

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2016年半年度报告

2016年6月30日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2016年8月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	13
§ 7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	26
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	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	29
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	30
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	31
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	31
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	31
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	31
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	31
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	31
7.12 投资组合报告附注	31
§ 8 基金份额持有人信息	32
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	32
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	32
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	32
§ 9 开放式基金份额变动	33
§ 10 重大事件揭示	33
10.1 基金份额持有人大会决议	33
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	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	33
10.4 基金投资策略的改变	33
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	33
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	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
10.8 其他重大事件	34
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	35
§ 12 备查文件目录	35
12.1 备查文件名称	35
12.2 备查文件存放地点	35
12.3 备查文件查阅方式	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信诚新旺混合(LOF)	
场内简称	信诚新旺	
基金主代码	165526	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月19日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	486,825,446.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚新旺混合A	信诚新旺混合C
下属分级基金的场内简称	信诚新旺	-
下属分级基金的交易代码	165526	165527
报告期末下属分级基金的份额总额	101,417,856.83份	385,407,589.48份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	信诚基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 周浩	汤嵩彦

	联系电话	021-68649788	95559
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-666-0066	95559
传真		021-50120888	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路188号
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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		张翔燕	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
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

§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(2016年1月1日至2016年6月30日)	
	信诚新旺混合 A	信诚新旺混合 C
本期已实现收益	4,526,575.51	4,475,149.55
本期利润	3,685,250.42	4,555,506.95
加权平均基金份额本期利润	0.0240	0.0165
本期加权平均净值利润率	2.38%	1.64%
本期基金份额净值增长率	1.79%	1.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	2,350,420.16	6,226,236.71
期末可供分配基金份额利润	0.0232	0.0162
期末基金资产净值	103,768,276.99	392,840,719.21
期末基金份额净值	1.023	1.019
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.30%	1.90%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚新旺混合 A

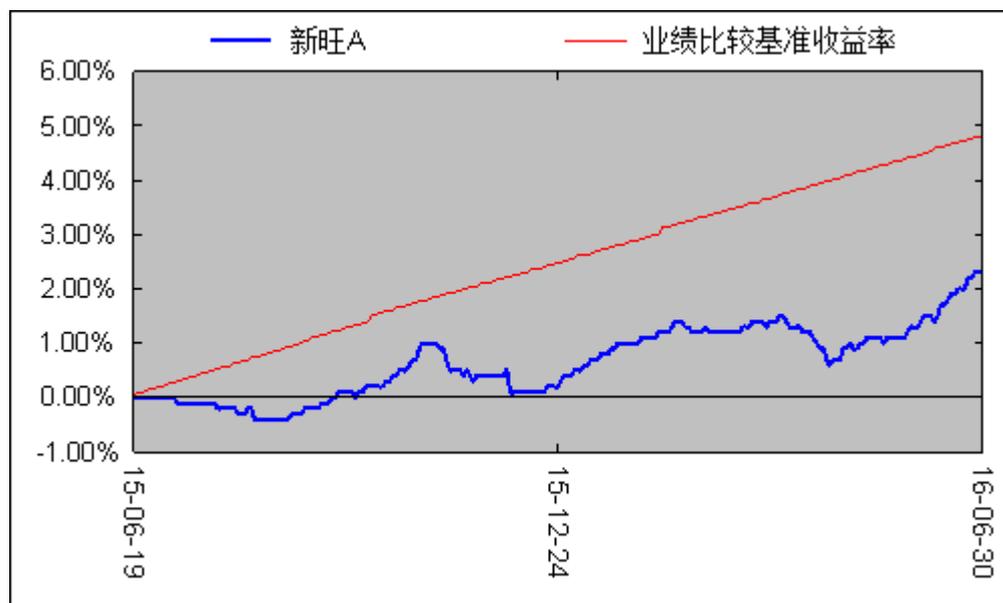
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.99%	0.07%	0.37%	0.01%	0.62%	0.06%
过去三个月	0.89%	0.08%	1.12%	0.01%	-0.23%	0.07%
过去六个月	1.79%	0.07%	2.24%	0.01%	-0.45%	0.06%
过去一年	2.30%	0.07%	4.63%	0.01%	-2.33%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.07%	4.80%	0.01%	-2.50%	0.06%

信诚新旺混合 C

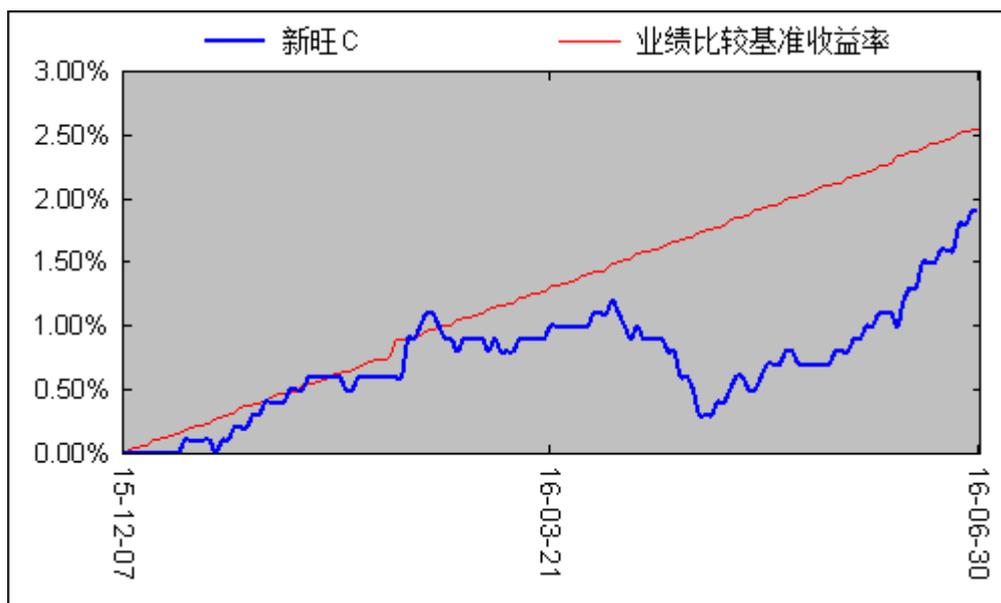
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.99%	0.08%	0.37%	0.01%	0.62%	0.07%
过去三个月	0.79%	0.08%	1.12%	0.01%	-0.33%	0.07%
过去六个月	1.70%	0.08%	2.24%	0.01%	-0.54%	0.07%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.07%	2.55%	0.01%	-0.65%	0.06%

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

信诚新旺混合 A



信诚新旺混合 C



注：1. 本基金于2015年12月7日起新增C类份额。

2. 本基金建仓期自2015年6月19日至2015年12月19日，建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于2005年9月30日正式成立，注册资本2亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2016年6月30日，本基金管理人共管理40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型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数分级证券投资基金、信诚惠报债券型证券投资基金和信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨旭	本基金基金经理, 兼任信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理	2015 年 6 月 19 日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金 Robust methods 公司数量分析师, 华尔街对冲基金 WSFA Group 公司助理基金经理, 该基金为股票多空型对冲基金。2012 年 8 月加入信诚基金, 曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理。

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《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内, 未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

金融市场上,上半年国内低风险金融产品收益率不断下降,信托计划、银行理财产品、债券等收益率逐步下行;同时,债券违约等金融市场风险事件频发。收益率下滑和风险事件频发证实了“资产荒”预期。海外市场,6月份英国脱欧公投增加了金融市场的不确定性,虽然全球市场经过短暂动荡后趋于平稳,但未来风险仍然未知。

A股市场经历了熔断后的快速下跌,随着紧急暂停“熔断”,之后逐步企稳,投资者信心逐步恢复,但鉴于周边市场未来不确定性仍然较大,经济运行将长期“L”型,调结构中风险事件发生的可能性比较大。后续基金仍将坚持稳健操作的策略。一方面,未来“资产荒”的大环境下,随着风险资产的风险被证实、低风险(或无风险)产品收益率的下降、以及部分题材炒作逐步被证伪,低估值盈利稳定或低估值盈利稳定增长的股票资产的价值可能被市场逐步认可。

股票投资方面,基金会配置低估值盈利稳定分红主题的蓝筹股、或低估值盈利稳健增长分红主题的蓝筹股,同时积极参与新股申购,获取稳健收益。债券投资方面,鉴于未来仍有可能发生信用风险事件,债券仍坚持短久期、高信用评级策略,以规避信用风险和利率风险。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金A、C份额净值增长率分别为1.79%和1.70%,同期业绩比较基准收益率为2.24%,基金A、C份额分别落后业绩比较基准0.45%和0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场格局并没有发生变化,核心矛盾依旧是美联储开始收缩使资本回流美国,全球资本再配置,而中国缺乏吸收流动性的实体资产,流动性在资本市场里创造泡沫,从股票到房地产到大宗期货等。核心的不确定性,也就是可能造成趋势的依旧来源于两个,一个是美联储何时开始缩表,另一个来自于国内的经济政策取向。在目前这两个因素都缓和的条件下,市场有博弈行情的基础,但缺乏增量资金,指数上涨空间有限,所以目前谨慎,仍然以反转操作为主。结构上关注的两类策略,一类策略之前一直关注的是风险偏好持续下降,市场结构对低估蓝筹再平衡过程,但市场观点在不断加强,目前已经进入后半段。另外,另一类策略是偏博弈型,远离筹码松动区的交易型策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

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

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

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

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

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值。

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

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1. 《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。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,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;登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3. 每一基金份额享有同等分配权;

4. 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。 本基金于本报告期末进行过利润分配,该处理符合本基金利润分配原则。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016上半年度,基金托管人在信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016上半年度,信诚基金管理有限公司在信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2016上半年度,由信诚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2016年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	5,165,547.06	285,965,268.00
结算备付金		377,410.59	121,500.64
存出保证金		240,443.12	18,921.02
交易性金融资产	6.4.7.2	456,139,708.35	218,063,692.43
其中: 股票投资		22,364,803.55	4,220,327.73
基金投资		-	-
债券投资		433,774,904.80	213,843,364.70
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	30,000,000.00	318,500,420.00
应收证券清算款		60,544.35	-
应收利息	6.4.7.5	5,236,672.24	2,775,155.61
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		497,220,325.71	825,444,957.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,020.64	-
应付管理人报酬		221,652.64	768,366.07
应付托管费		73,884.21	256,122.01
应付销售服务费		28,491.32	20,739.58
应付交易费用	6.4.7.7	31,293.26	729,413.33
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	253,987.44	270,000.00
负债合计		611,329.51	2,044,640.99
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	486,825,446.31	820,537,325.01
未分配利润	6.4.7.10	9,783,549.89	2,862,991.70

所有者权益合计		496,608,996.20	823,400,316.71
负债和所有者权益总计		497,220,325.71	825,444,957.70

注：1、截止本报告期末，基金份额总额 486,825,446.31 份。下属两级基金：信诚新旺混合 A 的份额净值 1.023 元，基金份额总额 101,417,856.83 份；信诚新旺混合 C 的基金份额净值 1.019 元，基金份额总额为 385,407,589.48 份。

2、本基金合同自 2015 年 6 月 19 日起生效。上年度可比期间自 2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月19日(基金合同 生效日)至2015年6月30日
一、收入		10,593,105.70	30,158.73
1. 利息收入		5,453,158.56	74,607.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	396,032.09	36,432.14
债券利息收入		4,558,512.25	7,870.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		498,614.22	30,304.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,408,442.86	9.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,903,251.44	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-866,966.52	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	372,157.94	9.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-760,967.69	-44,458.50
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	492,471.97	-
减：二、费用		2,352,348.33	65,931.18
1. 管理人报酬		1,299,723.99	37,032.20
2. 托管费		433,241.31	12,344.06
3. 销售服务费		139,759.99	-
4. 交易费用	6.4.7.19	84,744.68	24.44
5. 利息支出		189,890.92	-
其中：卖出回购金融资产支出		189,890.92	-
6. 其他费用	6.4.7.20	204,987.44	16,530.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,240,757.37	-35,772.45

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,240,757.37	-35,772.45

注：本基金合同自2015年6月19日起生效。上年度可比期间自2015年6月19日（基金合同生效日）至2015年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	820,537,325.01	2,862,991.70	823,400,316.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,240,757.37	8,240,757.37
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）	-333,711,878.70	-1,320,199.18	-335,032,077.88
其中：1. 基金申购款	494,504,414.22	5,684,617.76	500,189,031.98
2. 基金赎回款	-828,216,292.92	-7,004,816.94	-835,221,109.86
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）	486,825,446.31	9,783,549.89	496,608,996.20
项目	上年度可比期间 2015年6月19日（基金合同生效日）至2015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）	204,824,716.99	-	204,824,716.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-35,772.45	-35,772.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	204,824,716.99	-35,772.45	204,788,944.54

注：本基金合同自2015年6月19日起生效。上年度可比期间自2015年6月19日（基金合同生效日）至2015年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

吕涛

陈逸辛

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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”)《关于准予信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》(证监许可[2015]987号文)和《关于信诚新旺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]1903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《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》发售,基金合同于2015年6月19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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金于2015年6月15日至2015年6月16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204,815,464.79元,利息人民币9,252.20元,共计人民币204,824,716.99元。上述认购资金折合204,824,716.99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788号验资报告。

根据《关于信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加C类份额并修改基金合同的公告》,自2015年12月7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C类基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回A类份额;可通过场外渠道申购与赎回C类份额。本基金A类基金份额参与上市交易,C类基金份额不参与上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于2012年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	5,165,547.06
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	5,165,547.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,088,574.57	22,364,803.55	1,276,228.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	154,753,375.17	-423,470.37
	银行间市场	279,128,351.68	316,648.32
	合计	433,881,726.85	-106,822.05
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	454,970,301.42	456,139,708.35	1,169,406.93

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	30,000,000.00	-
合计	30,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	4,028.28
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	152.91
应收债券利息	5,207,592.68
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	24,800.99
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	97.38
合计	5,236,672.24

注：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应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	24,471.08
银行间市场应付交易费用	6,822.18
合计	31,293.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	34,809.32
预提信息披露费	219,178.12
合计	253,987.44

6.4.7.9 实收基金

信诚新旺混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	491,537,325.01	491,537,325.01
本期申购	185,933.65	185,933.65
本期赎回(以“-”号填列)	-390,305,401.83	-390,305,401.83
本期末	101,417,856.83	101,417,856.83

信诚新旺混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	329,000,000.00	329,000,000.00
本期申购	494,318,480.57	494,318,480.57
本期赎回(以“-”号填列)	-437,910,891.09	-437,910,891.09
本期末	385,407,589.48	385,407,589.48

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

信诚新旺混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,943,873.89	-3,577,718.41	2,366,155.48
本期利润	4,526,575.51	-841,325.09	3,685,250.42
本期基金份额交易产生的变动数	-7,511,968.25	3,810,982.51	-3,700,985.74

其中：基金申购款	5,022.75	-1,924.22	3,098.53
基金赎回款	-7,516,991.00	3,812,906.73	-3,704,084.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,958,481.15	-608,060.99	2,350,420.16

信诚新旺混合 C

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	-117,269.14	614,105.36	496,836.22
本期利润	4,475,149.55	80,357.40	4,555,506.95
本期基金份额交易产生的变动数	1,868,356.30	512,430.26	2,380,786.56
其中：基金申购款	6,364,949.08	-683,429.85	5,681,519.23
基金赎回款	-4,496,592.78	1,195,860.11	-3,300,732.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,226,236.71	1,206,893.02	7,433,129.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	296,669.98
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	46,666.67
结算备付金利息收入	25,848.92
其他	26,846.52
合计	396,032.09

注：1. 其他存款利息收入指有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款利息收入。

2. 其他指申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	22,645,604.51
减：卖出股票成本总额	16,742,353.07
买卖股票差价收入	5,903,251.44

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-866,966.52
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	-866,966.52

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	273,391,529.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	270,537,956.59
减：应收利息总额	3,720,539.39
买卖债券差价收入	-866,966.52

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	372,157.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	372,157.94

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-760,967.69
——股票投资	-410,524.54
——债券投资	-350,443.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-760,967.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	492,471.97

合计	492,471.97
----	------------

注:本基金赎回费和转换费的 25%归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	81,269.68
银行间市场交易费用	3,475.00
合计	84,744.68

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	149,178.12
银行费用	3,000.00
债券帐户维护费	18,000.00
合计	204,987.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末,本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,299,723.99	37,032.20
其中:支付销售机构的客户维护费	2,137.73	399.74

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值

×0.60%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	433,241.31	12,344.06

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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		
	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		
	信诚新旺混合A	信诚新旺混合C	合计
交通银行	-	-	-
信诚基金管理有限公司	-	139,759.99	139,759.99
合计	-	139,759.99	139,759.99

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的年销售服务费率为0.1%。C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.1%年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：C类基金日销售服务费=C类基金份额前一日资产净值×0.1%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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报告期及上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金的其它关联方在本报告期末及上年度末未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,165,547.06	296,669.98	76,601,510.01	36,422.96

注：本基金通过“中国交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于本报告期末的相关余额为人民币377,410.59元。(2015年6月30日余额为0.00元。)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2016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
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股申购	12.98	12.98	4,174	54,178.52	54,178.52	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股申购	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股申购	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股申购	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016-06-15	2016-07-01	新债申购	100.00	100.00	2,390	239,000.00	239,000.00	-

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
601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	17,798	61,759.06	372,334.16	-
000002	万科A	2015-12-18	筹划重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	16,200	304,899.95	294,840.00	-
002249	大洋电机	2016-06-08	筹划重大事项	11.97	2016-07-28	10.77	20,000	192,406.95	239,400.00	-
002065	东华软件	2015-12-21	筹划重大事项	18.72	2016-07-04	22.59	2,900	64,954.77	54,288.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风

风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行,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,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理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。

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对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。此外,对于基金投资的股指期货等场内金融衍生品,管理人会对衍生品的流动性、交割日等予以关注。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不付息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息,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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金投资的交易所市场及银行间市场交易的固定收益证券,存在一定的利率风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,165,547.06	-	-	-	-	-	5,165,547.06
结算备付金	377,410.59	-	-	-	-	-	377,410.59
存出保证金	240,443.12	-	-	-	-	-	240,443.12
交易性金融资产	33,487,469.50	29,754,000.00	152,017,760.00	178,400,675.30	40,115,000.00	22,364,803.55	456,139,708.35
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	60,544.35	60,544.35
应收利息	-	-	-	-	-	5,236,672.24	5,236,672.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	69,270,870.27	29,754,000.00	152,017,760.00	178,400,675.30	40,115,000.00	27,662,020.14	497,220,325.71
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,020.64	2,020.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	221,652.64	221,652.64
应付托管费	-	-	-	-	-	73,884.21	73,884.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,491.32	28,491.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,293.26	31,293.26
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	253,987.44	253,987.44
负债总计	-	-	-	-	-	611,329.51	611,329.51
利率敏感度缺口	69,270,870.27	29,754,000.00	152,017,760.00	178,400,675.30	40,115,000.00	27,050,690.63	496,608,996.20
上年度末 2015年12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	285,965,268.00	-	-	-	-	-	285,965,268.00
结算备付金	121,500.64	-	-	-	-	-	121,500.64
存出保证金	18,921.02	-	-	-	-	-	18,921.02
交易性金融资产	-	4,043,348.00	146,661,093.90	62,693,122.80	445,800.00	4,220,327.73	218,063,692.43
买入返售金融资产	318,500,420.00	-	-	-	-	-	318,500,420.00

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,775,155.61	2,775,155.61
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	604,606,109.66	4,043,348.00	146,661,093.90	62,693,122.80	445,800.00	6,995,483.34	825,444,957.70
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	768,366.07	768,366.07
应付托管费	-	-	-	-	-	256,122.01	256,122.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,739.58	20,739.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	729,413.33	729,413.33
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	270,000.00	270,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,044,640.99	2,044,640.99
利率敏感度缺口	604,606,109.66	4,043,348.00	146,661,093.90	62,693,122.80	445,800.00	4,950,842.35	823,400,316.71

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降25个基点	2,120,818.42	672,889.17
	市场利率上升25个基点	-2,096,090.00	-668,097.58

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产-股票投资	22,364,803.55	4.50	4,220,327.73	0.51
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	22,364,803.55	4.50	4,220,327.73	0.51

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末,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。

6.4.14 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。

§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	22,364,803.55	4.50
	其中:股票	22,364,803.55	4.50
2	固定收益投资	433,774,904.80	87.24
	其中:债券	433,774,904.80	87.24
	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	30,000,000.00	6.03
	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	5,542,957.65	1.11
7	其他各项资产	5,537,659.71	1.11
8	合计	497,220,325.71	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,199,763.79	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	665,346.00	0.13
E	建筑业	372,334.16	0.07
F	批发和零售业	40,467.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,701,791.00	0.34

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,780.40	0.03
J	金融业	7,604,391.10	1.53
K	房地产业	446,530.00	0.09
L	租赁和商务服务业	312,975.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	-
N	水利、环境和公共设施管理业	485,212.00	0.10
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	391,087.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	22,364,803.55	4.50

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	242,400	1,151,400.00	0.23
2	601288	农业银行	297,100	950,720.00	0.19
3	601398	工商银行	209,900	931,956.00	0.19
4	601988	中国银行	285,500	916,455.00	0.18
5	000858	五粮液	27,600	897,828.00	0.18
6	002142	宁波银行	58,300	861,674.00	0.17
7	000568	泸州老窖	21,400	635,580.00	0.13
8	600887	伊利股份	36,800	613,456.00	0.12
9	000538	云南白药	9,300	597,990.00	0.12
10	000423	东阿阿胶	10,900	575,847.00	0.12
11	000333	美的集团	22,600	536,072.00	0.11
12	600377	宁沪高速	59,800	498,732.00	0.10
13	600018	上港集团	97,200	495,720.00	0.10
14	002304	洋河股份	6,800	489,056.00	0.10
15	000888	峨眉山A	40,300	485,212.00	0.10
16	601318	中国平安	15,100	483,804.00	0.10
17	002242	九阳股份	26,300	478,134.00	0.10
18	600004	白云机场	37,500	459,750.00	0.09
19	600021	上海电力	44,200	453,934.00	0.09
20	002202	金风科技	29,100	440,283.00	0.09
21	000100	TCL集团	119,700	393,813.00	0.08
22	002508	老板电器	10,700	393,439.00	0.08
23	002275	桂林三金	21,200	391,352.00	0.08

24	300144	宋城演艺	15,700	391,087.00	0.08
25	000513	丽珠集团	8,400	387,324.00	0.08
26	601611	中国核建	17,798	372,334.16	0.07
27	000876	新希望	43,200	359,424.00	0.07
28	002344	海宁皮城	32,100	312,975.00	0.06
29	002056	横店东磁	17,800	302,600.00	0.06
30	600015	华夏银行	30,500	301,645.00	0.06
31	002646	青青稞酒	14,400	296,784.00	0.06
32	000002	万科A	16,200	294,840.00	0.06
33	601169	北京银行	28,200	292,434.00	0.06
34	601818	光大银行	77,600	291,776.00	0.06
35	000400	许继电气	18,800	290,272.00	0.06
36	601166	兴业银行	19,000	289,560.00	0.06
37	600036	招商银行	16,400	287,000.00	0.06
38	601009	南京银行	30,480	286,207.20	0.06
39	002557	洽洽食品	15,300	285,192.00	0.06
40	600016	民生银行	31,700	283,081.00	0.06
41	600000	浦发银行	17,770	276,678.90	0.06
42	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.05
43	002249	大洋电机	20,000	239,400.00	0.05
44	000828	东莞控股	21,900	198,852.00	0.04
45	601127	小康股份	7,003	167,161.61	0.03
46	600066	宇通客车	8,000	158,400.00	0.03
47	600642	申能股份	27,100	155,554.00	0.03
48	000848	承德露露	13,000	155,350.00	0.03
49	600612	老凤祥	3,800	155,230.00	0.03
50	600660	福耀玻璃	11,000	154,000.00	0.03
51	600177	雅戈尔	11,000	151,690.00	0.03
52	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
53	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
54	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
55	600519	贵州茅台	200	58,384.00	0.01
56	002065	东华软件	2,900	54,288.00	0.01
57	601966	玲珑轮胎	4,174	54,178.52	0.01
58	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
59	600900	长江电力	3,700	46,213.00	0.01
60	600276	恒瑞医药	900	36,099.00	0.01
61	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
62	600585	海螺水泥	1,800	26,172.00	0.01
63	600089	特变电工	2,900	24,708.00	-
64	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	-

65	600085	同仁堂	800	23,832.00	-
66	600436	片仔癀	500	22,505.00	-
67	600009	上海机场	800	20,840.00	-
68	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	-
69	600655	豫园商城	1,500	16,260.00	-
70	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	-
71	600809	山西汾酒	600	13,308.00	-
72	600717	天津港	1,500	13,035.00	-
73	600183	生益科技	1,400	12,978.00	-
74	600993	马应龙	600	12,498.00	-
75	600337	美克家居	900	11,709.00	-
76	600761	安徽合力	1,000	10,090.00	-
77	601158	重庆水务	1,500	9,645.00	-
78	300520	科大国创	926	9,306.30	-
79	600012	皖通高速	600	8,574.00	-
80	600897	厦门空港	300	6,288.00	-
81	002805	丰元股份	971	5,631.80	-

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	601939	建设银行	1,574,766.00	0.19
2	000858	五粮液	1,371,800.00	0.17
3	000568	泸州老窖	1,359,351.46	0.17
4	601988	中国银行	1,277,178.00	0.16
5	601288	农业银行	1,256,444.00	0.15
6	601398	工商银行	1,228,076.55	0.15
7	002142	宁波银行	808,834.00	0.10
8	600887	伊利股份	614,654.00	0.07
9	000538	云南白药	585,259.00	0.07
10	000423	东阿阿胶	579,016.00	0.07
11	600018	上港集团	572,209.00	0.07
12	600377	宁沪高速	568,311.00	0.07
13	601318	中国平安	564,568.00	0.07
14	600004	白云机场	560,351.00	0.07
15	600021	上海电力	550,247.00	0.07
16	300267	尔康制药	519,648.00	0.06
17	000888	峨眉山 A	479,271.00	0.06
18	002242	九阳股份	474,052.00	0.06
19	000540	中天城投	473,520.00	0.06
20	002041	登海种业	473,429.60	0.06

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002781	奇信股份	1,206,387.70	0.15
2	000568	泸州老窖	967,701.00	0.12
3	603996	中新科技	801,783.80	0.10
4	000858	五粮液	677,099.00	0.08
5	300494	盛天网络	612,598.00	0.07
6	002782	可立克	537,804.80	0.07
7	300267	尔康制药	533,287.00	0.06
8	002041	登海种业	507,891.00	0.06
9	603778	乾景园林	495,532.00	0.06
10	002786	银宝山新	494,924.70	0.06
11	603299	井神股份	423,331.90	0.05
12	000540	中天城投	414,805.00	0.05
13	601688	华泰证券	409,283.00	0.05
14	601601	中国太保	395,820.00	0.05
15	600104	上汽集团	391,489.00	0.05
16	601939	建设银行	381,257.00	0.05
17	002787	华源包装	381,052.68	0.05
18	601006	大秦铁路	358,574.00	0.04
19	600048	保利地产	350,413.00	0.04
20	002785	万里石	342,000.00	0.04

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

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	35,297,353.43
卖出股票收入(成交)总额	22,645,604.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,758,000.00	22.10
	其中：政策性金融债	109,758,000.00	22.10
4	企业债券	153,359,360.80	30.88
5	企业短期融资券	140,190,000.00	28.23
6	中期票据	-	-
7	可转债	970,544.00	0.20
8	同业存单	29,497,000.00	5.94

9	其他	-	-
10	合计	433,774,904.80	87.35

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	160402	16 农发 02	400,000	39,888,000.00	8.03
2	160207	16 国开 07	400,000	39,876,000.00	8.03
3	136067	15 洪市政	300,000	30,495,000.00	6.14
4	136448	16 万达 03	300,000	30,315,000.00	6.10
5	011599840	15 昆山经开 SCP011	300,000	30,135,000.00	6.07

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 农业银行于 2016 年 1 月 23 日发布公告,农业银行北京分行票据买入返售业务发生重大风险事件,经核查,涉及风险金额为 39.15 亿元。公安机关已立案调查。

7.12.2 对农业银行的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,该处罚事项未对农业银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。

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

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

7.12.5 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	240,443.12

2	应收证券清算款	60,544.35
3	应收股利	-
4	应收利息	5,236,672.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,537,659.71

7.12.6 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。

7.12.7 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情况。

7.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
信诚新旺混合A	317	319,930.15	100,000,000.00	98.60%	1,417,856.83	1.40%
信诚新旺混合C	7	55,058,227.07	385,407,589.48	100.00%	-	-
合计	324	1,502,547.67	485,407,589.48	99.71%	1,417,856.83	0.29%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金的基金份额。

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

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	信诚新旺混合A	0
	信诚新旺混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚新旺混合A	0
	信诚新旺混合C	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和相关部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚新旺混合 A	信诚新旺混合 C
基金合同生效日(2015年6月19日)基金份额总额	204,824,716.99	-
本报告期期初基金份额总额	491,537,325.01	329,000,000.00
本报告期基金总申购份额	185,933.65	494,318,480.57
减:本报告期基金总赎回份额	390,305,401.83	437,910,891.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	101,417,856.83	385,407,589.48

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人无重大人事变动。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	46,146,135.20	80.30%	42,645.24	80.52%	-
招商证券	2	11,320,695.94	19.70%	10,316.61	19.48%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易

	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
国金证券	72,654,214.41	40.20%	802,500,000.00	100.00%
招商证券	108,060,963.72	59.80%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金2015年12月31日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2016-01-04
2	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-04
3	信诚基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	同上	2016-01-06
4	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-07
5	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年第四季度报告	同上	2016-01-22
6	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(2016年第1次更新)	同上	2016-02-12
7	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书摘要(2016年第1次更新)	同上	2016-02-01
8	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C类份额暂停申购业务的公告	同上	2016-02-02
9	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C类份额恢复申购业务的公告	同上	2016-03-23
10	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年年度报告	同上	2016-03-25
11	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年年度报告摘要	同上	2016-03-25
12	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C类份额暂停大额申购业务的公告	同上	2016-03-31
13	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2016年第一季度报告	同上	2016-04-21
14	关于信诚基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告20160505	同上	2016-05-05
15	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016-05-31
16	信诚基金管理有限公司关于调整网上直销招商银行直联渠道费率优惠折扣的公告	同上	2016-06-02
17	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C类份额恢复大额申购业务的公告	同上	2016-06-14
18	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银	同上	2016-06-29

	行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告		
19	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构的公告	同上	2016-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

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

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--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。

12.3 备查文件查阅方式

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

信诚基金管理有限公司
2016年8月24日