信诚稳利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

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6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信诚稳利	
场内简称	-	
基金主代码	003121	
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08月04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	1,497,781,441.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚稳利A	信诚稳利C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	003121	003130
报告期末下属分级基金的份额总额	1,497,765,997.77份	15,443.50份

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金主要通过投资于精选的优质债券,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	1.资产配置策略 本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 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、相对价值配置等策略进行主动投资。 3.资产支持证券的投资策略 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来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。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种	
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)	
	信诚稳利A	信诚稳利C
本期已实现收益	27,375,435.35	884.28
本期利润	48,263,115.17	871.74
加权平均基金份额本期利润	0.0322	0.0188
本期基金份额净值增长率	3.26%	3.52%
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	0.0193	0.0212
期末基金资产净值	1,526,656,906.85	15,771.43
期末基金份额净值	1.0193	1.0212

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

信诚稳利A

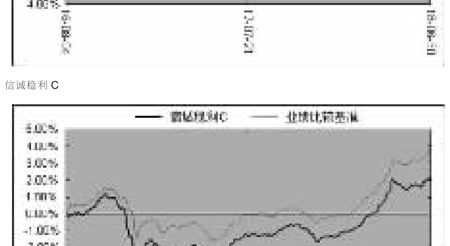
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.22%	0.03%	0.61%	0.05%	-0.39%	-0.02%
过去三个月	1.25%	0.09%	1.97%	0.09%	-0.72%	-
过去六个月	3.26%	0.07%	4.04%	0.07%	-0.78%	-
过去一年	3.42%	0.06%	4.20%	0.06%	-0.78%	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.93%	0.09%	3.85%	0.07%	-1.92%	0.02%

信诚稳利C

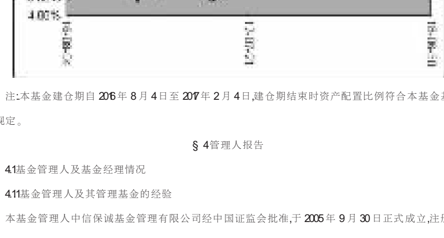
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.42%	0.06%	0.61%	0.05%	-0.19%	0.01%
过去三个月	1.52%	0.09%	1.97%	0.09%	-0.45%	-
过去六个月	3.52%	0.07%	4.04%	0.07%	-0.52%	-
过去一年	3.69%	0.06%	4.20%	0.06%	-0.51%	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.12%	0.09%	3.85%	0.07%	-1.73%	0.02%

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

信诚稳利A



信诚稳利C



注:本基金建仓期自2016年8月4日至2017年2月4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(LOF)、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		
宋海娟	本基金基金经理,信诚季季定期支付债券基金、信诚三得益债券基金、信诚增强收益债券基金(LOF)、信诚稳健债券基金、信诚惠盈债券基金、信诚稳益债券基金、信诚稳瑞债券基金、信诚景瑞债券基金、信诚稳丰债券基金、信诚稳悦债券基金、信诚稳泰债券基金、信诚稳鑫债券基金的基金经理。	2016年08月04日	-	13	工商管理硕士。曾任职于长信基金管理有限责任公司,担任债券交易员;于光大保德信基金管理有限公司,担任固定收益类投资经理。2013年7月加入中信保诚基金管理有限公司。现任信诚季季定期支付债券基金、信诚三得益债券基金、信诚增强收益债券基金(LOF)、信诚稳利债券基金、信诚稳健债券基金、信诚惠盈债券基金、信诚稳益债券基金、信诚稳瑞债券基金、信诚景瑞债券基金、信诚稳丰债券基金、信诚稳悦债券基金、信诚稳泰债券基金、信诚稳鑫债券基金的基金经理。

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《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》、《信诚稳利债券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

宏观方面,2018年上半年全球经济复苏趋缓。美国经济持续复苏,可谓一枝独秀;欧日英等其他发达经济体复苏趋缓,新兴经济体整体复苏趋弱。风险方面,美国面临中长期的债务累积风险,欧元区下半年将面临三大潜在风险,英国退欧谈判仍存风险,新兴市场金融风险或有所蔓延。货币政策方面,美联储预计下半年再加息两次。欧元区经济复苏趋缓,预计加息将延至2019年二、三季度。

国内市场,为了保持流动性充裕,今年以来,央行已经实施了三次定向降准。首先是1月25日开始实施的普惠金融定向降准,然后是4月25日实施以部分降准资金置换MLF的定向降准,最后就是6月20日国务院常务会议刚刚提出增强小微信贷供给能力的定向降准。由于央行近期的政策调整,不断为市场注入流动性,银行间市场利率中枢较2017年末高点出现回落。

回顾2018年上半年,债市由熊市转向牛市的拐点确认,信用债迎来了2016年四季度以来最大的一波行情。产业债信用利差则呈现分化态势,AAA和AA+主体信用利差稳中有降,AA主体信用利差震荡上行,高等级全面逆袭。如果不考虑流动性因素,2017年信用债投资的最佳策略是持有短久期低等级信用债,长久期高等级在2017年回报率最低。而2018年以来出现了反转,高等级集体逆袭,且长久期回报更佳;低等级则遭遇信用风险和流动性风险双杀。本轮违约潮最大的不同在于驱动因素是融资环境趋紧导致的再融资风险上升,信用溢价上行成为影响信用利差的重要因素,低等级信用债因风险更大而上行程度更大。

本基金在报告期内资产规模相对稳定,组合内固定收益类资产主要以短期信用债为主,二季度加仓了长久期利率债。信用方面,考虑到再融资压力最大的地产、建筑、城投等行业风险仍待释放,违约潮或仍将延续,高等级信用债信用利差受益于流动性改善将跟随利率债回落,而低等级信用债信用风险仍高,信用利差保护明显不足,仍有上行压力。在资产配置上,我们依然会坚持选择高等级信用债,保持适度的杠杆。当资金面比较宽松时,可以提高组合的杠杆;当资金面趋紧的时候,机动降杠杆。持仓上择机配置,安全为先,力争为投资人赚取收益。

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3.26%和3.52%,同期业绩比较基准收益率为4.04%,基金A、C份额落后业绩比较基准分别为0.78%和0.52%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,预计全球经济基本面继续温和震荡,市场担忧将延续。美国经济基本面强劲,美元走强和美国利率抬升可能进一步吸引资本回流美国,外需改善停滞和前期的汇率走强相对不利于欧日,新兴市场方面仍受益于相对强劲的商品价格。国内伴随结构性去杠杆推进,预计下半年投资增速仍将下行但结构分化,其中制造业、房地产投资增速下行,而基建投资增速上行。在持续扩大内需政策刺激下,下半年消费增长仍有潜力。

经济金融数据方面,三季度经济下行压力仍然较大,虽然宽信用政策短期对市场预期有影响,但是预计政策放松带来的基建增速和社融增速的反弹至少到四季度才能见效。债券市场,在宽财政、宽信用、稳货币的政策信号逐渐明晰后,将继续关注可能的政策出台,结构性去杠杆目标下,预计政策边际宽松将以定向方式为主,并非“大水漫灌”。当前信贷和非标定向放松,财政继续“开前门”,更多的是定向支持实体融资,而地方政府隐性债务、以平台为代表的国企违规举债及房地产融资仍然管控较严。后期政策预计将继续以定向形式推出,以满足实体经济、地方政府及城投平台的合理融资需求。

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,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每季度至少分配一次;

4.同一类别内的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。

本基金于本期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

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,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)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,对信诚稳利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稳利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稳利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(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:信诚稳利债券型证券投资基金

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)	上年度末(2017年12月31日)
资产:			
银行存款		3,410,441.00	5,871,699.90
结算备付金		9,510,480.50	2,538,688.63
存出保证金		109,057.69	463.03
交易性金融资产		1,875,090,000.00	1,577,976,000.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,875,090,000.00	1,577,976,000.00
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		3,300,000.00	210,203,635.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		28,147,034.93	25,560,813.00
应收股利		-	-
应收申购款		31.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,919,567,045.19	1,822,151,299.56
负债和所有者权益	附注号	本期末(2018年06月30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		388,099,515.00	337,000,000.00
应付证券清算款		3,300,000.00	5,831,183.53
应付赎回款		485.02	-
应付管理人报酬		375,723.56	376,568.41
应付托管费		150,289.44	150,627.38
应付销售服务费		1.74	1.24
应付交易费用		5,562.54	2,930.63
应交税费		195,866.50	-
应付利息		323,526.28	-157,795.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		443,396.83	540,000.00
负债合计		392,894,366.91	343,743,515.30
所有者权益:			
实收基金		1,497,781,441.27	1,497,780,332.69
未分配利润		28,891,237.01	-19,372,548.43
所有者权益合计		1,526,672,678.28	1,478,407,784.26
负债和所有者权益总计		1,919,567,045.19	1,822,151,299.56

注:截止本报告期末,基金份额总额1,497,781,441.27份。下属两级基金:信诚稳利A类基金份额1,497,765,997.77份,份额净值1.0193元;信诚稳利C类基金份额15,443.50份,份额净值1.0212元。

6.2利润表

会计主体:信诚稳利债券型证券投资基金

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)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
一、收入		58,009,233.84	16,564,255.96
1.利息收入		37,296,993.02	32,521,902.75
其中:存款利息收入		127,294.68	1,537,890.98
债券利息收入		36,908,149.19	30,559,680.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		261,549.15	424,330.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-175,963.63	702,749.50
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-175,963.63	702,749.50
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)		20,887,667.28	-16,660,398.63
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		537.17	2.34
减:二、费用		9,745,246.93	8,193,825.61
1.管理人报酬		2,240,888.07	2,178,767.67
2.托管费		896,355.16	871,507.10
3.销售服务费		23.24	8.73
4.交易费用		7,729.62	4,525.00
5.利息支出		6,266,322.82	4,922,621.61
其中:卖出回购金融资产支出		6,266,322.82	4,922,621.61
6.税金及附加		112,482.09	-
7.其他费用		221,445.93	216,395.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		48,263,986.91	8,370,430.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		48,263,986.91	8,370,430.35

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚稳利债券型证券投资基金

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)	1,497,780,332.69	-19,372,548.43	1,478,407,784.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,263,986.91	48,263,986.91
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)	1,108.58	-201.47	907.11
其中:1.基金申购款	302,169.97	4,704.10	306,874.07
2.基金赎回款	-301,061.39	-4,905.57	-305,966.96
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)	1,497,781,441.27	28,891,237.01	1,526,672,678.28
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)	1,497,781,282.06	-29,881,060.40	1,467,900,221.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,370,430.35	8,370,430.35
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)	36,751.92	-678.75	36,073.17
其中:1.基金申购款	50,250.94	-919.11	49,331.83
2.基金赎回款	-13,499.02	240.36	-13,258.66
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)	1,497,818,033.98	-21,511,308.80	1,476,306,725.18

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

信诚稳利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]1565号《关于核准信诚稳利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《信诚稳利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1000,399,748.03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1022号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》于2016年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1000,399,748.03份基金份额,认购资金未产生利息。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《信诚稳利债券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、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费的,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,且对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的,称为C类基金份额。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率。

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》、《信诚稳利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《关于资产管理产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资产管理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

本基金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。

6.4.8.1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。

6.4.8.1.2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06月30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	2,240,888.07	2,178,767.67
其中:支付销售机构的客户维护费	39.68	16.68

注: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X0.30%/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06月30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	896,355.16	871,507.10

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0.12%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X0.12%/当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中信保诚基金,再由中信保诚基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值X0.10%/当年天数。

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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

本基金在本报告期末与其他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

注: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。本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未投资本基金情况。

信诚稳利A

份额单位:份

关联方名称	本期末(2018年06月30日)		上年度末(2017年12月31日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信银行	-	-	1,497,758,084.12	100.00%

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06月30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	3,410,441.00	52,984.07	41,621.69	38,342.32

注:1.本基金的活期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。

2.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9,510,480.50元。(2017年6月30日余额为:人民币8,862,781.04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。

6.4.8.7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

本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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,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189,999,515.00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
011758106	17中建材SCP020	2018年07月03日	100.64	1,000,000	100,640,000.00
071800015	18国泰君安CP003	2018年07月03日	100.12	1,000,000	100,120,000.00
合计				2,000,000	200,760,000.00

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年06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198,100,000.00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第二层次的余额为1,875,090,000.00元,无属于第一层次及第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次1,577,976,000.00元,无属于第一层级及第三层次的余额)。

(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,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017年12月31日:无)。

(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。

(3)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。

§7投资组合报告

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	1,875,090,000.00	97.68
	其中:债券	1,875,090,000.00	97.68
	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	3,300,000.00	0.17
	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	12,920,921.50	0.67
7	其他各项资产	28,256,123.69	1.47
8	合计	1,919,567,045.19	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。

7.4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

1.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。

2.本基金本报告期内无股票买入交易。

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

1.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。

2.本基金本报告期内无股票卖出交易。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

1.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。

2.本基金本报告期内无股票买卖交易。

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	80,068,000.00	5.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	586,305,000.00	38.40
5	企业短期融资券	773,291,000.00	50.65
6	中期票据	338,051,000.00	22.14
7	可转债	-	-
8	同业存单	97,375,000.00	6.38
9	其他	-	-
10	合计	1,875,090,000.00	122.82

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	011800106	18杭金投SCP002	1,000,000	100,710,000.00	6.60
2	011758104	17中航资本SCP003	1,000,000	100,660,000.00	6.59
3	011758106	17中建材SCP020	1,000,000	100,640,000.00	6.59
4	041800110	18中化农化CP001	1,000,000	100,370,000.00	6.57
5	011800404	18徐工SCP001	1,000,000	100,350,000.00	6.57

7.7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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体均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	109,057.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,147,034.93
5	应收申购款	31.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,256,123.69

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报告期末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

本基金本报告期末前十名股票中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

8.1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
信诚稳利A	140	10,698,328.56	1,497,758,084.12	100.00%	7,913.65	0.00%
信诚稳利C	122	126.59	-	-	15,443.50	100.00%
合计	262	5,716,723.06	1,497,758,084.12	100.00%	23,357.15	0.00%

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;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

8.2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	信诚稳利A	-	-
	信诚稳利C	100.00	0.65%
	合计	100.00	0.65%

注:本表列示“占总份额比例”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。

8.3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.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的基金份额。

2.期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.4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

单位:份

项目	信诚稳利A	信诚稳利C
基金合同生效日(2016年08月04日)基金份额总额	1,000,253,947.03	145,801.00
本报告期期初基金份额总额	1,497,764,770.33	15,562.36
本报告期基金总申购份额	54,185.81	247,984.16
减:本报告期基金总赎回份额	52,958.37	248,103.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,497,765,997.77	15,443.50

§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

报告期内基金管理人、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、托管人的托管业务部门及其相关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

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	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	28,732,861.80	100.00%	10,081,700,000.00	100.00%	-	-
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20180105,20180108至20180630	1,497,758,084.12	-	-	1,497,758,084.12	100.00%
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。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无

中信保诚基金管理有限公司

2018年08月28日