

信诚惠盈债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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
报告日期:2018年08月28日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告中可能存在虚假记载、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责任。本半年度报告已于2018年7月27日经基金管理人董事会审议通过,并由基金管理人加盖公章。基金托管人、基金销售机构在对本基金半年度报告进行审核,未发现虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。本报告自2018年8月11日起至6月30日止。

2.1基金基本情况

基金名称	信诚惠盈
基金简称	信诚惠盈
基金代码	003226
交易币种	人民币
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期间	2016年09月02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	58,966,813.34
基金资产规模	58,966,813.34
下属证券投资基金名称	信诚惠盈A 信诚惠盈C
下属证券投资基金简称	信诚惠盈A 信诚惠盈C
下属证券投资基金代码	003226 003227
报告期末下属证券投资基金的总额	58,966,813.34

2.2基金产品说明

本基金的风险等级为中等,并涉及跨境投资,其基金资产的投资组合,由基金管理人根据投资策略进行动态调整。

1. 资产配置策略
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、衍生品及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金通过考察宏观经济运行态势、利率走势、流动性状况、信用状况、研究各资产类别的收益率和风险,制定和调整资产配置方案,及时调整投资组合,追求超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。

2. 股票投资策略
本基金股票投资采取自上而下和自下而上的投资策略。自上而下:本基金通过宏观经济、行业景气度、政策、估值等因素,自上而下地分析并选择具有投资价值的行业,在行业内部选择具有投资价值的个股。自下而上:本基金通过个股的财务指标、估值水平、成长性、流动性等因素,自下而上地选择具有投资价值的个股。本基金股票投资采取分散化投资策略,分散投资于具有投资价值的个股,追求超越业绩比较基准的投资回报。

3. 固定收益投资策略
本基金固定收益投资采取自上而下和自下而上的投资策略。自上而下:本基金通过宏观经济、利率走势、流动性状况、信用状况、研究各资产类别的收益率和风险,制定和调整资产配置方案,及时调整投资组合,追求超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。自下而上:本基金通过债券的收益率、流动性、信用状况等因素,自下而上地选择具有投资价值的债券。本基金固定收益投资采取分散化投资策略,分散投资于具有投资价值的债券,追求超越业绩比较基准的投资回报。

2.3基金管理人、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
住所	北京市朝阳区望京东路2号	北京市朝阳区朝阳门内大街2号
法定代表人	张勇	李庆萍
总经理	张勇	李庆萍
客服电话	400-666-0088	95555
网址	http://www.citicfund.com.cn	http://www.citicbank.com

3.1主要会计数据和财务指标

项目	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)	本报告期末	本报告期末
3.1.1 期间损益表			
利润总额	61,554.56	19,927.38	19,927.38
净利润	38,196.50	9,682.52	9,682.52
归属于基金份额持有人的净利润	38,196.50	9,682.52	9,682.52
基本每股收益	0.0007	0.0002	0.0002
3.1.2 资产负债表			
期末总资产	60,981,933.13	60,981,933.13	60,981,933.13
期末净资产	60,981,933.13	58,966,813.34	58,966,813.34

3.2基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②		
过去一个月	-0.38%	0.17%	-0.23%	0.13%	-0.15%	0.04%
过去三个月	-0.52%	0.16%	-0.73%	0.13%	-1.27%	0.03%
过去六个月	0.55%	0.19%	2.28%	0.13%	-1.73%	0.00%
过去一年	0.51%	0.17%	3.43%	0.10%	-1.22%	0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效以来	3.33%	0.17%	3.78%	0.11%	-0.67%	0.08%

3.2.2 基金合同成立以来的基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 基金投资组合报告

3.3.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆出资金	535,711.03	0.84
7	其他资产	1,126,306.11	1.78
8	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.2 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	股票	61,745,404.10	97.38
2	债券	61,745,404.10	97.38
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.3 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.4 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.5 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.6 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.7 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.8 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.9 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.10 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.11 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.12 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.13 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.14 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.15 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.16 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.17 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.18 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.19 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.20 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.21 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.22 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84
7	合计	63,407,421.24	100.00

3.3.23 基金资产组合构成

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	61,745,404.10	97.38
2	固定收益投资	61,745,404.10	97.38
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他	535,711.03	0.84