信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 04 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 4 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 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 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15
§7 年度财务报表 17
7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 20
§8 投资组合报告 40
8.1 期末基金资产组合情况 40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
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 41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48

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 49
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 49
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 49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
8.12 投资组合报告附注 49
§9 基金份额持有人信息 50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
9.2 期末上市基金前十名持有人 50
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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情况 51
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 51
§10 开放式基金份额变动 51
§11 重大事件揭示 52
11.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
11.4 基金投资策略的改变 52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
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 52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
11.8 其他重大事件 53
§12 影响投资者决策的其他重要信息 54
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 55
§13 备查文件目录 55
13.1 备查文件目录 55
13.2 存放地点 55
13.3 查阅方式 55

§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 06 月 19 日	
基金管理人	中信保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	291,420,767.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新旺 A	新旺 C
下属分级基金场内简称	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	286,585,112.57 份	4,835,654.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。 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。 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
下属分级基金的风险收益特征	

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		中信保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	陆志俊
	联系电话	021-68649788	95559
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-666-0066	95559
传真		021-50120888	021-62701216
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		张翔燕	任德奇

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。
本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
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	2019 年		2018 年		2017 年	
	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C
本期已实现收益	7,800,297.47	293,688.30	90,304.36	8,448,066.49	749,816.17	12,091,932.37
本期利润	14,661,271.02	792,110.28	-26,435.50	-861,041.89	1,457,229.83	29,309,094.32
加权平均基金份额本期利润	0.1047	0.1638	-0.0447	-0.0201	0.0525	0.0644
本期加权平均净值利润率	8.44%	14.13%	-3.90%	-1.81%	5.03%	6.11%
本期基金份额净值增长率	15.70%	15.55%	-4.59%	-4.70%	11.70%	7.48%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C
期末可供分配利润	78,787,305.69	1,058,556.30	58,687.50	266,446.02	69,029.14	4,530,583.14
期末可供分配基金份额利润	0.2749	0.2189	0.1025	0.0551	0.1036	0.0493
期末基金资产净值	365,372,418.26	5,894,211.27	631,434.71	5,102,100.99	769,170.43	101,662,536.47
期末基金份额净值	1.275	1.219	1.102	1.055	1.155	1.107
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C	新旺 A	新旺 C
基金份额累计净值增长率	27.50%	21.90%	10.20%	5.50%	15.50%	10.70%

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

新旺 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.24%	0.16%	1.13%	0.01%	2.11%	0.15%
过去六个月	4.51%	0.17%	2.27%	0.01%	2.24%	0.16%

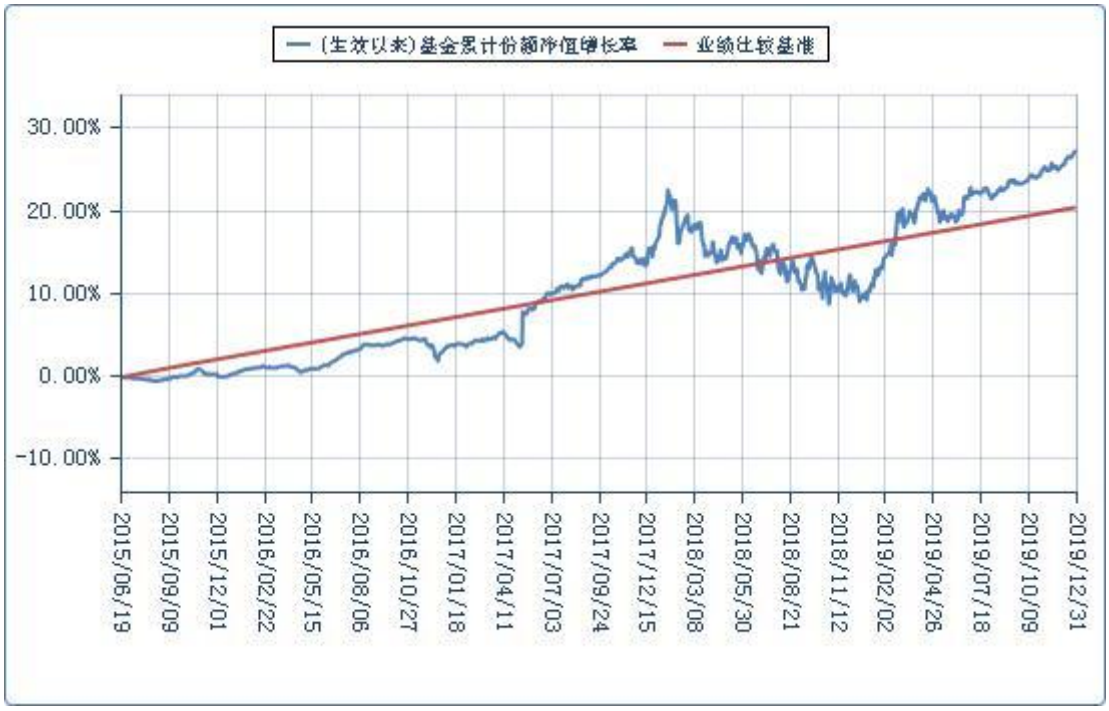
过去一年	15.70%	0.38%	4.50%	0.01%	11.20%	0.37%
过去三年	23.31%	0.43%	13.50%	0.01%	9.81%	0.42%
自基金合同生效起至今	27.50%	0.36%	20.57%	0.01%	6.93%	0.35%

新旺 C：

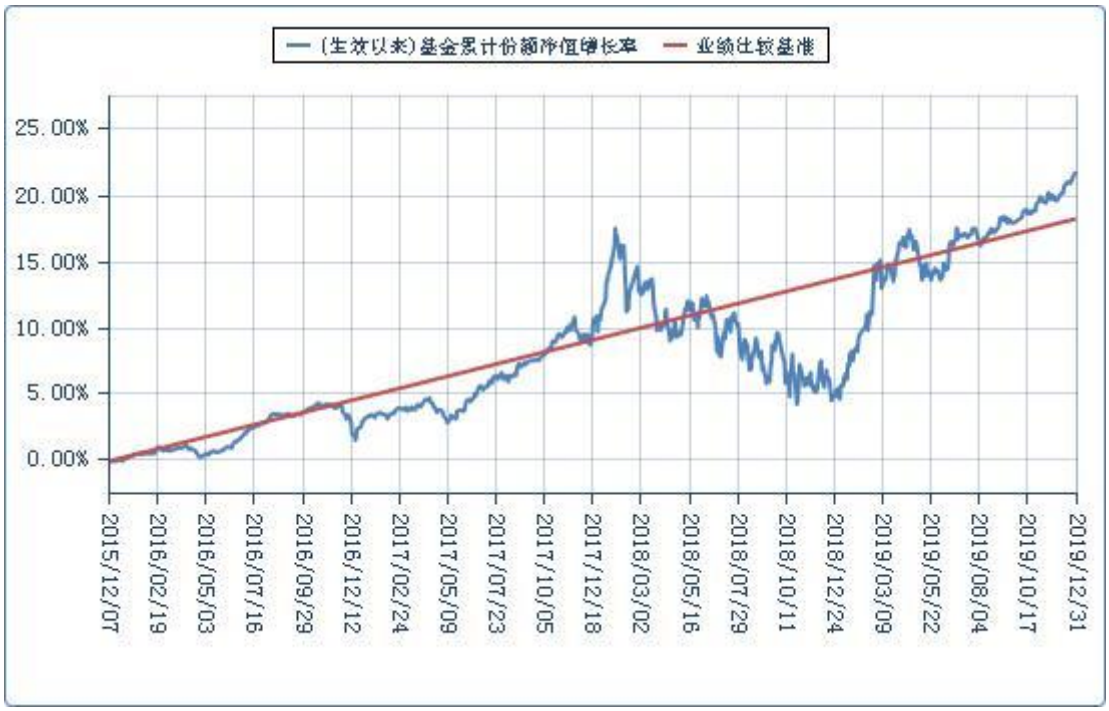
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.22%	0.15%	1.13%	0.01%	2.09%	0.14%
过去六个月	4.46%	0.17%	2.27%	0.01%	2.19%	0.16%
过去一年	15.55%	0.38%	4.50%	0.01%	11.05%	0.37%
过去三年	18.35%	0.42%	13.50%	0.01%	4.85%	0.41%
自基金合同生效起至今	21.90%	0.36%	18.32%	0.01%	3.58%	0.35%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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

新旺 A：



新旺 C：



3.2.3 过去五年/自基金合同生效/自基金转型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

新旺 A：

新旺 C：

注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§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

本基金管理人中信保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%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2019 年 12 月 31 日,本基金管理人管理的运作中基金为 69 只， 分别为：信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保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、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚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)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保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、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、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、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
提云涛	本基金基金经理，兼任量化投资总监，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、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金的基金经理。	2016 年 11 月 23 日	-	19	经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于东方证券有限责任公司，担任研究所所长助理；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任量化投资总监。现兼任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、信诚新选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) 、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、

					信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金的基金经理。

注：1.杨立春先生于 2020 年 1 月 14 日起担任本基金基金经理。
2.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。
3.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 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年，中国经济继续平稳运行。从经济增长看，全年 GDP 增速为 6.1%，较 2018 年有所回落，但仍保持较高的增长。从工业企业利润看，规模以上工业企业实现利润总额 61995.5 亿元，比 2018 年下降 3.3%，但经济结构进一步优化，高技术制造业和战略性新兴产业利润保持增长。从全年看，一季度积极政策稳定经济有助于市场情绪的改善，二季度金融供给侧改革、坚持房地产调控市场对经济并不乐观，之后经济在底部稳步运行；四季度经济呈企稳态势。从国际环境看，国际环境在不断波动。一季度，中美贸易相对缓和，但之后贸易战有升级趋势；进入四季度，中美达成第一阶段贸易协议，外部环境有所改善。

债券市场，一季度，因股票市场上涨，利率债收益率上行，信用债相对投资价值明显抬升，信用利差收窄；二季度，受市场预期中小银行风险可能增大的影响，中低等级主体利差明显扩大；四季度，受多种利空因素的主导，债市情绪走弱，利率债转为震荡调整，受多起违约事件的影响，信用利差出现小幅震荡。股票市场，一季度，在积极的政策刺激下，股票市场快速上涨；之后随着中美贸易冲突加剧，加之前期涨幅较多，市场在 5 月份明显回落。之后震荡向上。从规模上看，在大盘蓝筹全年呈上涨趋势的同时，中小盘也有一定幅度的上涨。从行业结构看，一方面，白酒、家电等盈利稳定增长的传统行业涨幅可观；另一方面，5G、半导体等国产替代和代表新经济的行业表现强劲。

2019 年，本基金采用量化与主动结合的方法，综合考虑盈利能力、资产质量、盈利增长、以及市场估值等因素多角度考察个股，同时注意上市公司的长期盈利稳健性，并通过分散投资控制个股风险。债券投资采用“短久期、高评级”策略以获取稳健收益。同时，本基金在可能的情况下积极参与网下新股申购以获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A、C 份额净值增长率分别为 15.70%和 15.55%，同期业绩比较基准收益率为 4.50%，基金 A、C 份额超越业绩比较基准分别为 11.20%和 11.05%。

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 2020 年，国际环境有所缓和，经济有企稳迹象。但是，新型冠状肺炎疫情对经济的冲击不容忽视。为应对疫情冲击和在实现全面小康的目标下，预计货币政策将相对宽松，财政政策也将更加积极。从金融市场看，年初的新冠肺炎疫情等对经济带来一定的负面冲击，预计一季度经济增速将回落。同时，海外蝗灾也可能影响全球粮食产量，从而可能对 CPI 产生超预期影响。预期 2020 年的债券市场总体是多空因素交织。一方面，为对冲经济下行压力，可能会出台积极的政策进行逆周期调节，有助于利率下行；另一方面，因为 CPI 可能处于高位、逆周期调节力度可能加大等因素，又可能使利率震荡调整。债券市场可能存在波段交易机会。股票市场，在积极政策大背景下，一方面受疫情影响小盈利确定性强的行业仍将值得期待；另一方面，随着经济结构调整和转型，营收和利润能够稳定增长的新兴产业中公司也将有所表现。

2020 年，本基金股票投资仍将控制仓位，采用“主动+量化”的方式，从盈利、增长、估值等维度选择个股，以获取相对稳健的收益；债券投资仍将采用“短久期、高评级”策略，获取稳健收益；同时，在可能的情况下积极参与网下新股申购等投资以增强收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管规范要求，坚持从保护基金份额持有人利益出发，继续致力于完善公司内部合规与内控机制，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求结合公司业务发展实际情况，及时梳理和更新内部规章制度和操作流程，进一步完善内控制度体系；开展对公司运作和基金业务的日常监察，防范内幕交易、利益输送，有效保障基金投资交易等各项业务合规运作；根据监管规定及监察稽核计划对各业务领域和关键业务部门开展定期全面稽核、专项稽核及合规检查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，完善内控措施；完成各项法定信息披露工作，保证信息披露的及时性、真实性、准确性和完整性；在基金募集、投资过程中及时进行合规检查与提示；通过合规咨询和形式多样的员工合规培训强化全员合规、主动合规理念，加强公司合规文化建设；根据监管要求及时向监管部门报送各类数据材料；高度重视反洗钱工作，在风险为本的理念下全面贯彻落实反洗钱监管要求，采取合理措施防控洗钱风险，从完善反洗钱体系机制及规范业务流程、切实履行客户身份识别义务要求、按照规定报送可疑交易报告、加强宣传培训和人才建设、加强系统建设提升反洗钱科技化水平

等方面入手，将反洗钱工作贯穿于各项业务流程，有效提升公司反洗钱工作水平。

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,继续加强公司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严格控制。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、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、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。

基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,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备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

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,可申请召开估值决策委员会临时会议,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

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自 2018 年 7 月 12 日起至 2019 年 7 月 5 日止基金资产净值低于五千万元。截至报告期末，基金资产净值已超过五千万元。

§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

2019 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

2019 年度,中信保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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019 年度,由中信保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 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
报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21638 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“信诚新旺回报混合基金(LOF)”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度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。 (二) 我们的意见 我们认为,后附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,公允反映了信诚新旺回报混合基金(LOF)2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于信诚新旺回报混合基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	信诚新旺回报混合基金(LOF)的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估信诚新旺回报混合基金(LOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算信诚新旺回报混合基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督信诚新旺回报混合基金(LOF)的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，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。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对信诚新旺回报混合基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信诚新旺回报混合基金(LOF)不能持续经营。

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
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)
注册会计师的姓名	陈熹、俞伟敏
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	2020 年 04 月 21 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	6,748,894.77	886,557.86
结算备付金	-	1,633,666.40	981.54
存出保证金	-	902,400.55	12,470.17
交易性金融资产	7.4.7.2	358,855,709.73	5,186,398.15
其中：股票投资	-	83,368,619.83	2,126,288.15
债券投资	-	275,487,089.90	3,060,110.00
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	7.4.7.5	4,569,988.65	84,297.44
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	-	376,710,660.10	6,170,705.16
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 12 月 31 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	1,000,000.00	-
应付证券清算款	-	4,000,000.00	-
应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	187,350.04	2,929.83
应付托管费	-	62,450.02	976.60
应付销售服务费	-	495.65	434.77
应付交易费用	7.4.7.7	9,047.41	3,828.26
应交税费	-	4,701.17	-
应付利息	-	986.28	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.00	429,000.00
负债合计	-	5,444,030.57	437,169.46
所有者权益：	-	-	-
实收基金	7.4.7.9	291,420,767.54	5,408,402.18
未分配利润	7.4.7.10	79,845,861.99	325,133.52
所有者权益合计	-	371,266,629.53	5,733,535.70
负债和所有者权益总计	-	376,710,660.10	6,170,705.16

注：截止本报告期末，基金份额总额 291,420,767.54 份。下属分级基金：新旺 A 的基金份额净值 1.275 元，基金份额总额 286,585,112.57 份；新旺 C 的基金份额净值 1.219 元，基金份额总额 4,835,654.97 份。

7.2 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：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	-	17,236,153.73	-48,950.39
1.利息收入	-	4,318,890.06	1,236,240.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	70,945.62	30,595.51
债券利息收入	-	4,245,503.90	1,136,884.26
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,440.54	68,761.13
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	5,557,529.95	8,080,641.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,182,369.89	7,660,790.04
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	188,526.84	46,938.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-

贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-458,505.15	-
股利收益	7.4.7.15	645,138.37	372,912.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,359,395.53	-9,425,848.24
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	338.19	60,015.57
减：二、费用	-	1,782,772.43	838,527.00
1．管理人报酬	-	1,064,078.90	291,330.21
2．托管费	-	354,693.04	97,110.04
3．销售服务费	-	5,601.48	47,876.96
4．交易费用	7.4.7.18	194,631.32	133,525.13
5．利息支出	-	2,196.98	178.39
其中：卖出回购金融资产支出	-	2,196.98	178.39
6．税金及附加	-	3,137.89	2,050.51
7．其他费用	7.4.7.19	158,432.82	266,455.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	15,453,381.30	-887,477.39
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	15,453,381.30	-887,477.39

7.3 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：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 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）	5,408,402.18	325,133.52	5,733,535.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,453,381.30	15,453,381.30
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）	286,012,365.36	64,067,347.17	350,079,712.53
其中：1.基金申购款	286,348,627.87	64,146,490.72	350,495,118.59
2.基金赎回款	-336,262.51	-79,143.55	-415,406.06
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）	291,420,767.54	79,845,861.99	371,266,629.53
项目	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 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）	92,539,931.80	9,891,775.10	102,431,706.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-887,477.39	-887,477.39

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）	-87,131,529.62	-8,679,164.19	-95,810,693.81
其中：1.基金申购款	31,247.21	3,804.21	35,051.42
2.基金赎回款	-87,162,776.83	-8,682,968.40	-95,845,745.23
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）	5,408,402.18	325,133.52	5,733,535.70

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：

唐世春	陈逸辛	刘卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]987 号《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》核准，由中信保诚基金管理有限公司(原名为“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》、《证券投资基金运作管理办法》、《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》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 204,815,464.79 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 788 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 基金合同》于 2015 年 6 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 204,824,716.99 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,252.20 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保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。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》，经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准，公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”，并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

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》、《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(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。本基金所持有的股票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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2020 年 4 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行

调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确

定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于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。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交

易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	6,748,894.77	886,557.86
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	6,748,894.77	886,557.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		76,056,325.60	83,368,619.83	7,312,294.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	40,830,397.57	40,886,089.90	55,692.33
	银行间市场	234,581,932.68	234,601,000.00	19,067.32
	合计	275,412,330.25	275,487,089.90	74,759.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		351,468,655.85	358,855,709.73	7,387,053.88
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,176,321.09	2,126,288.15	-50,032.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,054,358.71	3,060,110.00	5,751.29

	银行间市场	-	-	-
	合计	3,054,358.71	3,060,110.00	5,751.29
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,230,679.80	5,186,398.15	-44,281.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	-8,548,560.00	-	-	-
IF2001	-8,548,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-8,548,560.00	-	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：1、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

2、于本年度末，本基金持有 7 手沪深 300 股指期货 IF2001，合约市值为-8,620,500.00 元，公允价值变动为-71,940.00 元。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,000.00	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,281.68	177.02
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	2.60	0.40
应收债券利息	4,567,689.02	84,114.42
应收资产支持证券利息	-	-
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	1,015.35	5.60
合计	4,569,988.65	84,297.44

注：其他包括应收结算保证金利息、应收中金所清算备付金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	9,047.41	3,828.26
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,047.41	3,828.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付审计费	60,000.00	70,000.00

应付信息披露费	110,000.00	350,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	179,000.00	429,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 实收基金

新旺 A：

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	572,747.21	572,747.21
本期申购	286,348,627.87	286,348,627.87
本期赎回（以“-”号填列）	-336,262.51	-336,262.51
本期末	286,585,112.57	286,585,112.57

新旺 C：

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,835,654.97	4,835,654.97
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,835,654.97	4,835,654.97

注：1、申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

单位：份

		本报告期末		上年度末	
基金代码	场内简称	场内	场外	场内	场外
165526	信诚新旺	44,000.00	286,541,112.57	44,000.00	528,747.21
165527	新旺C	-	4,835,654.97	-	4,835,654.97

7.4.7.10 未分配利润

新旺 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	143,849.55	-85,162.05	58,687.50
本期利润	7,800,297.47	6,860,973.55	14,661,271.02
本期基金份额交易产生的变动数	82,578,533.83	-18,511,186.66	64,067,347.17
其中：基金申购款	82,678,629.03	-18,532,138.31	64,146,490.72
基金赎回款	-100,095.20	20,951.65	-79,143.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,522,680.85	-11,735,375.16	78,787,305.69

新旺 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	915,408.05	-648,962.03	266,446.02
本期利润	293,688.30	498,421.98	792,110.28
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	1,209,096.35	-150,540.05	1,058,556.30

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日
活期存款利息收入	42,754.73	26,821.95
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,682.69	3,316.50
其他	26,508.20	457.06
合计	70,945.62	30,595.51

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入、中金所清算备付金利息收入。

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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	31,966,032.11	63,198,285.11
减：卖出股票成本总额	26,783,662.22	55,537,495.07
买卖股票差价收入	5,182,369.89	7,660,790.04

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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	188,526.84	46,938.79
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	188,526.84	46,938.79

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	上年度可比期间

	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	2018年01月01日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,469,187.68	118,781,353.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,637,241.11	115,808,510.69
减：应收利息总额	643,419.73	2,925,904.21
买卖债券差价收入	188,526.84	46,938.79

7.4.7.13.3 债券投资收益--赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益--申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益--其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年可比期间收益金额 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-458,505.15	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	645,138.37	372,912.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	645,138.37	372,912.55

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	7,431,335.53	-9,425,848.24
--股票投资	7,362,327.17	-9,496,459.77
--债券投资	69,008.36	70,611.53
--资产支持证券投资	-	-
--基金投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2.衍生工具	-71,940.00	-

--权证投资	-	-
--期货投资	-71,940.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	7,359,395.53	-9,425,848.24

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	338.19	15.57
其他收入	-	60,000.00
合计	338.19	60,015.57

注：本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25%归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	191,959.30	132,900.13
银行间市场交易费用	400.00	625.00
期货交易费用	2,272.02	-
合计	194,631.32	133,525.13

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	60,000.00	150,000.00
银行费用	1,232.82	255.76
账户维护费	36,000.00	45,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	158,432.82	266,455.76

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	基金管理人、基金销售机构

交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,064,078.90	291,330.21
其中：支付销售机构的客户维护费	1,905.28	1,853.36

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	354,693.04	97,110.04

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新旺 A	新旺 C	合计
中信保诚基金	-	5,601.48	5,601.48
合计	-	5,601.48	5,601.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新旺 A	新旺 C	合计
中信保诚基金	-	47,876.96	47,876.96
合计	-	47,876.96	47,876.96

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。
新旺 C 的销售服务费按前一日新旺 C 资产净值的 0.10%年费率计提。
计算公式为:新旺 C 基金日销售服务费=新旺 C 基金份额前一日资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内与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。

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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行,本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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,本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 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	6,748,894.77	42,754.73	886,557.86	26,821.95

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末 2019 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：	期末成本总额	期末估值总额	备注

							股）			
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 01 月 06 日	新发未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
601077	渝农商行	2019 年 10 月 16 日	2020 年 04 月 29 日	锁定期股票	7.36	6.26	73,889	543,823.04	462,545.14	-
601916	浙商银行	2019 年 11 月 18 日	2020 年 05 月 26 日	锁定期股票	4.94	4.66	147,098	726,664.12	685,476.68	-
688078	龙软科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 06 月 30 日	锁定期股票	21.59	41.95	2,811	60,689.49	117,921.45	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 01 月 06 日	新发未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688101	三达膜	2019 年 11 月 08 日	2020 年 05 月 15 日	锁定期股票	18.26	17.89	13,483	246,199.58	241,210.87	-
688118	普元信息	2019 年 11 月 26 日	2020 年 06 月 04 日	锁定期股票	26.90	35.30	4,028	108,353.20	142,188.40	-
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 01 月 06 日	新发未上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688198	佰仁医疗	2019 年 11 月 29 日	2020 年 06 月 09 日	锁定期股票	23.68	37.58	3,213	76,083.84	120,744.54	-
688199	久日新材	2019 年 10 月 28 日	2020 年 05 月 06 日	锁定期股票	66.68	59.66	4,494	299,659.92	268,112.04	-
688288	鸿泉物联	2019 年 10 月 29 日	2020 年 05 月 06 日	锁定期股票	24.99	28.45	3,429	85,690.71	97,555.05	-

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
113029	明阳转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 01 月 07 日	新发未上市	100.00	100.00	1,710	171,000.00	171,000.00	-
113554	仙鹤	2019 年	2020 年	新发未	100.00	100.00	390	39,000.00	39,000.00	-

	转债	12 月 18 日	01 月 10 日	上市						
128084	木森转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 01 月 10 日	新发未上市	100.00	100.00	850	85,000.00	85,000.00	-
128085	鸿达转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 01 月 08 日	新发未上市	100.00	100.00	1,090	109,000.00	109,000.00	-
128086	国轩转债	2019 年 12 月 19 日	2020 年 01 月 10 日	新发未上市	100.00	100.00	660	66,000.00	66,000.00	-
128088	深南转债	2019 年 12 月 24 日	2020 年 01 月 16 日	新发未上市	100.00	100.00	31	3,100.00	3,100.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2020 年 01 月 02 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金属于混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设。在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;公司设立独立的监察稽核部和风险管理部,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。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险,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对风险进行持续监控。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,057,000.00	-
合计	10,057,000.00	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	194,115,000.00	-
合计	194,115,000.00	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	35,699,580.70	50,510.00
AAA 以下	599,260.70	-
未评级	35,016,248.50	3,009,600.00
合计	71,315,089.90	3,060,110.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

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

式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末，除所持有的卖出回购金融资产款将在一年以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他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,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。)

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	6,748,894.77	-	-	-	-	-	6,748,894.77
结算备付金	1,633,666.40	-	-	-	-	-	1,633,666.40
存出保证金	40,350.55	-	-	-	-	862,050.00	902,400.55
交易性金融资产	10,057,000.00	-	242,790,195.00	22,040,634.20	599,260.70	83,368,619.83	358,855,709.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	-	-	4,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,569,988.65	4,569,988.65
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,479,911.72	-	242,790,195.00	22,040,634.20	599,260.70	88,800,658.48	376,710,660.10
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,000,000.00	4,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	187,350.04	187,350.04
应付托管费	-	-	-	-	-	62,450.02	62,450.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	495.65	495.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,047.41	9,047.41
应交税费	-	-	-	-	-	4,701.17	4,701.17
应付利息	-	-	-	-	-	986.28	986.28
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	1,000,000.0	-	-	-	-	4,444,030.5	5,444,030.57

	0					7	
利率敏感度缺口	21,479,911.72	-	242,790,195.00	22,040,634.20	599,260.70	84,356,627.91	371,266,629.53
上年度末 2018 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	886,557.86	-	-	-	-	-	886,557.86
结算备付金	981.54	-	-	-	-	-	981.54
存出保证金	12,470.17	-	-	-	-	-	12,470.17
交易性金融资产	-	-	3,060,110.00	-	-	2,126,288.15	5,186,398.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	84,297.44	84,297.44
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	900,009.57	-	3,060,110.00	-	-	2,210,585.59	6,170,705.16
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	-	-	-	-	-	2,929.83	2,929.83
应付托管费	-	-	-	-	-	976.60	976.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	434.77	434.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,828.26	3,828.26
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	429,000.00	429,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	437,169.46	437,169.46
利率敏感度缺口	900,009.57	-	3,060,110.00	-	-	1,773,416.13	5,733,535.70

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负债的账面价值，并按照合

约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ）	
		本期末(2019 年 12 月 31 日)	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	440,895.01	2,075.78
	市场利率上升 25 个基点	-438,780.74	-2,072.75

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险,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价格风险。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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	83,368,619.83	22.46	2,126,288.15	37.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	83,368,619.83	22.46	2,126,288.15	37.09

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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(2019 年 12 月 31 日)	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,243,526.72	114,383.49
	沪深 300 指数下降 5%	-5,243,526.72	-114,383.49

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 81,074,124.31 元，属于第二层次的余额为 277,781,585.42 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 2,126,288.15 元，第二层次 3,060,110.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	83,368,619.83	22.13
	其中：股票	83,368,619.83	22.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	275,487,089.90	73.13
	其中：债券	275,487,089.90	73.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	4,000,000.00	1.06
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,382,561.17	2.23
8	其他各项资产	5,472,389.20	1.45
9	合计	376,710,660.10	100.00

8.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,497,372.38	0.40
C	制造业	33,138,764.22	8.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	906,134.00	0.24
E	建筑业	374,324.00	0.10
F	批发和零售业	613,786.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	2,928,844.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,735,209.85	0.47
J	金融业	38,573,715.34	10.39
K	房地产业	2,856,542.00	0.77
L	租赁和商务服务业	490,070.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	247,280.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	83,368,619.83	22.46

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	121,600	10,391,936.00	2.80
2	600519	贵州茅台	6,550	7,748,650.00	2.09
3	600036	招商银行	134,700	5,062,026.00	1.36
4	600887	伊利股份	135,200	4,183,088.00	1.13
5	600585	海螺水泥	57,400	3,145,520.00	0.85
6	601166	兴业银行	155,100	3,070,980.00	0.83
7	601398	工商银行	466,800	2,744,784.00	0.74
8	600309	万华化学	47,000	2,639,990.00	0.71
9	601211	国泰君安	132,500	2,449,925.00	0.66

10	601939	建设银行	323,100	2,336,013.00	0.63
11	600276	恒瑞医药	24,232	2,120,784.64	0.57
12	601988	中国银行	477,700	1,762,713.00	0.47
13	601288	农业银行	462,100	1,705,149.00	0.46
14	601688	华泰证券	74,300	1,509,033.00	0.41
15	600436	片仔癀	13,600	1,494,232.00	0.40
16	601601	中国太保	39,400	1,490,896.00	0.40
17	688111	金山办公	9,000	1,475,100.00	0.40
18	600690	海尔智家	74,378	1,450,371.00	0.39
19	601006	大秦铁路	169,200	1,389,132.00	0.37
20	600837	海通证券	86,712	1,340,567.52	0.36
21	000858	五 粮 液	8,134	1,081,903.34	0.29
22	000651	格力电器	14,800	970,584.00	0.26
23	600900	长江电力	49,300	906,134.00	0.24
24	000002	万　科A	26,900	865,642.00	0.23
25	601229	上海银行	89,200	846,508.00	0.23
26	000333	美的集团	14,500	844,625.00	0.23
27	600048	保利地产	51,100	826,798.00	0.22
28	601916	浙商银行	147,098	685,476.68	0.18
29	000568	泸州老窖	7,900	684,772.00	0.18
30	600377	宁沪高速	59,900	672,078.00	0.18
31	000001	平安银行	39,500	649,775.00	0.18
32	600660	福耀玻璃	25,600	614,144.00	0.17
33	600028	中国石化	119,200	609,112.00	0.16
34	002142	宁波银行	21,400	602,410.00	0.16
35	002415	海康威视	16,500	540,210.00	0.15
36	300059	东方财富	34,200	539,334.00	0.15
37	600104	上汽集团	21,700	517,545.00	0.14
38	601077	渝农商行	73,889	462,545.14	0.12
39	000895	双汇发展	15,000	435,450.00	0.12
40	000538	云南白药	4,700	420,321.00	0.11
41	600383	金地集团	28,500	413,250.00	0.11
42	001979	招商蛇口	20,600	409,322.00	0.11
43	600009	上海机场	5,000	393,750.00	0.11
44	600019	宝钢股份	66,800	383,432.00	0.10
45	601009	南京银行	42,400	371,848.00	0.10
46	000776	广发证券	21,500	326,155.00	0.09
47	601857	中国石油	54,800	319,484.00	0.09
48	002024	苏宁易购	29,400	297,234.00	0.08
49	000157	中联重科	43,100	287,908.00	0.08
50	600018	上港集团	47,700	275,229.00	0.07

51	000069	华侨城A	35,000	272,650.00	0.07
52	002202	金风科技	22,600	270,070.00	0.07
53	688199	久日新材	4,494	268,112.04	0.07
54	601668	中国建筑	47,300	265,826.00	0.07
55	002050	三花智控	15,000	259,950.00	0.07
56	300136	信维通信	5,600	254,128.00	0.07
57	601888	中国国旅	2,800	249,060.00	0.07
58	603993	洛阳钼业	57,100	248,956.00	0.07
59	300144	宋城演艺	8,000	247,280.00	0.07
60	000425	徐工机械	45,100	246,697.00	0.07
61	688101	三达膜	13,483	241,210.87	0.06
62	002027	分众传媒	38,500	241,010.00	0.06
63	600196	复星医药	9,000	239,400.00	0.06
64	601088	中国神华	12,700	231,775.00	0.06
65	000963	华东医药	8,500	207,230.00	0.06
66	002236	大华股份	10,200	202,776.00	0.05
67	000513	丽珠集团	6,000	202,200.00	0.05
68	000999	华润三九	6,300	199,584.00	0.05
69	000429	粤高速A	23,600	194,936.00	0.05
70	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.05
71	688118	普元信息	4,028	142,188.40	0.04
72	000783	长江证券	19,900	142,086.00	0.04
73	002110	三钢闽光	13,900	130,104.00	0.04
74	002572	索菲亚	5,900	123,605.00	0.03
75	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.03
76	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.03
77	000830	鲁西化工	11,100	116,661.00	0.03
78	002727	一心堂	4,700	109,322.00	0.03
79	601186	中国铁建	10,700	108,498.00	0.03
80	002916	深南电路	700	99,470.00	0.03
81	688288	鸿泉物联	3,429	97,555.05	0.03
82	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
83	601899	紫金矿业	19,182	88,045.38	0.02
84	600031	三一重工	5,100	86,955.00	0.02
85	601336	新华保险	1,700	83,555.00	0.02
86	600340	华夏幸福	2,400	68,880.00	0.02
87	601238	广汽集团	5,200	60,788.00	0.02
88	600741	华域汽车	1,000	25,990.00	0.01
89	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
90	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
91	600085	同仁堂	400	11,272.00	0.00

92	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
93	002352	顺丰控股	100	3,719.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	601318	中国平安	12,750,536.00	222.39
2	600519	贵州茅台	7,696,923.00	134.24
3	600036	招商银行	6,150,846.08	107.28
4	600887	伊利股份	4,432,709.00	77.31
5	601166	兴业银行	3,699,772.00	64.53
6	601398	工商银行	3,395,111.00	59.21
7	601939	建设银行	3,012,987.00	52.55
8	600585	海螺水泥	2,930,599.07	51.11
9	601211	国泰君安	2,621,406.00	45.72
10	600309	万华化学	2,564,257.00	44.72
11	601988	中国银行	2,290,962.00	39.96
12	601288	农业银行	2,204,529.00	38.45
13	600276	恒瑞医药	2,078,142.00	36.25
14	601688	华泰证券	1,892,988.00	33.02
15	601601	中国太保	1,797,402.00	31.35
16	600436	片仔癀	1,777,150.00	31.00
17	601006	大秦铁路	1,615,461.00	28.18
18	600690	海尔智家	1,405,580.26	24.52
19	000858	五 粮 液	1,335,048.22	23.28
20	600837	海通证券	1,303,661.92	22.74
21	600900	长江电力	1,178,951.00	20.56
22	601229	上海银行	1,046,459.00	18.25
23	601916	浙商银行	1,038,086.66	18.11
24	000651	格力电器	1,020,887.00	17.81
25	000333	美的集团	1,005,346.00	17.53
26	000002	万　科Ａ	990,632.00	17.28
27	600048	保利地产	921,424.00	16.07
28	600028	中国石化	832,143.00	14.51
29	688036	传音控股	810,769.90	14.14
30	601077	渝农商行	776,884.80	13.55
31	600377	宁沪高速	774,014.00	13.50
32	000001	平安银行	734,078.00	12.80
33	600660	福耀玻璃	727,945.00	12.70
34	688111	金山办公	672,261.74	11.73
35	002415	海康威视	655,046.00	11.42

36	002142	宁波银行	650,737.62	11.35
37	600104	上汽集团	649,756.00	11.33
38	000568	泸州老窖	629,981.00	10.99
39	600019	宝钢股份	565,277.00	9.86
40	001979	招商蛇口	548,750.00	9.57
41	600009	上海机场	530,621.00	9.25
42	000538	云南白药	477,879.00	8.33
43	601857	中国石油	473,779.00	8.26
44	601009	南京银行	472,920.80	8.25
45	688363	华熙生物	468,342.00	8.17
46	300059	东方财富	457,809.00	7.98
47	600383	金地集团	443,662.00	7.74
48	000895	双汇发展	431,432.00	7.52
49	002024	苏宁易购	405,907.00	7.08
50	601668	中国建筑	367,002.00	6.40
51	000776	广发证券	362,101.00	6.32
52	002202	金风科技	353,710.00	6.17
53	600018	上港集团	345,785.00	6.03
54	000069	华侨城A	324,320.94	5.66
55	000157	中联重科	319,515.00	5.57
56	600196	复星医药	308,796.00	5.39
57	002050	三花智控	304,233.98	5.31
58	601088	中国神华	301,347.00	5.26
59	000963	华东医药	300,764.00	5.25
60	688199	久日新材	299,659.92	5.23
61	300144	宋城演艺	299,343.00	5.22
62	002304	洋河股份	281,634.00	4.91
63	000425	徐工机械	268,713.65	4.69
64	601888	中国国旅	266,699.00	4.65
65	002027	分众传媒	256,356.00	4.47
66	688101	三达膜	246,199.58	4.29
67	000429	粤高速A	245,364.00	4.28
68	000999	华润三九	243,054.00	4.24
69	688366	昊海生科	241,902.53	4.22
70	603993	洛阳钼业	224,506.00	3.92
71	688123	聚辰股份	221,445.00	3.86
72	000513	丽珠集团	220,040.00	3.84
73	300136	信维通信	212,334.00	3.70
74	002236	大华股份	207,683.00	3.62
75	688139	海尔生物	205,756.97	3.59
76	688025	杰普特	204,168.30	3.56

77	002468	申通快递	203,190.00	3.54
78	688181	八亿时空	189,377.88	3.30
79	000783	长江证券	189,047.00	3.30
80	688128	中国电研	169,617.33	2.96
81	688030	山石网科	167,574.42	2.92
82	600872	中炬高新	157,671.00	2.75
83	688299	长阳科技	155,485.11	2.71
84	002727	一心堂	154,178.00	2.69
85	688023	安恒信息	154,132.00	2.69
86	002110	三钢闽光	150,020.00	2.62
87	000830	鲁西化工	149,817.00	2.61
88	688369	致远互联	146,688.30	2.56
89	688368	晶丰明源	144,930.76	2.53
90	688039	当虹科技	141,596.40	2.47
91	601186	中国铁建	137,035.00	2.39
92	002572	索菲亚	133,828.00	2.33
93	688089	嘉必优	132,549.40	2.31
94	688168	安博通	128,093.76	2.23
95	601336	新华保险	116,510.00	2.03
96	688268	华特气体	115,586.56	2.02
97	688058	宝兰德	114,985.00	2.01

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	601318	中国平安	2,258,632.00	39.39
2	600519	贵州茅台	1,510,618.00	26.35
3	600036	招商银行	1,452,515.00	25.33
4	688036	传音控股	1,364,247.00	23.79
5	601166	兴业银行	922,914.00	16.10
6	688363	华熙生物	876,551.66	15.29
7	601398	工商银行	869,248.00	15.16
8	601939	建设银行	821,722.00	14.33
9	688111	金山办公	753,734.99	13.15
10	601688	华泰证券	707,766.25	12.34
11	600309	万华化学	657,503.00	11.47
12	601988	中国银行	592,429.00	10.33
13	688123	聚辰股份	547,572.73	9.55
14	600276	恒瑞医药	525,585.00	9.17
15	600585	海螺水泥	521,783.00	9.10
16	601288	农业银行	520,320.00	9.08

17	601601	中国太保	517,232.00	9.02
18	688168	安博通	424,378.21	7.40
19	000858	五 粮 液	409,039.00	7.13
20	600436	片仔癀	405,438.00	7.07
21	688139	海尔生物	386,407.96	6.74
22	688030	山石网科	361,615.55	6.31
23	688366	昊海生科	354,588.78	6.18
24	601006	大秦铁路	323,826.00	5.65
25	601916	浙商银行	320,398.28	5.59
26	601077	渝农商行	313,075.74	5.46
27	600900	长江电力	303,314.73	5.29
28	000651	格力电器	295,312.00	5.15
29	688025	杰普特	279,169.38	4.87
30	002304	洋河股份	276,299.00	4.82
31	688268	华特气体	269,652.97	4.70
32	000333	美的集团	269,580.00	4.70
33	688368	晶丰明源	263,358.00	4.59
34	601229	上海银行	261,736.00	4.57
35	688098	申联生物	257,744.15	4.50
36	688089	嘉必优	251,530.00	4.39
37	603589	口子窖	249,643.00	4.35
38	000002	万 科A	247,628.00	4.32
39	601211	国泰君安	244,664.00	4.27
40	600048	保利地产	230,982.00	4.03
41	688369	致远互联	229,504.65	4.00
42	688108	赛诺医疗	227,948.00	3.98
43	688128	中国电研	221,491.00	3.86
44	688068	热景生物	209,919.11	3.66
45	002050	三花智控	207,562.00	3.62
46	688299	长阳科技	205,561.21	3.59
47	688039	当虹科技	204,449.70	3.57
48	600660	福耀玻璃	204,241.00	3.56
49	000001	平安银行	198,986.00	3.47
50	688023	安恒信息	195,432.12	3.41
51	600028	中国石化	194,219.00	3.39
52	688218	江苏北人	192,861.56	3.36
53	688138	清溢光电	192,108.47	3.35
54	002415	海康威视	184,302.00	3.21
55	002142	宁波银行	174,248.00	3.04
56	688037	芯源微	162,891.69	2.84
57	002468	申通快递	162,863.00	2.84

58	688202	美迪西	158,197.39	2.76
59	600872	中炬高新	157,627.79	2.75
60	688058	宝兰德	156,600.00	2.73
61	600377	宁沪高速	154,598.00	2.70
62	688258	卓易信息	150,744.97	2.63
63	001979	招商蛇口	143,853.00	2.51
64	688300	联瑞新材	132,478.06	2.31
65	600009	上海机场	129,949.00	2.27
66	000538	云南白药	129,482.00	2.26
67	600887	伊利股份	129,447.00	2.26
68	600019	宝钢股份	129,153.00	2.25
69	600104	上汽集团	124,255.80	2.17
70	688399	硕世生物	122,880.00	2.14
71	601857	中国石油	118,534.00	2.07
72	300144	宋城演艺	115,777.00	2.02

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	100,663,666.73
卖出股票收入（成交）总额	31,966,032.11

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	35,016,248.50	9.43
	其中：政策性金融债	35,016,248.50	9.43
4	企业债券	5,270,580.70	1.42
5	企业短期融资券	10,057,000.00	2.71
6	中期票据	30,429,000.00	8.20
7	可转债（可交换债）	599,260.70	0.16
8	同业存单	194,115,000.00	52.28
9	其他	-	-
10	合计	275,487,089.90	74.20

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	111907122	19 招商银行 CD122	500,000	48,530,000.00	13.07
2	111910287	19 兴业银行 CD287	500,000	48,530,000.00	13.07
3	111915286	19 民生银行 CD286	500,000	48,530,000.00	13.07

4	111909226	19 浦发银行 CD226	500,000	48,525,000.00	13.07
5	101751014	17 河钢集 MTN008	300,000	30,429,000.00	8.20

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2001	IF2001	-7	-8,620,500.00	-71,940.00	-
公允价值变动总额合计					-71,940.00
股指期货投资本期收益					-458,505.15
股指期货投资本期公允价值变动					-71,940.00

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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。

本基金报告期内，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

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

上海浦东发展银行股份有限公司于 2019 年 6 月 24 日收到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监罚决字〔2019〕7 号），浦发银行因对成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力等违法违规事实被罚款共计 130 万元。

对“19 浦发银行 CD226”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的信用资质,我们认为,该处罚事项未对浦发银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	902,400.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,569,988.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,472,389.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新旺 A	216	1,326,782.93	285,946,078.44	99.78%	639,034.13	0.22%
新旺 C	7	690,807.85	4,835,589.94	100.00%	65.03	-
合计	223	1,306,819.59	290,781,668.38	99.78%	639,099.16	0.22%

注：本表列示"占基金总份额比例"中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末上市基金前十名持有人

新旺 A：

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	申万宏源兆丰四号定向资产管理计划	142,973,039.22	49.89%
2	中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	142,973,039.22	49.89%

3	张沪国	98,818.73	0.03%
4	陶德广	33,340.66	0.01%
5	刘阳	23,000.00	0.01%
6	张霞	20,000.00	0.01%
7	谭彦波	19,764.65	0.01%
8	孙晨	14,822.80	0.01%
9	陈化州	11,265.33	0.00%
10	成月琴	10,414.66	0.00%

新旺 C：

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	建信人寿保险股份有限公司投连平衡收益型	4,835,589.94	100.00%
2	潘威	18.58	0.00%
3	季美	9.29	0.00%
4	马士哲	9.29	0.00%
5	司浩杰	9.29	0.00%
6	许聪	9.29	0.00%
7	张莉清	9.29	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新旺 A	2,559.19	0.00%
	新旺 C	37.16	0.00%
	合计	2,596.35	0.00%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新旺 A	0~10
	新旺 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	新旺 A	0~10
	新旺 C	0
	合计	0~10

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新旺 A	新旺 C
基金合同生效日（2015 年 06 月 19 日）	204,824,716.99	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	572,747.21	4,835,654.97
本报告期基金总申购份额	286,348,627.87	-
减：本报告期基金总赎回份额	336,262.51	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	286,585,112.57	4,835,654.97

§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:

吕涛先生于 2019 年 3 月 6 日离任公司总经理职务，同日起公司董事长张翔燕女士代为履行总经理职务；唐世春先生于 2019 年 6 月 3 日新任公司总经理职务，同日起，唐世春先生离任公司副总经理职务、张翔燕女士不再代为履行总经理职务；陈逸辛先生于 2019 年 8 月 21 日新任公司首席信息官职务;潘颖女士于 2019 年 10 月 31 日新任公司副总经理职务。上述事项已按监管要求备案并公告。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 60,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人收到监管机构关于子公司管理问题对公司采取责令改正措施的决定、对相关责任人采取行政监管谈话措施的决定。基金管理人高度重视，及时向监管机构提交整改报告并已在一个月内完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
国金证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	123,593,273.27	100.00%	114,706.77	100.00%	-

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		基金	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	83,864,202.94	100.00%	23,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

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

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2018 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》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 01 月 02 日
2	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年第四季度报告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 01 月 22 日
3	中信保诚基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 01 月 29 日
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（2019 年第 1 次更新）	公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 02 月 01 日
5	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（2019 年第 1 次更新）	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 02 月 01 日
6	信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 02 月 27 日
7	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定期定额投资最低金额和赎回、转换转出及持有最低份额限制的业务的公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 03 月 21 日
8	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年年度报告	公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 03 月 28 日
9	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年年度报告摘要	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 03 月 28 日
10	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第一季度报告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 04 月 18 日
11	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 04 月 22 日
12	中信保诚基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》及公司网站	2019 年 06 月 17

	部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	(www.citicprufunds.com.cn)	日
13	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 06 月 21 日
14	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 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》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 07 月 01 日
15	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 6 月 28 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 07 月 01 日
16	信诚新旺回报灵活配置混合型基金(LOF)暂停大额申购业务公告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 07 月 09 日
17	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第二季度报告	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 07 月 19 日
18	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（2019 年第 2 次更新）	公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 08 月 02 日
19	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（2019 年第 2 次更新）	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 08 月 02 日
20	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年半年度报告	公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 08 月 26 日
21	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年半年度报告摘要	《中国证券报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2019 年 08 月 26 日
22	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第三季度报告	指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2019 年 10 月 24 日
23	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告	《中国证券报》	2019 年 10 月 24 日
24	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2019 年 12 月 31 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-01-01 至 2019-07-07	4,835,589.94	-	-	4,835,589.94	1.66%
	2	2019-07-08 至 2019-12-31	-	142,973,039.22	-	142,973,039.22	49.06%
	3	2019-07-08 至 2019-12-31	-	142,973,039.22	-	142,973,039.22	49.06%
个人							
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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、中信保诚基金管理有限公司营业执照

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

13.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

13.3 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.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2020 年 04 月 25 日