,我们认为,上述处罚事项对长江证券的现金流状况和盈利能力影响较小,公司的信用资质不会因此出现明显恶化,在债券存续期内未对本期债券的投资价值产生实质性影响。此外,信诚新鑫回报混合基金对于 14 长江债的投资权重仅为 0.06%,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。

**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 | 126,141.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,640,876.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,682,850.63 |
| 5 | 应收申购款 | 9,911.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,459,779.75 |

**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 | 420 | 18,877.65 | 4,278,887.30 | 53.97% | 3,649,724.77 | 46.03% |
| 信诚新鑫混合 B | 29 | 55,192,499.40 | 1,600,000,000.00 | 99.96% | 582,482.59 | 0.04% |
| 合计 | 449 | 3,582,430.05 | 1,604,278,887.30 | 99.74% | 4,232,207.36 | 0.26% |

## 9.2 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 | 59,393.43 | 0.75% |
| | 信诚新鑫混合 B | - | - |
| | 合计 | 59,393.43 | - |

## 9.3 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

| 项目 | 份额级别 | 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 | 信诚新鑫混合 A | - |
| | 信诚新鑫混合 B | - |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 信诚新鑫混合 A | - |
| | 信诚新鑫混合 B | - |
| | 合计 | 0~10 |

# §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 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 38,837,536.57 | 2,500,582,482.59 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,232,481,354.63 | 900,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,928,612.07 | 1,600,582,482.59 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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第二届董事会第 48 次会议审议通过,聘任吕涛先生担任信诚基金总经理职务。本基金管理人已于 2015 年 4 月 3 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总经理任职的公告》。自新任总经理任职之日起,本公司董事长张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部和上海证监局报告。

经信诚基金管理有限公司董事会审议通过,解聘林军女士信诚基金副总经理职务,同时聘任唐世春先生担任公司副总经理,不再担任督察长职务。在新任督察长任职之前,代为履行督察长职务。本基金管理人已于 2015 年 6 月 30 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监督管理委员会证券基金机构监管部、中国证券投资基金业协会和上海证监局报备。

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第五十三次会议审议通过,聘任周浩先生担任公司督察长职务。自新任督察长任职之日起,本公司副总经理唐世春先生不再代为履行督察长职务。本基金管理人已于 2015 年 9 月 26 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监督委员会证券基金机构监管部、上海证监局和中国证券投资基金业协会报备。

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 133,000 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

本基金管理人于 2015 年 7 月 29 日收到上海证监局《关于对信诚基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》(以下简称“整改决定书”)。公司领导高度重视,针对整改决定书指出的问题,公司认真落实整改要求,加强制度和风控措施,进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力,并已按要求向上海证监局提交了整改报告。除上述情况外,报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无

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 | 389,195,926.48 | 100.00% | 358,178.97 | 100.00% | 本期新增 |
| 中投证券 | 2 | - | - | - | - | 本期新增 |

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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 |
| 安信证券 | 134,266,159.74 | 100.00% | 3,145,500,000.00 | 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 | 信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com) | 2015-06-30 |
| 2 | 信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务的公告 | 同上 | 2015-07-01 |
| 3 | 信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2015 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告 | 同上 | 2015-07-01 |
| 4 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构及申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-07-20 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5 | 关于信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-07-27 |
| 6 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告 | 同上 | 2015-08-22 |
| 7 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天天基金费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-08-25 |
| 8 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰资产为销售机构及申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-08-28 |
| 9 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加同花顺为销售机构及申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-08-28 |
| 10 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加积木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 | 2015-10-20 |
| 11 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米财富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-10-23 |
| 12 | 信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第三季度报告 | 同上 | 2015-10-24 |
| 13 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-10-30 |
| 14 | 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 | 同上 | 2015-11-14 |
| 15 | 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 | 2015-11-14 |
| 16 | 信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入业务的公告 | 同上 | 2015-11-17 |
| 17 | 信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加积木基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015-11-21 |
| 18 | 信诚基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金调整开放时间的公告 | 同上 | 2015-12-31 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

注:根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规及《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,为更好的满足广大投资人的理财要求,本基金管理人经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,决定于 2015 年 11 月 16 日起对本基金增加收取销售服务费的 B 类份额(基金代码:002047),并对本基金的基金合同作相应修改。详见本基金管理人于 2015 年 11 月 14 日发布的公告。

## §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。

信诚基金管理有限公司

2016 年 3 月 25 日