

信诚稳鑫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

11重要提示及目录
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。

21基金基本情况
基金名称:信诚稳鑫债券型证券投资基金
基金代码:004754
基金管理人:中信保诚基金管理有限公司

22基金产品说明
基金的投资目标:本基金投资于具有良好流动性的信用类固定收益类金融工具,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

23基金管理人及基金托管人
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

3主要会计数据和财务指标
3.1主要会计数据和财务指标
3.2基金净值表现
3.3基金业绩比较基准

Table with 5 columns: 项目, 本报告期末, 本报告期初, 本报告期末, 本报告期初. Rows include 总资产, 净资产, 基金份额净值, etc.

Table with 5 columns: 项目, 本报告期末, 本报告期初, 本报告期末, 本报告期初. Rows include 基金份额净值增长率, 基金份额净值增长率标准差, etc.

Table with 5 columns: 项目, 本报告期末, 本报告期初, 本报告期末, 本报告期初. Rows include 基金份额净值增长率, 基金份额净值增长率标准差, etc.

Table with 5 columns: 项目, 本报告期末, 本报告期初, 本报告期末, 本报告期初. Rows include 基金份额净值增长率, 基金份额净值增长率标准差, etc.

注:1.本基金建仓期自2005年11月27日至2007年5月26日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。
2.自2016年10月1日起,本基金业绩比较基准由“中信标普300指数收益率\*90%+中证国债指数收益率\*10%”变更为“中信标普300指数收益率\*90%+中证国债指数收益率\*10%”。

41基金管理人及其管理基金的经验
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。

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(LQF)、信诚新视野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、信诚鑫阿尔法股票型证券投资基金、信诚惠惠货币市场基金、信诚诚鑫定期开放债券型证券投资基金、信诚诚鑫中短债债券型证券投资基金、信诚诚鑫兴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的基金为0只,分别为信诚季季定发支付债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚季多策略灵活配置混合型证券投资基金(LQF)、信诚至兴灵活配置混合型证券投资基金。

注: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。

42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《信诚稳鑫债券型证券投资基金合同》、《信诚稳鑫债券型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。

43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》以及公司制定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的实际行动落实公平交易管理的各项要求。

44报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
宏观方面,2018年上半年,中国经济复苏趋缓,美国经济持续复苏,可谓一枝独秀,其他经济体则陷入停滞或衰退。

45管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望
展望下半年,预计中国经济基本保持平稳,市场或将维持震荡。美国经济基本面稳定,美元指数和美国利率抬升可能进一步抑制资本回流美国。

46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基金管理服务,基金管理人针对估值程序进行了严格控制。

2.基金管理人估值业务的职责分工
基金管理人估值业务的职责分工明确,所有业务操作均需经复核方可生效。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人估值人员的估值业务均采用双人双岗,所有业务操作均需经复核方可生效。

4.基金经理参与或决定投资的程度
基金经理参与或决定投资的程度,基金经理不直接参与或决定投资。

48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况的说明
本报告期内,本基金管理人未发生因基金份额持有人数量或基金资产净值触及预警线的情形。

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 其他资产, 其他负债, 未分配利润, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 其他资产, 其他负债, 未分配利润, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 其他资产, 其他负债, 未分配利润, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资, etc.

Table with 5 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 期末余额, 期初余额. Rows include 其他资产, 其他负债, 未分配利润, etc.

理人为增值税一般纳税人,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。

(2)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。

(3)对基金取得的国债利息收入,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。

(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)本基金的城镇土地使用税、教育附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税的适用比例计算缴纳。

6.41关联方关系
6.41.1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。

6.42关联方报酬
6.42.1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。

6.43销售服务费
6.43.1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。

6.44报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.44.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.45报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.45.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.46报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.46.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.47报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.47.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 国债, 地方政府债, 金融债, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 数量, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 10002, 2 100021, 3 100022, etc.