信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金 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

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。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信诚新丰	
场内简称	-	
基金主代码	004518	
交易代码	-	-
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年07月07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	3,184,867.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚新丰A	信诚新丰B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	004518	004519
报告期末下属分级基金的份额总额	3,051,781.54份	133,086.18份

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	1.资产配置策略 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。 2.股票投资策略 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。 3.固定收益投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。 4.股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。 5.权证投资策略 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。 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	本基金的业绩比较基准为：30%×沪深300指数收益率+70%×中债综合(全价)指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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	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	haozhou@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

§3主要财务指标和基金净值表现

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-2018年06月30日)	
	信诚新丰A	信诚新丰B
本期已实现收益	6,734,807.51	31,816.48
本期利润	1,618,338.61	-6,207.89
加权平均基金份额本期利润	0.0238	-0.0229
本期基金份额净值增长率	1.92%	1.62%
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	0.0639	0.0653
期末基金资产净值	3,246,903.55	141,771.56
期末基金份额净值	1.064	1.065

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.本期已实现收益指期末基金本期利息收入、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

信诚新丰A

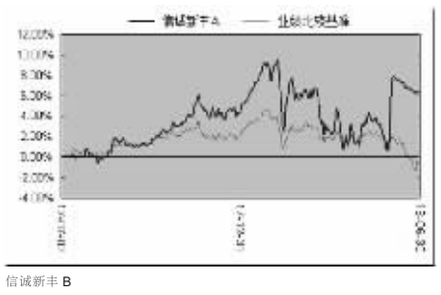
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.03%	1.01%	-2.09%	0.38%	7.12%	0.63%
过去三个月	3.60%	0.80%	-2.32%	0.34%	5.92%	0.46%
过去六个月	1.92%	0.77%	-2.44%	0.34%	4.36%	0.43%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.40%	0.57%	-0.48%	0.28%	6.88%	0.29%

信诚新丰B

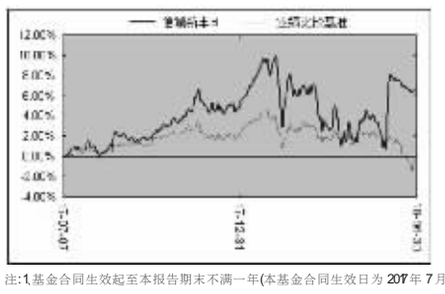
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.03%	1.02%	-2.09%	0.38%	7.12%	0.64%
过去三个月	3.30%	0.81%	-2.32%	0.34%	5.62%	0.47%
过去六个月	1.62%	0.77%	-2.44%	0.34%	4.06%	0.43%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.50%	0.58%	-0.48%	0.28%	6.98%	0.30%

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

信诚新丰A



信诚新丰B



注：1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2017年7月7日)。

2.本基金建仓期自2017年7月7日至2018年1月7日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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。

4.12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、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金、信诚至诚灵活配置混合基金的基金经理	2017年07月07日	-	6	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、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金、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。

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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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

2018年上半年以来，受中美贸易争端的影响，国内宏观经济数据整体走弱，二季度的PMI月度数据虽然出现小幅回升，表明经济具有一定韧性，但需求端仍明显走弱。投资方面，随着宏观经济转向追求高质量增长，基建投资增速下滑明显。此外，地产投资保持平稳，制造业小幅回升，而民间投资则持续下滑；消费方面，受汽车价格拖累，消费数据创近年来新低；外贸方面，出口保持平稳，进口表现偏强。目前看来，全球经济协同性降低对外贸领域的冲击尚不明显，但贸易争端对经济的进一步影响可能在随后的几个季度内逐渐显性化。考虑到当前的经济基本面，以及中美贸易争端仍悬而未决且存在波折，由此引致的对经济基本面悲观预期将会是未来资本市场的一个重要影响变量，国内货币政策存在维持宽松的基础，而财政政策也可能往积极财政转变。

虽然经济数据整体走弱，但截至6月末，除了维持货币市场的宽松格局，整体金融环境并无明显的放松迹象。随着资管新规、流动性管理办法和大额风险管理办法等陆续出台，M2和社会融资规模增速持续回落，若表外融资进一步下降，表内的信贷投放并不能完全弥补表外收缩的幅度，实体经济整体融资成本仍会不断上升，中小企业的融资环境持续恶化，一直处于紧绷状态的信用风险也难以出现缓释，由此在利率强、信用弱的格局很难发生改变。要改变这一局面，必须在财政政策方面出现积极变化，货币政策也需要加大对小微企业的政策倾斜。近几个月以来，资本市场对信用风险的担忧情绪仍较浓厚，虽然利率债发行量处于较高水平，信用债月度净融资却不断下滑，二季度以来已多次出现债券发行取消现象，债券市场对民营企业和落后地区平台的违约潮风险保持较高的关注度。

报告期内对信诚新丰回报基金规模缩减，目前组合以现金及短期安全性资产为主，权益维持低仓位，组合无杠杆。未来新丰将视负债端的资金情况，重新制定相应的投资策略。组合注重固定收益资产的流动性和安全性，对低评级债券的信用风险保持高度警惕，通过分散化投资和加大信用风险筛查力度，严控信用风险。

4.4.2报告期内的基金业绩表现

本报告期内，本基金A、B份额净值增长率分别为1.92%和1.62%，同期业绩比较基准收益率为-2.44%，基金A、B份额超越业绩比较基准分别为4.36%和4.06%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体看来，经济基本面、金融市场环境、货币政策都有助于推动债市收益率下行，但考虑到收益率水平已处于低位，未来进一步下行的空间将极到压制。但可预期的是，由于信用风险无明显改观，以往的信用债跟随利率走势且信用利差逐步缩窄的情景，将大概率发生在高等级信用债上，低资质发行人的利差仍存在走阔的风险。一方面，货币边际上放松但表内仍受到资本和信贷政策的限制，表外转表内难度仍较大，再融资压力短期难缓解，信用风险仍趋上升；另一方面，信用风险担忧缓解之前，预计中低等级信用债流动性仍会较差，流动性溢价将居高不下。由此判断，短期债的市场走势将维持利率债震荡慢牛、信用债走势结构性分化的格局。此外，在流动性宽松确定的前提下，息差与杠杆具有确定性收益，但息差将会不断被削弱。信用利差继续走势分化，重点关注微观主体的违约风险事件，提防股市大幅震荡下股权质押风险形成的负反馈。

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.《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2.本基金收益分配方式分两种现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3.同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

4.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金于本报告期未进行过利润分配，该处理符合本基金利润分配原则。

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1月23日起至2018年6月29日止基金份额持有人数不满两百人，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§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，对信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金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新丰回报灵活配置混合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新丰回报灵活配置混合型证券投资基金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(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体：信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金

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		3,268,026.97
结算备付金		38,318.44
存出保证金		20,277.56
交易性金融资产		311,696.00
其中：股票投资		311,696.00
基金投资		-
债券投资		-
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		910.48
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		3,639,229.45
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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,663.03
应付托管费		692.93
应付销售服务费		33.34
应付交易费用		24,026.69
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		224,138.35
负债合计		250,554.34
所有者权益：		
实收基金		3,184,867.72
未分配利润		203,807.39
所有者权益合计		3,388,675.11
负债和所有者权益总计		3,639,229.45

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额3,184,867.72份，其中A类基金份额3,051,781.54份，份额净值1.064元；B类基金份额133,086.18份，份额净值1.065元。

6.2利润表

会计主体：信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)
一、收入		2,163,652.88
1.利息收入		806,471.85
其中：存款利息收入		9,242.16
债券利息收入		754,997.92
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		42,231.77
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		6,459,023.45
其中：股票投资收益		6,573,057.85
基金投资收益		-
债券投资收益		-120,252.81
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		6,218.41
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-5,154,493.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		52,650.85
减：二、费用		551,522.16
1.管理人报酬		212,782.68
2.托管费		88,659.43
3.销售服务费		431.01
4.交易费用		138,438.61
5.利息支出		1,622.23
其中：卖出回购金融资产支出		1,622.23
6.税金及附加		1,576.18
7.其他费用		108,012.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,612,130.72
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,612,130.72

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年可比区间。

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期(2018年01月01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)	180,529,407.42	7,933,698.24	188,463,105.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,612,130.72	1,612,130.72
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)	-177,344,539.70	-9,342,021.57	-186,686,561.27
其中：1.基金申购款	9,511,823.62	760,779.66	10,272,603.28
2.基金赎回款	-186,856,363.32	-10,102,801.23	-196,959,164.55
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)	3,184,867.72	203,807.39	3,388,675.11

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年可比区间。

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

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚新丰回报混合基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)正监许可[2016]594号《关于准予信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]3002号《关于信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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200,844,997.96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(2017)第423号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,849,016.64份基金份额，其中认购资金利息折合4,098.68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《信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费、申购费与销售服务费等费率收费差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购或申购时收取认购费或申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购或申购时不收取认购费或申购费、但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为B类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚新丰回报灵活配置混合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、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(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为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%。本基金的业绩比较基准为：30%×沪深300指数收益率+70%×中债综合(全价)指数收益率。

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>》、中国证券投资基金协会(以下简称“中国基金协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚新丰回报灵活配置混合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1月1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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、登记机构、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。

6.4.