

信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年3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 报告送出日期:2017年4月21日

重要提示:基金管理人及基金托管人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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

2.1 基金产品概况 信诚新鑫混合 基金代码: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 报告期末基金份额总额:1,206,259,449.87份

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。

本基金主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场环境、证券市场走势的分析,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。

本基金管理人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。

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,控制组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将对权证标的证券发行人的基本情况进行详尽的调研,并结合权证溢价率等因素,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,其预期收益、预期风险高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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 基金合同生效日:2015年6月29日 报告期末基金份额总额:1,206,259,449.87份

3.1 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 信诚新鑫混合A 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日), 信诚新鑫混合B 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

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。

3.2 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 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.97% 0.13% 1.11% 0.01% -0.14% 0.12%

信诚新鑫混合B 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.88% 0.13% 1.11% 0.01% -0.23% 0.12%

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 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.88% 0.13% 1.11% 0.01% -0.23% 0.12%

信诚新鑫混合B 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.88% 0.13% 1.11% 0.01% -0.23% 0.12%

注:1.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,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同约定。

4. 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限

注:1.上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业年限指从事证券行业从业年限,包括证券投资咨询、基金、证券承销与保荐、证券经纪、证券自营、证券资产管理、证券信用管理等。

3.2 基金管理人及基金托管人按照《证券投资基金法》和《证券投资基金运作管理办法》的规定,在报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》和《证券投资基金运作管理办法》的有关规定。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易专项说明 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》以及公司制定的《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易专项说明 报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年以来,在中央供给侧改革下,市场资金面保持宽松状态,资金折现利率波动较大,整体维持较高水平,市场对未来流动性预期较为悲观。

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金净值增长率为0.97%,同期业绩比较基准收益率为1.11%。

4.6 投资组合报告 4.6.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.6.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.6.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.6.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.6.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.6.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.6.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.7 衍生品投资 4.7.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.7.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.7.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.7.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.8 投资组合报告 4.8.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.8.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.8.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.8.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.8.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.8.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.8.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.8.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.9 衍生品投资 4.9.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.9.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.9.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.9.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.10 投资组合报告 4.10.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.10.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.10.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.10.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.10.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.10.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.10.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.10.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.10.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.10.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.10.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.11 衍生品投资 4.11.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.11.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.11.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.11.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.12 投资组合报告 4.12.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.12.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.12.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.12.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.12.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.12.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.12.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.12.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.12.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.12.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.12.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.12.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.13 衍生品投资 4.13.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.13.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.13.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.13.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.14 投资组合报告 4.14.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.14.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.14.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.14.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.14.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.14.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.14.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.14.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.14.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.14.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.14.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.14.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.15 衍生品投资 4.15.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.15.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.15.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.15.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.16 投资组合报告 4.16.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.16.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.16.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.16.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.16.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.16.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.16.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.16.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.16.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.16.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.16.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.16.10 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

4.17 衍生品投资 4.17.1 股指期货投资 报告期内,本基金未持有股指期货。

4.17.2 权证投资 报告期内,本基金未持有权证。

4.17.3 国债期货投资 报告期内,本基金未持有国债期货。

4.17.4 其他衍生品投资 报告期内,本基金未持有其他衍生品。

4.18 投资组合报告 4.18.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

4.18.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 4.18.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元)

4.18.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

4.18.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

4.18.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

4.18.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元)

4.18.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.18.7 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.18.8 报告期末持有的公允价值低于成本的金融资产

Table with 5 columns: 序号, 项目, 信诚新鑫混合A, 信诚新鑫混合B

4.18.9 报告期末持有的公允价值高于成本的金融资产