

## 信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 5 月 24 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 .....	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、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 .....	7
§ 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遵规守信情况的说明 .....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
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 .....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
§ 5	托管人报告 .....	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	13
§ 6	审计报告 .....	13
6.1	审计报告基本信息 .....	13
6.2	审计报告的基本内容 .....	13

§ 7	年度财务报表 .....	14
7.1	资产负债表 .....	14
7.2	利润表 .....	15
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4	报表附注 .....	17
§ 8	投资组合报告 .....	36
8.1	期末基金资产组合情况.....	36
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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 .....	37
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	40
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	41
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
8.12	投资组合报告附注.....	41
§ 9	基金份额持有人信息.....	42
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	43
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	43
§ 10	开放式基金份额变动.....	43
§ 11	重大事件揭示 .....	44
11.1	基金份额持有人大会决议.....	44
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 .....	44
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
11.4	基金投资策略的改变.....	44
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
11.8	其他重大事件.....	44
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§ 13	备查文件目录 .....	49
13.1	备查文件名称.....	49
13.2	备查文件存放地点.....	49
13.3	备查文件查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鼎利定增
场内简称	信诚定增
基金主代码	165528
基金运作方式	契约型基金。基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。
基金合同生效日	2016年5月24日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,216,702,748.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2016年8月31日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信诚基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	郭明
	联系电话	021-68649788	(010) 66105799
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0066	95588
传真		021-50120888	(010) 66105798

注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	张翔燕	易会满

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 05 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,218,331.49
本期利润	12,249,017.91
加权平均基金份额本期利润	0.0101
本期加权平均净值利润率	1.00%
本期基金份额净值增长率	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	1,218,331.49
期末可供分配基金份额利润	0.0010
期末基金资产净值	1,228,951,766.10
期末基金份额净值	1.010
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	1.00%

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2016 年 5 月 24 日。

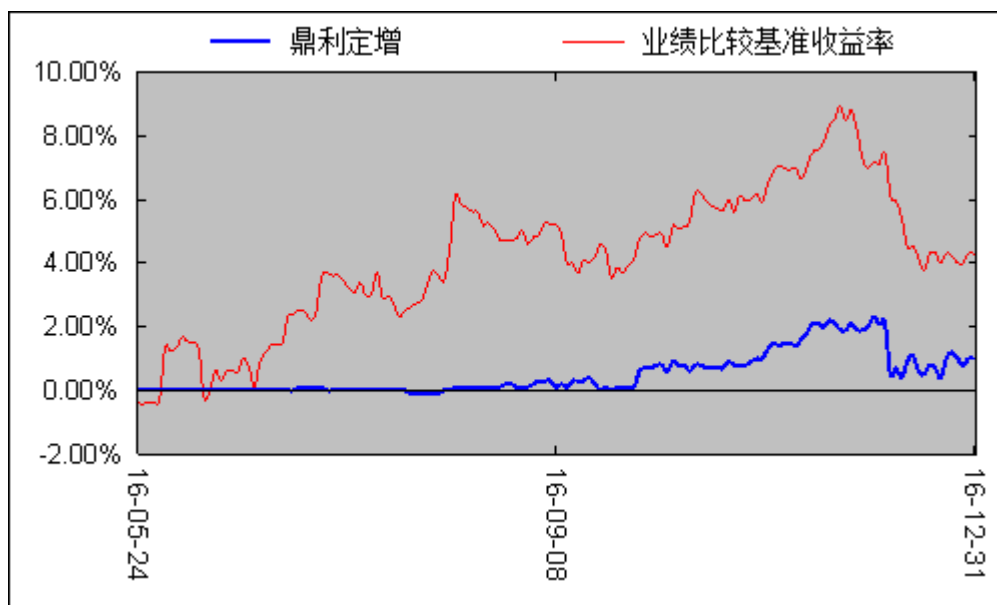
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	0.90%	0.29%	0.19%	0.39%	0.71%	-0.10%
过去六个月	1.00%	0.21%	2.80%	0.39%	-1.80%	-0.18%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.19%	4.30%	0.42%	-3.30%	-0.23%

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

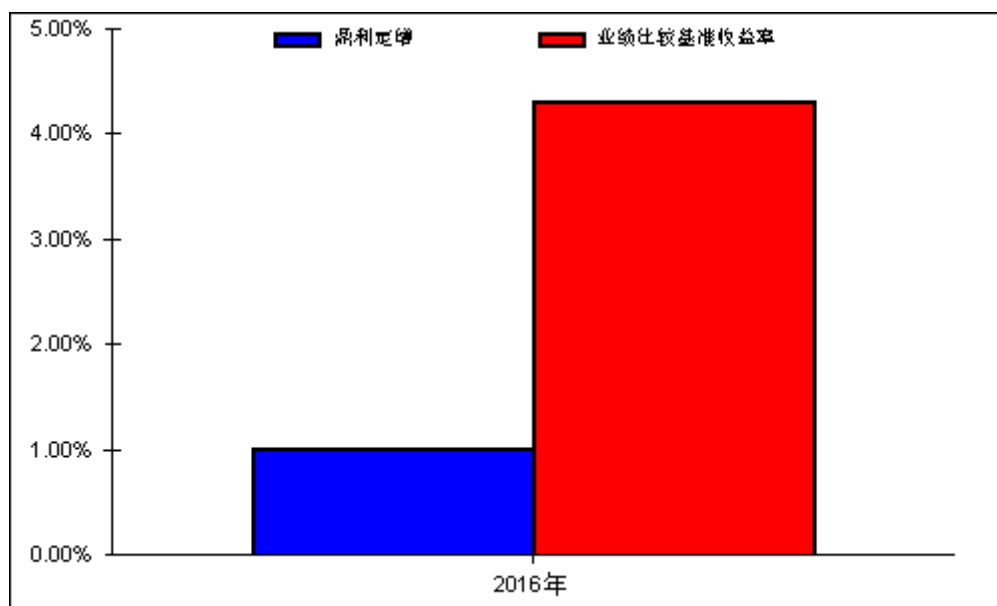
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、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 2016 年 5 月 24 日）。

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

#### 3.2.3 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



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

金额单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	本基金本期末未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近三年未进行利润分配

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 24 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 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 55 只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金 (LOF)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金 (LOF)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚添

金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、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、信诚中证基建工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨旭	本基金基金经理, 兼任信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金及信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信	2016 年 5 月 24 日	-	4	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司, 担任数量分析师; 于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司, 担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入信诚基金, 历任助理投资经理、专户投资经理。现任数量投资副总监, 信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信



	诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金的基金经理				中证智能家居指数分级基金、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金的基金经理。
殷孝东	本基金基金经理, 投资银行部董事总经理	2016 年 12 月 16 日	-	14	曾任职于大鹏证券有限公司, 担任资讯部分析师; 于中信证券股份有限公司, 历任研究部行业首席分析师、研究部执行总经理、研究部运营负责人、投行委能源化工组执行总经理、经发管委执行总经理等职。2016 年 3 月加入信诚基金管理有限公司, 担任投资银行部董事总经理。现兼任信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

回顾 2016 年,年初 A 股市场经历了熔断后的快速下跌,随着紧急暂停“熔断”,之后开始进入了修复行情,二季度投资者信心逐步恢复,上涨的板块比较分散,从券商,计算机,军工到白酒,均缺乏一个持续的领涨板块。整体股票市场整体的情况是存量资金博弈的情况,进入三季度后市场进入均衡市,一方面,资产价格不断升高,从 110 亿“地王”,到 10 年期国债到 2.7,股市再次成为估值相对低的资产,外加“国家队”维稳平抑波动,大幅下跌的动力不足。另一方面,政策以稳为主,缺乏新增资金,做空筹码依然存在,去年入市亏损资金, IPO 加快,要解禁的限售股都使股票上涨动力缺乏。四季度,在政府出房地产政策后, A 股相对于楼市,大宗商品性价比高,资金回流 A 股的资产再配置的逻辑扩散,股市上涨。之后进入 12 月中央经济会议把政策基调弱化增长目标,强调改革与防风险,货币政策更加强调不会宽松,市场形成流动性的拐点的预期而回调。

定增投资是在市场波动中具备低波动绝对价值的投资策略。2016 年本基金坚持稳健操作的策略,在严格控制折价率前提下参与定增投资,共中标定增投资项目 17 个,总中标金额 9.4 亿,平均折价率 86 折,顺利完成了预期投资进度。

#### 4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 1.00%,同期业绩比较基准收益率为 4.30%,基金落后业绩比

较基准 3.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年,对市场判断为行情整体震荡,核心风险因素从国内转向国外,流动性风险预期驱动全年走势。2月17日证监会发布的再融资新政,定增投资有望彻底从“折价套利时代”进入“主动管理时代”。中短期来看,再融资市场规模可能小幅收缩;长期来看,有望加速资本市场再融资主体的优胜劣汰,基本面优质的上市公司和具备主动管理能力的机构投资者将深度受益。目前本基金已经完成定增权益类资产投资的预期目标,未来剩余头寸会积极参与与前期定增破发的优质个股,积极参与新股申购,获取稳健收益,并择机做好。

整体上我们看好两类机会:第一,看好有抗通胀、有需求增量、符合中长期需求趋势的板块,例如消费结构升级,二胎、养老进程启动相关的消费、医疗行业值得关注,大众消费品则需要甄选提价能力显著的标的,特朗普的战略收缩可能为一路一带松绑,建筑、高铁乃至核电的出口局面都有望打开;第二,由于绝对收益账户增多,账户的止损机制催生统计套利的交易机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、对公司规章制度体系不断补充和完善。

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

2、开展各类合规监察工作。

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

3、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

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

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1. 基金估值程序

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

投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

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

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

基金管理人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、在符合有关基金分红条件的前提下,封闭期内,本基金的收益分配每年不得少于一次,且年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的 90%。本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,在符合有关基金分红条件的前提下,本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 25%;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;2、封闭期内,本基金的收益分配方式为现金分红;本基金转为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,登记在登记结算系统的基金份额,收益分配方式为现金分红或红利再投资,登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红;

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

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本报告期未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的

行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

**5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内, 信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的管理人—信诚基金管理有限公司在信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

**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**

本托管人依法对信诚基金管理有限公司编制和披露的信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

**§ 6 审计报告**

**6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20076 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	信诚鼎利定增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鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚鼎利定增混合基金”)的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 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鼎利定增混合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:  (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;  (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

	<p>划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出</p> <p>会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为,上述信诚鼎利定增混合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,公允反映了信诚鼎利定增混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	102,998,999.62
结算备付金		308,619.14
存出保证金		45,884.68

交易性金融资产	7.4.7.2	1,127,245,007.10
其中：股票投资		1,087,285,007.10
基金投资		-
债券投资		39,960,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	768,621.32
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,231,367,131.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,565,041.88
应付托管费		260,840.30
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	154,140.41
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	435,343.17
负债合计		2,415,365.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,216,702,748.19
未分配利润	7.4.7.10	12,249,017.91
所有者权益合计		1,228,951,766.10
负债和所有者权益总计		1,231,367,131.86

注：1、截止本报告期末，基金份额净值 1.010 元，基金份额总额 1,216,702,748.19 份。

2、本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日，无上年度可比期间。

## 7.2 利润表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		26,071,333.87
1. 利息收入		7,231,896.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,324,058.82
债券利息收入		502,124.23
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,405,713.10
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,808,751.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,725,875.73
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	82,875.57
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	11,030,686.42
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	-
<b>减：二、费用</b>		13,822,315.96
1. 管理人报酬		11,073,019.31
2. 托管费		1,845,503.24
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	434,696.35
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	469,097.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,249,017.91
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,249,017.91

注：1、本基金合同自 2016 年 5 月 24 日起生效，本报告期为 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日，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：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
----	--



	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,216,702,748.19	-	1,216,702,748.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,249,017.91	12,249,017.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,216,702,748.19	12,249,017.91	1,228,951,766.10

注：注 1、本基金合同自 2016 年 5 月 24 日起生效，本报告期为 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金生效日为 2016 年 5 月 24 日，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

信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]751 号文)和《关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》(机构部函[2016]1102 号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2016 年 5 月 24 日生效。本基金为契约型基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 5 月 17 日募集,募集的净认购金额 1,216,348,748.86 元,募集期间认购利息转份额 353,999.33 元,募集规模为 1,216,702,748.19 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2016)第 490 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允

许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。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的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的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财务报表附注 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 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 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

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;其他金融资产划分为贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外,以公允价值计量且其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。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。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为: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。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

初始确认后,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

#### -应收款项

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。

初始确认后,应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

#### -其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

初始确认后,采用实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时,考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等),并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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。

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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。

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。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;
- 本基金计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未

分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量,并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时,予以确认。

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,封闭期内,本基金的收益分配每年不得少于一次,且年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的 90%。本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,在符合有关基金分红条件的前提下,本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 25%;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;2、封闭期内,本基金的收益分配方式为现金分红;本基金转为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,登记在登记结算系统的基金份额,收益分配方式为现金分红或红利再投资,登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红;3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;4、同一类别每一基金份额享有同等分配权;5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 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

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票,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》(以下简称“《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的通知》”),若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
活期存款	102,998,999.62
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	102,998,999.62

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,076,298,240.68	1,087,285,007.10	10,986,766.42
贵金属投资-金交所黄金 合约		-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-
	银行间市 场	39,916,080.00	39,960,000.00	43,920.00
	合计	39,916,080.00	39,960,000.00	43,920.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,116,214,320.68	1,127,245,007.10	11,030,686.42

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末，未持有任何买入返售金融资产/负债。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	20,604.29
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	138.90
应收债券利息	747,857.53
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.60
合计	768,621.32

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资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	153,312.79
银行间市场应付交易费用	827.62
合计	154,140.41

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00
其他	35,343.17
合计	435,343.17

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19

**7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,218,331.49	11,030,686.42	12,249,017.91
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,218,331.49	11,030,686.42	12,249,017.91

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月24日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	1,319,978.98
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,992,055.55
结算备付金利息收入	11,854.07
其他	170.22
合计	5,324,058.82

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月24日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	103,305,126.56
减：卖出股票成本总额	95,579,250.83
买卖股票差价收入	7,725,875.73

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月24日(基金合同生效日)至2016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	82,875.57
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	82,875.57

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月24日(基金合同生效日)至2016年12月31日



卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,515,793.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,257,040.00
减：应收利息总额	175,877.66
买卖债券差价收入	82,875.57

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**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**

本基金在本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益, 本基金于 2016 年 5 月 24 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 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	11,030,686.42
——股票投资	10,986,766.42
——债券投资	43,920.00
——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	11,030,686.42

**7.4.7.18 其他收入**

本基金赎回费和转换费的 25%归基金资产; 本基金在本报告期无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	434,196.35
银行间市场交易费用	500.00
合计	434,696.35

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00
信息披露费	300,000.00
银行费用	7,697.06
债券账户维护费	6,000.00
其他	55,400.00
合计	469,097.06

**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**

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号),要求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,自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号),2017 年 7 月 1 日(含)以后,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,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法,由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

**7.4.9 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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 2016 年 5 月 24 日起生效,无上年度可比期间。

**7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金****7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位:人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,073,019.31
其中:支付销售机构的客户维护费	2,883,270.04

注:1、支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

- 2、本基金合同自 2016 年 5 月 24 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 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,845,503.24

注:1、支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

- 2、本基金合同自 2016 年 5 月 24 日起生效,无上年度可比期间。

**7.4.10.2.3 销售服务费****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**

- 1、本基金在本报告期间未与其他关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。
- 2、本基金合同自 2016 年 5 月 24 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**

份额单位:份

项目	本期 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2016 年 5 月 24 日)持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	6,501,602.00
报告期间因拆分变动份额	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	6,501,602.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%
---------------------	-------

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

#### 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

份额单位：份

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

注：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。

本基金合同自 2016 年 5 月 24 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 名称	本期 2016年5月24日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	102,998,999.62	1,319,978.98

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金, 于本报告期末的相关余额为人民币 308,619.14 元。(本基金合同自 2016 年 5 月 24 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

本基金在本年度未在承销期内购入过由关联方承销的证券。本基金合同自 2016 年 5 月 24 日起生效, 无上年度可比期间。

#### 7.4.10.7 其它关联交易事项的说明

#### 7.4.11 利润分配情况

本年度本基金未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里	2016-12-30	2017-01-10	新股	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

	马			未上市						
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
600200	江苏吴中	2016-10-17	2017-10-12	非公开定向增发	17.49	17.90	571,755	9,999,994.95	10,234,414.50	-
603618	杭电股份	2016-09-07	2017-08-31	非公开定向增发	13.56	12.07	1,032,448	13,999,994.88	12,461,647.36	-
002528	英飞	2016-08-29	2017-08-28	非公	6.78	6.98	1,946,903	13,200,002.34	13,589,382.94	-

	拓			开定向增发						
600531	豫光金铅	2016-12-20	2017-12-17	非公开定向增发	7.50	7.54	2,660,402	19,953,015.00	20,059,431.08	-
002746	仙坛股份	2016-09-21	2017-09-20	非公开定向增发	37.25	40.57	536,913	20,000,009.25	21,782,560.41	-
002169	智光电气	2016-10-11	2017-10-10	非公开定向增发	19.50	20.29	1,594,872	31,100,004.00	32,359,952.88	-
002226	江南化工	2016-10-19	2017-10-19	非公开定向增发	8.14	8.24	4,299,754	34,999,997.56	35,429,972.96	-
002149	西部材料	2016-08-10	2017-08-10	非公开定向增发	24.70	26.02	1,889,309	46,665,932.30	49,159,820.18	-
300259	新天科技	2016-09-27	2017-09-26	非公开定向增发	11.00	10.36	5,727,273	63,000,003.00	59,334,548.28	-

				向增发						
600227	赤天化	2016-10-21	2017-10-18	非公开定向增发	6.01	6.27	11,647,255	70,000,002.55	73,028,288.85	-
002099	海翔药业	2016-09-19	2017-09-18	非公开定向增发	10.28	8.48	8,706,226	89,500,003.28	73,828,796.48	-
000807	云铝股份	2016-11-18	2017-11-20	非公开定向增发	5.20	5.39	15,384,616	80,000,003.20	82,923,080.24	-
002484	江海股份	2016-09-08	2017-09-08	非公开定向增发	12.69	13.84	6,280,000	79,693,200.00	86,915,200.00	-
300296	利亚德	2016-09-05	2017-08-28	非公开定向增发	28.40	30.20	2,883,803	81,900,005.20	87,090,850.60	-
002503	搜于特	2016-11-11	2017-11-13	非公开定向增发	12.60	12.86	7,698,413	97,000,003.80	99,001,591.18	-

600075	新疆天业	2016-08-23	2017-08-18	非公开定向增发	11.54	11.86	8,405,546	97,000,000.84	99,689,775.56	-
601137	博威合金	2016-08-18	2017-08-18	非公开定向增发	11.20	11.90	8,616,071	96,499,995.20	102,531,244.90	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002226	江南化工	2016-11-11	重大资产重组	8.61	2017-03-01	9.20	500,000	4,589,778.00	4,305,000.00	-
000411	英特集团	2016-12-27	重大事项停牌	22.10	2017-01-11	24.31	21,400	447,455.00	472,940.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

##### 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人员负责,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人员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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可于银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同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。

##### 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 2016 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 个月到 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、结算备付金及存出保证金等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2016年12月 31日	1个月以内	1-3 个月	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	102,998,999.62	-	-	-	-	-	-	-	-	102,998,999.62
结算备付金	308,619.14	-	-	-	-	-	-	-	-	308,619.14
存出保证金	45,884.68	-	-	-	-	-	-	-	-	45,884.68
交易性金融资产	-	39,960,000.00	-	-	-	-	-	-	1,087,285.07	1,127,245.07
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	768,621.32	768,621.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	103,353,503.44	39,960,000.00	-	-	-	-	-	-	1,088,053.62	1,231,367.13
负债										
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	1,565,041.88	1,565,041.88
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	260,840.30	260,840.30
应付销售服	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

务费										
应付交易费用									154,140.41	154,140.41
应交税费										
应付利息										
应付利润										
其他负债									435,343.17	435,343.17
负债总计									2,415,365.76	2,415,365.76
利率敏感度缺口	103,353,503.44	39,960,000.00							1,085,638.26	1,228,951.76

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 2016 年 5 月 24 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	1. 除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	2. 基金净值已按照影子价格进行调整	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	18,520.05
	市场利率上升 25 个基点	-18,502.89

#### 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。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,087,285,007.10	88.47
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	1,087,285,007.10	88.47
----	------------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

注：本基金合同自2016年5月24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	1,087,285,007.10	88.30
	其中：股票	1,087,285,007.10	88.30
2	固定收益投资	39,960,000.00	3.25
	其中：债券	39,960,000.00	3.25
	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	103,307,618.76	8.39
7	其他各项资产	814,506.00	0.07
8	合计	1,231,367,131.86	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	21,782,560.41	1.77
B	采矿业	-	-

C	制造业	1,036,144,474.29	84.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	465,252.00	0.04
F	批发和零售业	733,109.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	472,534.00	0.04
H	住宿和餐饮业	280,644.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,516,122.90	1.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	719,724.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	936,172.00	0.08
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	-	-
S	综合	10,234,414.50	0.83
	合计	1,087,285,007.10	88.47

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601137	博威合金	8,616,071	102,531,244.90	8.34
2	600075	新疆天业	8,405,546	99,689,775.56	8.11
3	002503	搜于特	7,698,413	99,001,591.18	8.06
4	300296	利亚德	2,883,803	87,090,850.60	7.09
5	002484	江海股份	6,280,000	86,915,200.00	7.07
6	002099	海翔药业	9,910,926	84,044,652.48	6.84
7	000807	云铝股份	15,384,616	82,923,080.24	6.75
8	600227	赤天化	11,647,255	73,028,288.85	5.94
9	300259	新天科技	5,727,273	59,334,548.28	4.83
10	002149	西部材料	1,889,309	49,159,820.18	4.00
11	002226	江南化工	4,799,754	39,734,972.96	3.23
12	002169	智光电气	1,594,872	32,359,952.88	2.63

13	002746	仙坛股份	536,913	21,782,560.41	1.77
14	600531	豫光金铅	2,660,402	20,059,431.08	1.63
15	300351	永贵电器	548,696	14,085,026.32	1.15
16	002528	英飞拓	1,946,903	13,589,382.94	1.11
17	603618	杭电股份	1,032,448	12,461,647.36	1.01
18	300248	新开普	375,260	10,698,662.60	0.87
19	600114	东睦股份	600,000	10,326,000.00	0.84
20	600200	江苏吴中	571,755	10,234,414.50	0.83
21	300252	金信诺	344,000	10,220,240.00	0.83
22	600160	巨化股份	930,000	9,839,400.00	0.80
23	002643	万润股份	260,000	9,438,000.00	0.77
24	002130	沃尔核材	654,000	9,234,480.00	0.75
25	300316	晶盛机电	750,000	8,985,000.00	0.73
26	002568	百润股份	310,000	6,274,400.00	0.51
27	300161	华中数控	191,700	4,984,200.00	0.41
28	002609	捷顺科技	271,302	4,340,832.00	0.35
29	300230	永利股份	139,889	4,263,816.72	0.35
30	002045	国光电器	66,900	832,905.00	0.07
31	002615	哈尔斯	27,200	477,360.00	0.04
32	000411	英特集团	21,400	472,940.00	0.04
33	000952	广济药业	24,000	472,800.00	0.04
34	002627	宜昌交运	19,100	472,534.00	0.04
35	600593	大连圣亚	11,900	472,192.00	0.04
36	000948	南天信息	26,543	469,811.10	0.04
37	002084	海鸥卫浴	43,700	469,775.00	0.04
38	600133	东湖高新	56,600	465,252.00	0.04
39	300272	开能环保	31,700	464,088.00	0.04
40	000430	张家界	38,000	463,980.00	0.04
41	002006	精功科技	40,900	458,080.00	0.04
42	300254	仟源医药	23,660	456,401.40	0.04
43	002560	通达股份	42,500	455,175.00	0.04
44	000597	东北制药	45,500	455,000.00	0.04
45	000502	绿景控股	21,400	453,680.00	0.04
46	002587	奥拓电子	33,800	450,554.00	0.04
47	002068	黑猫股份	40,000	335,200.00	0.03
48	300030	阳普医疗	22,400	309,792.00	0.03
49	000524	岭南控股	18,200	280,644.00	0.02
50	000586	汇源通信	12,600	268,380.00	0.02
51	000537	广宇发展	29,300	266,044.00	0.02
52	600738	兰州民百	27,300	260,169.00	0.02
53	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.01

54	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
55	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
56	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	-
57	601882	海天精工	2,148	54,215.52	-
58	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	-
59	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	-
60	603319	湘油泵	721	40,736.50	-
61	300582	英飞特	1,359	35,157.33	-
62	002835	同为股份	1,126	24,220.26	-
63	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	-
64	002840	华统股份	1,814	11,881.70	-
65	002838	道恩股份	681	10,405.68	-
66	300586	美联新材	1,006	9,355.80	-
67	300591	万里马	2,396	7,355.72	-
68	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	-

#### 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	002099	海翔药业	101,614,062.25	8.27
2	002503	搜于特	97,000,003.80	7.89
3	600075	新疆天业	97,000,000.84	7.89
4	601137	博威合金	96,499,995.20	7.85
5	300296	利亚德	81,900,005.20	6.66
6	000807	云铝股份	80,000,003.20	6.51
7	002484	江海股份	79,693,200.00	6.48
8	600227	赤天化	70,000,002.55	5.70
9	300259	新天科技	63,000,003.00	5.13
10	002149	西部材料	46,665,932.30	3.80
11	002226	江南化工	39,589,775.56	3.22
12	002169	智光电气	31,100,004.00	2.53
13	300252	金信诺	20,943,371.33	1.70
14	002746	仙坛股份	20,000,009.25	1.63
15	600531	豫光金铅	19,953,015.00	1.62
16	300248	新开普	15,437,031.67	1.26
17	300351	永贵电器	14,961,616.43	1.22
18	002683	宏大爆破	14,023,006.04	1.14
19	603618	杭电股份	13,999,994.88	1.14
20	002528	英飞拓	13,200,002.34	1.07

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 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	002683	宏大爆破	14,964,702.93	1.22
2	002150	通润装备	11,454,211.25	0.93
3	600572	康恩贝	10,666,417.15	0.87
4	300252	金信诺	10,299,738.20	0.84
5	300248	新开普	6,801,770.76	0.55
6	300148	天舟文化	6,744,336.40	0.55
7	002251	步步高	6,327,464.00	0.51
8	603117	万林股份	5,359,992.00	0.44
9	002626	金达威	4,931,927.50	0.40
10	002414	高德红外	3,386,094.84	0.28
11	300458	全志科技	2,781,164.93	0.23
12	600201	生物股份	2,481,146.00	0.20
13	300235	方直科技	2,284,992.20	0.19
14	600114	东睦股份	2,034,626.00	0.17
15	600579	天华院	1,247,845.00	0.10
16	600909	华安证券	594,264.68	0.05
17	600556	ST 慧球	475,869.00	0.04
18	600306	*ST 商城	462,800.00	0.04
19	002164	宁波东力	371,469.00	0.03
20	002159	三特索道	368,225.00	0.03

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	1,171,877,491.51
卖出股票收入（成交）总额	103,305,126.56

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,960,000.00	3.25
	其中：政策性金融债	39,960,000.00	3.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	39,960,000.00	3.25
----	----	---------------	------

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	160209	16 国开 09	400,000	39,960,000.00	3.25

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

#### 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

本基金本报告期初及报告期内均未持有股指期货投资。

##### 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，股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

#### 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 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	45,884.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	768,621.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	
9	合计	814,506.00

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601137	博威合金	102,531,244.90	8.34	非公开发行有明确锁定期
2	600075	新疆天业	99,689,775.56	8.11	非公开发行有明确锁定期
3	002503	搜于特	99,001,591.18	8.06	非公开发行有明确锁定期
4	300296	利亚德	87,090,850.60	7.09	非公开发行有明确锁定期
5	002484	江海股份	86,915,200.00	7.07	非公开发行有明确锁定期
6	000807	云铝股份	82,923,080.24	6.75	非公开发行有明确锁定期
7	002099	海翔药业	73,828,796.48	6.01	非公开发行有明确锁定期
8	600227	赤天化	73,028,288.85	5.94	非公开发行有明确锁定期
9	300259	新天科技	59,334,548.28	4.83	非公开发行有明确锁定期
10	002149	西部材料	49,159,820.18	4.00	非公开发行有明确锁定期

#### 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

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
13,825	88,007.43	261,304,617.81	21.48%	955,398,130.38	78.52%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广东粤财信托有限公司粤银 1 号	100,017,000.00	8.22%
2	信诚人寿保险有限公司	20,005,300.00	1.64%
3	新华人寿保险股份有限公司分红产品	20,003,500.00	1.64%
4	蔡云崽	15,006,750.45	1.23%
5	于军	11,360,065.00	0.93%
6	申能集团财务有限公司	10,000,800.00	0.82%
6	瑞泰人寿保险有限公司(万能险)	10,000,800.00	0.82%
8	中信证券—中信银行—中信证券贵宾定制 71 号集合资产管理计划	8,124,654.00	0.67%
9	信诚基金管理有限公司	6,501,602.00	0.53%
10	梁小鹏	6,000,174.00	0.49%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,944,288.19	0.24%

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年5月24日)基金份额总额	1,216,702,748.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	1,216,702,748.19

## § 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董事会审议通过，隋晓炜先生专职担任中信信诚资产管理有限公司总经理，不再兼任信诚基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已于 2017 年 1 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会、中国证券监督管理委员会上海证监局报备。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人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	
中信证券	2	329,461,560.28	100.00%	301,649.50	100.00%	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		权证交易		
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
中信证券	346,242.00	100.00%	1,483,200,000.00	100.00%	-	-	

### 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	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016-04-21

		(www.xcfunds.com)	
2	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-21
3	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-21
4	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-21
5	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-21
6	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金份额上网发售提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-25
7	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加上海联泰为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-25
8	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加宏信证券、华福证券、申万证券、申万西部证券、中泰证券、中信建投为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-26
9	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加中信银行、国泰君安证券和安信证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-27
10	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加国信证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-04-28
11	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-05-05
12	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加广发证券、招商证券为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-05-06
13	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金增加盈米财富、好买基金为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-05-11
14	信诚鼎利定增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	2016-05-25

		(www.xcfunds.com)	
15	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-05-28
16	信诚基金管理有限公司关于调整网上直销招商银行卡直联渠道费率优惠折扣的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-06-02
17	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 6 月 3 日净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-06-04
18	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-06-09
19	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-06-18
20	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-06-25
21	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-01
22	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-02
23	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-09
24	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-16
25	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-23
26	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-07-30
27	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-06
28	关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-12

29	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-13
30	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-20
31	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-20
32	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-26
33	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-26
34	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-27
35	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金份额上市交易提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-31
36	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-31
37	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金净值	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-08-31
38	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-03
39	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-07
40	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-09
41	关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-10
42	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-21
43	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎	《中国证券报》、《上海证券	2016-09-23

	利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	
44	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-09-29
45	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-10-13
46	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-10-19
47	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-10-21
48	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-10-25
49	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-10-26
50	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-11-15
51	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金变更场内简称的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-11-21
52	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-11-22
53	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-12-17
54	信诚基金管理有限公司关于信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-12-22
55	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加一路财富(北京)信息科技有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-12-26
56	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-12-31



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件名称

- |  |
|--|
| <ol style="list-style-type: none"><li>1、(原)信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件</li><li>2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程</li><li>3、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同</li><li>4、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书</li><li>5、本报告期内按照规定披露的各项公告</li></ol> |
|--|

### 13.2 备查文件存放地点

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

### 13.3 备查文件查阅方式

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

信诚基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日