信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF) 2018年半年度报告摘要

(原信诚惠泽债券型证券投资基金转型)

2018年06月30日
基金管理人:中信保诚基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2018年08月28日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27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。

本报告中财务资料未经审计。

根据基金合同的约定,本基金的封闭期自2016年9月9日起至2018年3月9日止;封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。自2018年3月10日起,本基金封闭期届满转换为上市开放式基金(LOF);自2018年3月12日起,本基金的基金名称变更为"信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)"。原信诚惠泽债券型证券投资基金报告期自2018年1月1日起至2018年3月9日止,信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)报告期自2018年3月10日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金简介

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚惠泽债券(LOF)	
场内简称	信诚惠泽	
基金主代码	165530	
交易代码	-	-
基金运作方式	上市开放式(LOF)	
基金合同生效日	2018年03月10日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,500,215,785.66份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	-	

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	1、资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成,主要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,预测宏观经济的发展趋势等,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等工具的配置比例,动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。 2、固定收益类资产的投资策略 (1)类属资产配置策略 在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。 (2)普通债券投资策略 对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。 1)目标久期控制 本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系,在此基础上结合当前市场状况,预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化,确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时,降低组合久期;当预测未来利率下降时,增加组合久期。 2)期限结构配置 本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化;在上述基础上,本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法,从而确定短、中、长期债券的配置比例。 3)信用利差策略 本基金将通过严格的内部投资风险管理体系,对关注的信用债进行独立的内部评级,并持续动态跟踪调整,以此作为品种选择的基本依据。 本基金将首先根据债券发行人的长期信用评级、对外担保情况、可能面临巨大损失的诉讼、过往融资记录等进行初步的风险排查,并以此计算债券的可能违约率。符合要求的信用债,本基金将采用不同评级序列,对长期和短期债券的信用评级进行初步评估。在初步评级的基础上,进一步将根据行业特征、竞争优势、管理水平、财务质量、抗风险能力等因素对债券的信用评级进行重新调整,并以此作为评级的结果。对于列入考查范围的信用债,本基金将持续动态跟踪,根据债券发行人自身情况的变化,动态调整信用评级。信用利差策略的核心是各项债券信用评级差异能获得充分的利差补偿。本基金将对债券组合总体信用评级水平予以控制,严格控制低评级债券的配置比例;在券种选择上遵循"个券分散、行业分散"的原则。 本基金通过公司内部债券信用评级体系,对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估,确定发行人的信用风险及债券的信用级别。 4)相对价值投资策略 本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较,寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券,并进行投资。 5)杠杆策略 本基金投资于固定收益类资产可采用杠杆策略。本基金将在控制杠杆风险的前提下,适当时机使用资金杠杆以博取利差收益,以增强组合收益。开放期内,本基金资产总值不得超过本基金资产净值的140%;封闭期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的200%。 (3)资产支持证券的投资策略 对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 3、股票投资策略 (1)股票二级市场投资策略 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。 本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2)定量分析:主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标,选取具备选成长性好,估值合理的股票,主要采用的指标包括但不限于:公司收入、未来公司利润增长率等;ROE、ROIC、毛利率、净利率等;PE、PEG、PB、PS等。 (2)定向增发股票投资策略 定向增发是指上市公司向特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人等)非公开发行股票的融资方式。本基金将通过宏观经济、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。 4、其他金融工具的投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。 在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。 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,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*80%+一年期银行定期存款收益率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

注:根据基金合同的约定,本基金的封闭期自2016年9月9日起至2018年3月9日止,自2018年3月10日起,本基金由信诚惠泽债券型证券投资基金封闭期届满转换为信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	李修滨
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 2 基金简介

原信诚惠泽债券型证券投资基金

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚惠泽债券	
场内简称	信诚惠泽	
基金主代码	165530	
交易代码	-	-
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年09月09日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,500,342,040.70份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	-	

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	1、资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成,主要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,预测宏观经济的发展趋势等,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等工具的配置比例,动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。 2、固定收益类资产的投资策略 (1)类属资产配置策略 在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。 (2)普通债券投资策略 对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。 1)目标久期控制 本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系,在此基础上结合当前市场状况,预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化,确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时,降低组合久期;当预测未来利率下降时,增加组合久期。 2)期限结构配置 本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化;在上述基础上,本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法,从而确定短、中、长期债券的配置比例。 3)信用利差策略 本基金将通过严格的内部投资风险管理体系,对关注的信用债进行独立的内部评级,并持续动态跟踪调整,以此作为品种选择的基本依据。 本基金将首先根据债券发行人的长期信用评级、对外担保情况、可能面临巨大损失的诉讼、过往融资记录等进行初步的风险排查,并以此计算债券的可能违约率。符合要求的信用债,本基金将采用不同评级序列,对长期和短期债券的信用评级进行初步评估。在初步评级的基础上,进一步将根据行业特征、竞争优势、管理水平、财务质量、抗风险能力等因素对债券的信用评级进行重新调整,并以此作为评级的结果。对于列入考查范围的信用债,本基金将持续动态跟踪,根据债券发行人自身情况的变化,动态调整信用评级。信用利差策略的核心是各项债券信用评级差异能获得充分的利差补偿。本基金将对债券组合总体信用评级水平予以控制,严格控制低评级债券的配置比例;在券种选择上遵循"个券分散、行业分散"的原则。 本基金通过公司内部债券信用评级体系,对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估,确定发行人的信用风险及债券的信用级别。 4)相对价值投资策略 本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较,寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券,并进行投资。 5)杠杆策略 本基金投资于固定收益类资产可采用杠杆策略。本基金将在控制杠杆风险的前提下,适当时机使用资金杠杆以博取利差收益,以增强组合收益。开放期内,本基金资产总值不得超过本基金资产净值的140%;封闭期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的200%。 (3)资产支持证券的投资策略 对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 3、股票投资策略 (1)股票二级市场投资策略 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。 本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2)定量分析:主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标,选取具备选成长性好,估值合理的股票,主要采用的指标包括但不限于:公司收入、未来公司利润增长率等;ROE、ROIC、毛利率、净利率等;PE、PEG、PB、PS等。 (2)定向增发股票投资策略 定向增发是指上市公司向特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人等)非公开发行股票的融资方式。本基金将通过宏观经济、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。 4、其他金融工具的投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。 在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。 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,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*80%+一年期银行定期存款收益率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

注:根据基金合同的约定,本基金的封闭期自2016年9月9日起至2018年3月9日止,自2018年3月10日起,本基金由信诚惠泽债券型证券投资基金封闭期届满转换为信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年03月10日至2018年06月30日)
本期已实现收益	30,116,313.71
本期利润	21,523,626.70
加权平均基金份额本期利润	0.0143
本期基金份额净值增长率	1.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0094
期末基金资产净值	1,514,323,066.64
期末基金份额净值	1.0094

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。

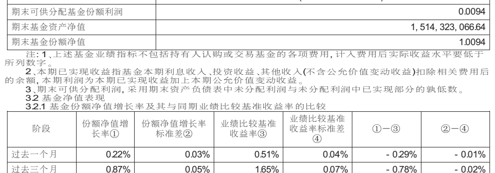
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.22%	0.03%	0.51%	0.04%	-0.29%	-0.01%
过去三个月	0.87%	0.05%	1.65%	0.07%	-0.78%	-0.02%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.38%	0.05%	2.20%	0.07%	-0.82%	-0.02%

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



注:1、本基金转型日期为2018年3月10日,截止报告期末,本基金转型未满一年。

2、本基金建仓期自2016年9月9日至2017年3月9日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

原信诚惠泽债券型证券投资基金

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日至2018年03月09日)			
本期已实现收益	11,547,773.66	-	-	-
本期利润	17,199,122.67	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0115	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.14%	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年03月09日)			
期末可供分配基金份额利润	0.0094			
期末基金资产净值	1,521,432,189.94			
期末基金份额净值	1.0141			

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。

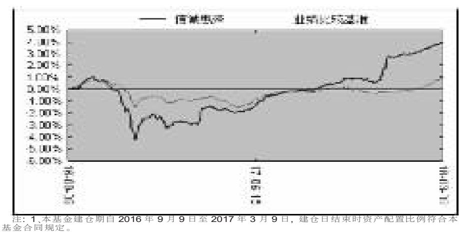
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	0.02%	0.14%	0.01%	0.01%	0.01%
过去三个月	1.14%	0.03%	1.09%	0.03%	0.05%	0.00%
过去六个月	3.45%	0.09%	0.79%	0.04%	2.66%	0.05%
过去一年	5.63%	0.07%	1.66%	0.04%	3.97%	0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.94%	0.12%	0.92%	0.06%	3.02%	0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率*80%+一年期银行定期存款收益率(税后)*20%。

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



注:1、本基金建仓期自2016年9月9日至2017年3月9日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 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2018年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为64只,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)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)、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、信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、信诚新丰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。

截至2018年6月30日,本基金管理人管理的处于清算期中的基金为10只,分别为信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚惠报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、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚至盛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		
杨立春	本基金基金经理,信诚双盈债券基金(LOF)、信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚至诚灵活配置混合基金、信诚新丰回报灵活配置混合基金的基金经理	2016年09月09日	-	7	经济学博士。曾任职于江苏省社会科学院,担任助理研究员。2011年7月加入中信保诚基金管理有限公司,担任固定收益分析师。现任信诚双盈债券基金(LOF)、信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金(LOF)、信诚至诚灵活配置混合基金、信诚新丰回报灵活配置混合基金的基金经理。
缪夏美	本基金基金经理,兼任中信保诚稳鸿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、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。	2017年12月05日	-	1	经济学硕士。曾任职于方正中期期货有限公司,担任宏观研究员;于合众资产管理股份有限公司,担任投资经理助理。2016年8月加入中信保诚基金管理有限公司,历任固定收益部研究员、投资经理。现任信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)、中信保诚稳鸿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、信诚永益一年定期开放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《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来,经济下行压力逐渐增大。一季度微观层面数据显示经济略有下行压力,大宗商品回落明显,PMI表现较差;但宏观数据(包括工业、投资、出口、消费等)仍表现出一定的韧性。宏观和微观出现背离,基本面显示有向下压力。二季度生产与需求相背离的态势持续,投资偏弱:基建投资和房地产投资表现更为明显;出口偏弱主要源于中美贸易战;消费偏弱:棚改逻辑的消费"降级"发生变化,目前政策面对于棚改货币化持一定保留意见,已逐步对棚改政策进行修正。但从生产端看,二季度工业数据尚可,以克强指数为代表的中观数据和利润数据表现较好。随着去杠杆政策的推进,社融数据持续低迷,表外融资持续被压缩,市场对未来由于融资不足导致的经济下行担忧程度逐步提升,边际利好债券市场。

今年以来货币政策整体稳健,但操作上较为友好,近期甚至偏松。其一、4月以来央行累计降准两次,虽目的在于扩大银行表内贷款额度,但实际仍利好债券市场;其二、从短端利率走势看,不管是7天银行间回购利率还是3个SHIBOR的中枢位置,均较前期有所回落,实际今年以来短端利率回落幅度较大;其三、二季度央行货币政策例会上,对流动性的表述从前期的"合理稳定"改为"合理充裕",央行态度边际发生变化。

债券市场方面,一季度利率债和信用债整体上涨,二季度呈现前期调整后期上涨、利率债上涨信用债下跌的态势。1-3月债券市场收益率明显下行,特别部分信用债收益率下行幅度达到100BP。4月降准后债券市场发生调整,主要源于3月以后利率下行幅度较大。但5月开始,市场发生明显分化,信用风险陆续暴露,低等级信用债(地方融资平台债及民企债券)收益率大幅上升,上行幅度超过前期一季度的累计下行幅度,目前部分信用债收益率已高于年初时点。于此同时,在信用风险和中美贸易战双重压力下,权益市场大幅走弱,成为长久期利率债上涨的催化剂。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内,原信诚惠泽债券型证券投资基金(2017/12/31至2018/3/9)份额净值增长率为4.01%,同期业绩比较基准收益率为1.39%,基金超越业绩比较基准2.62%。

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)(2018/3/10至2018/6/30)份额净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准收益率为1.65%,基金落后业绩比较基准0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为左右债券市场的主要因素为国内去杠杆节奏,中美贸易战的进程和激烈程度将成为长期影响因素,市场对其敏感度将逐步降低。未来政策面对于房地产市场的压制仍将持续,地方融资平台资金压力也将持续,社融继续表外回归表内。多重压力下,预计信用风险仍将逐步暴露,后期大概率融资平台债券打破刚兑,个别融资平台的公开市场发行债券有发生违约风险。目前信用风险未见底,仍需观察。利率债方面,后期短端利率将维持相对低位,资金面基本无忧;长端利率长期仍有一定下行空间,但由于短期下行过快,有小幅调整的风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了严格控制。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、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,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、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%。本基金转换为上市开放式基金(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;

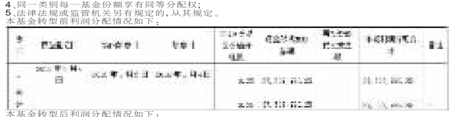
2、封闭期内,本基金的收益分配方式为现金分红;本基金转为上市开放式基金(LOF)后,登记在登记结算系统的基金份额,收益分配方式为现金分红或红利再投资,登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红;

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。

本基金转型前利润分配情况如下:



本基金转型后利润分配情况如下:

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自2018年5月16日起至2018年6月27日止基金份额持有人数量不满两百人。截至报告期末,基金份额持有人数量已满两百人以上,且报告期内未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对信诚惠泽债券型证券投资基金2018年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,中信保诚基金管理有限公司在信诚惠泽债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的信诚惠泽债券型证券投资基金2018年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

6.1 资产负债表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末(2018年06月30日)
资产:		
银行存款		2,308,809.01
结算备付金		3,598,245.73
存出保证金		86,042.42
交易性金融资产		1,986,912,889.00
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,986,912,889.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息		36,597,613.77
应收股利		-
应收申购款		199.65
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		2,029,503,799.58
负债和所有者权益	附注号	本期末(2018年06月30日)
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		513,819,515.21
应付证券清算款		297,803.26
应付赎回款		-
应付管理人报酬		372,533.22
应付托管费		124,177.75
应付销售服务费		-
应付交易费用		37,696.04
应交税费		155,218.12
应付利息		-60,703.29
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		434,492.63
负债合计		515,180,732.94
所有者权益:		
实收基金		1,500,215,785.66
未分配利润		14,107,280.98
所有者权益合计		1,514,323,066.64
负债和所有者权益总计		2,029,503,799.58

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0094元,基金份额总额1,500,215,785.66份。

6.2 利润表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年03月10日-2018年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期(2018年03月10日至2018年06月30日)
一、收入		29,434,257.28
1.利息收入		29,922,972.72
其中:存款利息收入		63,177.67
债券利息收入		29,617,623.06
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		242,171.99
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		8,103,779.90
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		8,103,779.90
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-8,592,687.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		191.67
减:二、费用		7,910,630.58
1. 管理人报酬		1,411,988.05
2. 托管费		470,662.68
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		37,709.19
5. 利息支出		5,768,898.26
其中:卖出回购金融资产支出		5,768,898.26
6.税金及附加		80,501.99
7. 其他费用		140,870.41
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		21,523,626.70
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		21,523,626.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年03月10日-2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2018年03月10日至2018年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,500,342,040.70	21,090,149.24	1,521,432,189.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,523,626.70	21,523,626.70
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)	-126,255.04	-716.93	-126,971.97
其中:1.基金申购款	143,866.28	3,141.48	147,007.76
2.基金赎回款	-270,121.32	-3,858.41	-273,979.73
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)	-	-28,505,778.03	-28,505,778.03
五、期末所有者权益(基金净值)	1,500,215,785.66	14,107,280.98	1,514,323,066.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

吕涛 陈逸辛 刘业

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚惠泽债券型证券投资基金(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[2016]1234号《关于核准信诚惠泽债券型证券投资基金募集的批复》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》和《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,500,207,014.17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(2016)第1204号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》于2016年9月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,500,342,040.70份基金份额,其中认购资金利息折合135,026.53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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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公告》,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《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的封闭期是指自基金合同生效之日起至18个月(含第18个月)后的对应日的期间。本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,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》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、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证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)。基金的投资组合比例为:投资于债券的比例不低于基金资产的80%(但应转换为上市开放式基金(LOF)的流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在封闭期结束前10个工作日、封闭期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制);本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%;转为上市开放式基金(LOF)后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×80%+一年期银行定期存款收益率(税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年3月10日至2018年6月30日止期间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2018年6月30日的财务状况以及2018年3月10日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均按照正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2018年03月10日至2018年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,988.05
其中:支付销售机构的客户维护费	51.33

注:自2016年1月1日至2017年7月31日,支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于信诚惠泽债券型证券投资基金降低管理费率、托管费率和销售服务费率有关事项的议案》,自2017年8月1日起,支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2018年03月10日至2018年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	470,662.68

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比区间未发生销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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,本基金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。

6.4.8.5 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(2018年03月10日至2018年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	2,308,809.01	8,200.57

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率计息。

本基金通过"中信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3,598,245.73元。(无上年度末余额)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金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139,819,515.21元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111783027	17乐山商行CD111	2018年07月05日	95.48	590,000	56,333,200.00
120404	12农发04	2018年07月02日	100.19	650,000	65,123,500.00
111783027	17乐山商行CD111	2018年07月02日	95.48	210,000	20,050,800.00
合计				1,450,000	141,507,500.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本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374,000,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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。

6.4.10 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2018年6月30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属于第二层次的余额为1,986,912,889.00元,无属于第一层次以及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017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) 除以上事项外,截至本报告期末本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告

原信诚惠泽债券型证券投资基金

6.1 资产负债表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金

报告截止日:2018年03月09日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末(2018年03月09日)	上年度末(2017年12月31日)
资产:			
银行存款		3,895,948.54	5,467,559.70
结算备付金		11,832,487.89	16,897,356.61
存出保证金		156,997.10	11,677.94
交易性金融资产		1,794,193,000.00	1,450,645,000.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,794,193,000.00	1,450,645,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	423,711,555.57
应收证券清算款		-	-
应收利息		35,242,077.03	32,644,093.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,845,320,510.56	1,929,377,243.17
负债和所有者权益	附注号	本期末(2018年03月09日)	上年度末(2017年12月31日)
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		323,099,706.70	386,238,786.08
应付证券清算款		-	19,069.85
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		112,450.08	389,377.63
应付托管费		37,483.36	129,792.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		23,927.01	65,689.02
应交税费		85,973.90	-
应付利息		24,335.93	281,309.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		504,443.64	511,600.00
负债合计		323,888,320.62	387,635,624.65
所有者权益:			
实收基金		1,500,342,040.70	1,500,342,040.70
未分配利润		21,090,149.24	41,399,577.82
所有者权益合计		1,521,432,189.94	1,541,741,618.52
负债和所有者权益总计		1,845,320,510.56	1,929,377,243.17

1、报告截止日2018年3月9日,基金份额净值1.0141元,基金份额总额1,500,342,040.70份。

2、本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年3月9日(基金转型前一日)止期间。

6.2 利润表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日-2018年03月09日

单位:人民币元

项目	附注号	本期(2018年01月01日至2018年03月09日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
一、收入		20,125,920.07	45,325,073.59
1.利息收入		14,908,048.72	50,523,372.04
其中:存款利息收入		42,293.82	135,534.20
债券利息收入		13,696,485.13	48,794,936.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,169,269.77	1,592,901.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-433,477.66	-40,791,087.80
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-433,477.66	-40,791,087.80
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		5,651,349.01	35,592,789.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		2,926,797.40	16,847,475.60
1. 管理人报酬		846,596.72	3,642,201.84
2. 托管费		282,198.89	728,440.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		11,304.12	27,164.44
5. 利息支出		1,617,074.79	12,216,750.42
其中:卖出回购金融资产支出		1,617,074.79	12,216,750.42
6.税金及附加		37,565.55	-
7. 其他费用		132,057.33	232,918.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		17,199,122.67	28,477,597.99
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		17,199,122.67	28,477,597.99

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚惠泽债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日-2018年03月09日

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年03月09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)	1,500,342,040.70	41,399,577.82	1,541,741,618.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,199,122.67	17,199,122.67
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)	-	-37,508,551.25	-37,508,551.25
五、期末所有者权益(基金净值)	1,500,342,040.70	21,090,149.24	1,521,432,189.94
项目	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,500,342,040.70	-37,431,727.58	1,462,910,313.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,477,597.99	28,477,597.99
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)	1,500,342,040.70	-8,954,129.59	1,491,387,911.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚惠泽债券型证券投资基金(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[2016]1234号《关于核准信诚惠泽债券型证券投资基金募集的批复》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》和《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,500,207,014.17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(2016)第1204号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》于2016年9月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,500,342,040.70份基金份额,其中认购资金利息折合135,026.53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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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公告》,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《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》的规定,截止2018年3月9日,本基金18个月封闭期届满。自2018年3月10日起,本基金转换为信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF),《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》自2018年3月10日起生效,原《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》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、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证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)。基金的投资组合比例为:投资于债券的比例不低于基金资产的80%(但应转换为上市开放式基金(LOF)的流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在封闭期结束前10个工作日、封闭期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制);本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%;转为上市开放式基金(LOF)后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×80%+一年期银行定期存款收益率(税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年3月9日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2018年3月9日的财务状况以及2018年1月1日至2018年3月9日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均按照正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年03月09日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	846,596.72	3,642,201.84
其中:支付销售机构的客户维护费	48.75	209.54

注:自2016年1月1日至2017年7月31日,支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于信诚惠泽债券型证券投资基金降低管理费率、托管费率和销售服务费率有关事项的议案》,自2017年8月1日起,支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年03月09日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	282,198.89	728,440.37

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比区间未发生销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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,本基金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。

6.4.8.5 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(2018年01月01日至2018年03月09日)		上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	3,895,948.54	7,740.90	1,651,066.27	35,085.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率计息。

本基金通过"中信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2018年3月9日的相关余额为人民币11,832,487.89元。(2017年6月30日相关余额为人民币22,077,679元。)

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018年03月09日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券备注

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年03月09日止,本基金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186,599,706.70元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101451048	14锦江MTN001	2018年03月12日	99.66	200,000	19,932,000.00
101460001	14闽电信MTN001	2018年03月12日	101.36	400,000	40,544,000.00
101461015	14清控MTN001	2018年03月12日	102.02	200,000	20,404,000.00
101555004	15皖出版MTN001	2018年03月12日	100.82	200,000	20,164,000.00
101653021	16中广核MTN001	2018年03月12日	95.95	300,000	28,785,000.00
101652007	16华润MTN001	2018年03月12日	98.19	300,000	29,457,000.00
101753032	17厦国贸集MTN001	2018年03月12日	100.17	300,000	30,051,000.00
合计				1,900,000	189,337,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年03月09日止,本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136,500,000.00元,于2018_年3月12日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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。

6.4.10 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2018年3月9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属于第二层次的余额为1,794,193,000.00元,无属于第一层次以及第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次1,450,645,000.00元,无属于第一层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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2017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(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[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》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	1,986,912,889.00	97.90
	其中:债券	1,986,912,889.00	97.90
	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	5,907,054.74	0.29
7	其他各项资产	36,683,855.84	1.81
8	合计	2,029,503,799.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.2

7.2.3

7.2.4 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	487,698,889.00	32.21
	其中:政策性金融债	76,828,889.00	5.07
4	企业债券	578,060,000.00	38.17
5	企业短期融资券	100,280,000.00	6.62
6	中期票据	610,650,000.00	40.32
7	可转债	-	-
8	同业存单	210,224,000.00	13.88
9	其他	-	-
10	合计	1,986,912,889.00	131.21

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101800327	18常城建MTN003	1,000,000	100,830,000.00	6.66
2	112232	14长证债	1,000,000	100,170,000.00	6.61
3	101800280	18武进经发MTN001	1,000,000	99,490,000.00	6.57
4	111783027	17乐山商行CD111	1,000,000	95,480,000.00	6.31
5	112675	18厦贸Y1	900,000	90,837,000.00	6.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的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

本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。

7.12.3 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	86,042.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,597,613.77
5	应收申购款	199.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,683,855.84

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资,不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 7 投资组合报告

原信诚惠泽债券型证券投资基金

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,794,193,000.00	97.23
	其中:债券	1,794,193,000.00	97.23
	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	-	-
	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	15,728,436.43	0.85
8	其他资产	35,399,074.13	1.92
9	合计	1,845,320,510.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.2 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.3 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.4 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。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.3.2

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	247,929,000.00	16.30
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	254,140,000.00	16.70
5	企业短期融资券	50,045,000.00	3.29
6	中期票据	1,194,527,000.00	78.51
7	可转债(可交换债)	2,000.00	0.00
8	同业存单	47,550,000.00	3.13
9	其他	-	-
10	合计	1,794,193,000.00	117.93

7.6 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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112232	14长证债	1,000,000	99,510,000.00	6.54
2	1382120	13北车集MTN2	900,000	91,035,000.00	5.98
3	143452	18国都G1	700,000	70,259,000.00	4.62
4	101560062	15芜湖建投MTN001	600,000	59,796,000.00	3.93
5	101651023	16中石油MTN002	600,000	59,400,000.00	3.90

7.7 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。

7.8 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

7.9 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权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的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

本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。

7.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,997.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,242,077.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,399,074.13

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资,不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

8.1 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
228	6,579,893.80	1,500,134,000.00	99.99%	81,785.66	0.01%

8.2 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	江苏昆山农村商业银行股份有限公司	1,500,134,000.00	99.99%
2	黄加贵	15,278.17	0.00%
3	王海彬	9,995.35	0.00%
4	张勤	9,994.90	0.00%
5	陈凤娟	9,000.00	0.00%
6	曾涛	5,000.00	0.00%
7	支平	3,000.47	0.00%
8	周艳玲	2,998.47	0.00%
9	姜开芝	2,998.47	0.00%
10	吕静	1,590.26	0.00%

8.3 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	712.86	-

8.4 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

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

本基金本报告期末,本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 8 基金份额持有人信息

原信诚惠泽债券型证券投资基金

8.1 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
238	6,303,958.15	1,500,134,000.00	99.99%	208,040.70	0.01%

8.2 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	江苏昆山农村商业银行股份有限公司	1,500,134,000.00	99.99%
2	黄加贵	15,278.17	0.00%
3	王海彬	9,995.35	0.00%
4	张勤	9,994.90	0.00%
5	陈凤娟	9,000.00	0.00%
6	曾涛	5,000.00	0.00%
7	支平	3,000.47	0.00%
8	周艳玲	2,998.47	0.00%
9	姜开芝	2,998.47	0.00%
10	吕静	1,590.26	0.00%

8.3 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	2,087.67	-

8.4 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

1.本基金本报告期末,本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2.本基金本报告期末,本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

单位:份

项目	信诚惠泽债券(LOF)
基金合同生效日(2018年03月10日)基金份额总额	1,500,342,040.70
本报告期期初基金份额总额	1,500,342,040.70
本报告期基金总申购份额	143,866.28
减:本报告期基金总赎回份额	270,121.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,500,215,785.66

§ 9 开放式基金份额变动

原信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

单位:份

项目	信诚惠泽债券
基金合同生效日(2016年09月09日)基金份额总额	1,500,342,040.70
本报告期期初基金份额总额	1,500,342,040.70
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,500,342,040.70

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		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
长城证券	197,388,675.35	53.33%	-	-	-	-
招商证券	166,040,576.33	44.86%	4,090,134,000.00	36.18%	-	-
中信建投	6,715,276.20	1.81%	7,215,000,000.00	63.82%	-	-

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

原信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		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
长城证券	241,692,972.59	70.75%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
招商证券	99,922,808.22	29.25%	2,784,000,000.00	59.50%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	6,170.60	0.00%	1,895,000,000.00	40.50%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	20180101至20180630	1,500,134,000.00	-	-	1,500,134,000.00	99.99%
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数的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数的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,可能导致部分投资目标不能实现或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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。本基金的封闭期是指自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)至第18个月(含第18个月)后的对应日(若该日为非工作日或无该对应日,则为该日之前的最后一个工作日)的期间。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。本基金的封闭期自2016年9月9日起至2018年3月9日止,自2018年3月10日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。本基金管理人已于2018年3月7日发布的《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回业务的公告》,并于2018年3月9日发布《关于信诚惠泽债券型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)及基金名称变更的公告》,自2018年3月10日起,本基金转换上市开放式基金(LOF),自2018年3月12日起,本基金的基金名称变更为"信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)"并开放日常申购、赎回业务。

2、基金管理人于2018年7月31日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》,并分别于2018年8月1日、2018年8月2日发布了第一次及第二次提示性公告:本基金自2018年8月3日起至2018年8月31日召开基金份额持有人大会,审议《关于信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》。

中信保诚基金管理有限公司
2018年08月28日