信诚至瑞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。

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	信诚至瑞	
场内简称	-	
基金主代码	003432	
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10月21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	100,040,377.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚至瑞A	信诚至瑞C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	003432	003433
报告期末下属分级基金的份额总额	68,086,859.70份	31,953,517.41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.证券公司短期公司债券投资策略 本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。 5.资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。 6.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。 7.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	30%×沪深300指数收益率+70%×中证综合债指数收益率。	
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	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

§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)	
	信诚至瑞A	信诚至瑞C
本期已实现收益	4,006,569.41	1,445,770.59
本期利润	583,581.19	-765,923.18
加权平均基金份额本期利润	0.0064	-0.0211
本期基金份额净值增长率	-2.08%	-2.13%
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	0.0597	0.0577
期末基金资产净值	72,151,935.24	33,796,556.15
期末基金份额净值	1.0597	1.0577

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

信诚至瑞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	-1.54%	0.49%	-1.91%	0.38%	0.37%	0.11%
过去三个月	-1.22%	0.45%	-1.68%	0.34%	0.46%	0.11%
过去六个月	-2.08%	0.47%	-1.19%	0.35%	-0.89%	0.12%
过去一年	3.16%	0.37%	1.84%	0.29%	1.32%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.97%	0.29%	3.67%	0.26%	2.30%	0.03%

本基金的业绩比较标准为:30%×沪深300指数收益率+70%×中证综合债指数收益率

信诚至瑞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	-1.55%	0.48%	-1.91%	0.38%	0.36%	0.10%
过去三个月	-1.25%	0.45%	-1.68%	0.34%	0.43%	0.11%
过去六个月	-2.13%	0.47%	-1.19%	0.35%	-0.94%	0.12%
过去一年	3.06%	0.37%	1.84%	0.29%	1.22%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.77%	0.29%	3.67%	0.26%	2.10%	0.03%

本基金的业绩比较标准为:30%×沪深300指数收益率+70%×中证综合债指数收益率

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

信诚至瑞A

信诚至瑞C

注:本基金建仓期自2016年10月21日至2017年4月21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。

4.1.2 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
提云涛	本基金基金经理,信诚至优灵活配置混合基金、、信诚至选灵活配置混合基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金(LOF)、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至泰灵活配置混合基金的基金经理,中信保诚基金管理有限公司数量投资总监	2016年10月21日	-	18	经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司,担任研究部分析师;于东方证券有限责任公司,担任研究所所长助理;于上海申银万国证券研究所,历任宏观策略部副总监、金融工程部总监;于平安资产管理有限责任公司,担任量化投研部总经理;于中信证券股份有限公司,担任研究部金融工程总监。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司,担任数量投资总监。现兼任信诚至优灵活配置混合基金、信诚至瑞灵活配置混合基金、信诚至选灵活配置混合基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金(LOF)、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至泰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《信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至瑞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

上半年,在扩大内需的政策导向下国内宏观经济运行平稳,GDP增速为6.8%,内需拉动经济的作用不断提高,经济结构继续优化。从结构看,第二、三产业的占比继续提高,与新技术相关的产业快速发展。从投资结构看,高技术投资增长较快;从消费结构看,消费升级类商品增长较快。从外部经济环境看,海外经济整体趋稳,但是因为货物贸易的顺差大幅收窄和服务贸易逆差扩大,净出口对GDP的拉动作用下降。

金融市场,在流动性管理办法、资管新规等的出台,M2、全社会融资总额增速持续回落。虽然之后央行的货币政策逐步趋暖,市场资金面呈逐步宽松趋势。债券市场,利率债的收益率在不断下降,但市场对信用风险的担忧呈加重趋势,信用利差进一步走阔,企业融资成本不断上升。股票市场,整体先扬后抑呈下跌趋势。沪深300在1月下旬达到4403年的上半年高点,之后开始下跌;中证500、中证1000也呈现相似的走势。到6月底,沪深300下跌13.85%,中证500下跌16.53%,中证1000下跌20.08%。从行业结构看,金融、科技、消费在不同时期有所表现,但上半年大多呈现不同程度的下跌。

上半年,本基金采用量化与主动结合的方法。从盈利能力、偿债能力、盈利增长、估值、动量反转等多维度考察选择个股,同时注意上市公司的长期盈利能力,并注意分散投资控制个股风险。债券投资采用"短久期、高评级"策略,以获得稳定收益。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金A、C份额净值增长率分别为-2.08%和-2.13%,同期业绩比较基准收益率为-1.19%,基金A、C份额落后业绩比较基准分别为0.89%和0.94%。

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,经过上半年规范,政策调整空间变大。在积极的财政政策和稳健的货币政策下,经济整体将继续保持稳健增长的势头,内需对经济的拉动作用也将增强。从外部经济环境看,中美贸易战可能加剧,出口对经济的拉动作用将减弱。债券市场,随着政策的结构性调整,预计信用风险担忧进一步加剧的可能性减小;股票市场,经过2季度的调整,市场已经处于估值底部,进一步下跌的空间不大。从结构上看,具有持续内生盈利增长能力低估值公司将更具投资价值。本基金下半年将继续采用量化与主动结合的方法,在预期长期盈利增长稳定的公司中选择投资标的,同时注意分散投资控制个股风险。债券投资采用"短久期、高评级"策略,以获得稳定收益。

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、每一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。

本基金于本报告期末进行过利润分配,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,对信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金2018上半年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真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至瑞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至瑞灵活配置混合型证券投资基金2018上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:信诚至瑞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)	上年度末(2017年12月31日)
资产:			
银行存款		522,011.17	218,564.14
结算备付金		129,693.98	1,159,717.05
存出保证金		20,555.50	65,294.38
交易性金融资产		109,459,078.00	243,025,030.35
其中:股票投资		40,603,738.00	73,982,430.35
基金投资		-	-
债券投资		68,855,340.00	169,042,600.00
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		-	95,507.51
应收利息		1,308,635.06	1,920,151.72
应收股利		-	-
应收申购款		100.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		111,440,073.71	246,484,265.15
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		4,500,000.00	32,200,000.00
应付证券清算款		498,294.55	-
应付赎回款		-	214,890.23
应付管理人报酬		54,813.44	111,959.07
应付托管费		9,135.56	18,659.83
应付销售服务费		2,847.63	3,638.51
应付交易费用		6,871.06	8,559.70
应交税费		2,504.21	-
应付利息		-1,402.62	27,665.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		418,518.49	450,000.00
负债合计		5,491,582.32	33,035,373.22
所有者权益:			
实收基金		100,040,377.11	197,293,685.58
未分配利润		5,908,114.28	16,155,206.35
所有者权益合计		105,948,491.39	213,448,891.93
负债和所有者权益总计		111,440,073.71	246,484,265.15

注:截止本报告期末,基金份额总额100,040,377.11份。下属两级基金:信诚至瑞A的基金份额净值1.0597元,基金份额总额68,086,859.70份;信诚至瑞C的基金份额净值1.0577元,基金份额总额31,953,517.41份。

6.2 利润表

会计主体:信诚至瑞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)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
一、收入		690,796.33	23,874,822.50
1.利息收入		1,803,171.80	8,659,318.13
其中:存款利息收入		8,599.58	681,978.31
债券利息收入		1,761,786.99	7,670,970.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,785.23	306,369.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4,520,839.95	-1,289,339.47
其中:股票投资收益		5,385,064.76	4,481,561.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,540,182.31	-7,015,436.35
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		675,957.50	1,244,535.72
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,634,681.99	16,392,596.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,466.57	112,246.93
减:二、费用		873,138.32	3,198,383.58
1. 管理人报酬		415,405.45	1,906,384.54
2. 托管费		69,234.23	317,730.87
3. 销售服务费		19,587.62	41,583.03
4. 交易费用		82,657.13	304,871.27
5. 利息支出		91,486.14	422,519.46
其中:卖出回购金融资产支出		91,486.14	422,519.46
6.税金及附加		1,736.70	-
7. 其他费用		193,031.05	205,294.41
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-182,341.99	20,676,438.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-182,341.99	20,676,438.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚至瑞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)	197,293,685.58	16,155,206.35	213,448,891.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-182,341.99	-182,341.99
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)	-97,253,308.47	-10,064,750.08	-107,318,058.55
其中:1.基金申购款	2,986,144.46	343,889.52	3,330,033.98
2.基金赎回款	-100,239,452.93	-10,408,639.60	-110,648,092.53
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)	100,040,377.11	5,908,114.28	105,948,491.39

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)	667,235,869.27	-6,401,367.23	660,834,502.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,676,438.92	20,676,438.92
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)	-226,765,618.61	-2,323,115.41	-229,088,734.02
其中:1.基金申购款	106,476,542.92	-46,617.19	106,429,925.73
2.基金赎回款	-333,242,161.53	-2,276,498.22	-335,518,659.75
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)	440,470,250.66	11,951,956.28	452,422,206.94

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

信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金(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]1914号《关于准予信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《信诚至瑞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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集667,200,349.43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1296号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年10月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为667,235,869.27份基金份额,其中认购资金利息折合35,519.84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《信诚至瑞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、申购费用而不计提销售服务费的,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《信诚至瑞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、证券公司短期公司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、货币市场工具、银行存款、同业存单、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%。基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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》、《信诚至瑞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

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日以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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e)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。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

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。

6.4.8.1 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	415,405.45	1,906,384.54
其中:支付销售机构的客户维护费	115,696.99	593,472.47

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0.60%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X0.60%/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	69,234.23	317,730.87

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X0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日) 当期发生的基金应支付的销售服务费 信诚至瑞A	信诚至瑞C	合计
中信银行	-	2,417.75	2,417.75
中信保诚基金管理有限公司	-	10,488.37	10,488.37
合计	-	12,906.12	12,906.12
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费 信诚至瑞A	信诚至瑞C	合计
中信银行	-	9,729.92	9,729.92
中信保诚基金管理有限公司	-	15.63	15.63
合计	-	9,745.55	9,745.55

注:支付基金销售机构的销售服务费信诚至瑞C按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,信诚至瑞A不支付销售服务费,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:

信诚至瑞C日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值X0.10%/当年天数。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

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06月30日) 期末余额	当期利息收入	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
中信银行	522,011.17	4,985.25	1,045,124.51	22,877.72

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转用存款账户"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129,693.98元。(2017年6月30日余额为2,772,023.49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

本基金在本报告期内及上年度在承销期内均未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

6.4.9 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

本基金本期末无因认购新发/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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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4,500,000.00元,于2018年7月3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一层次的余额为40,603,738.00元,属于第二层次的余额为68,855,340.00元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次72,896,233.90元,第二层次170,128,796.45元,无属于第三层次的余额)。

(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: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。

§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	40,603,738.00	36.44
	其中:股票	40,603,738.00	36.44
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	68,855,340.00	61.79
	其中:债券	68,855,340.00	61.79
	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	651,705.15	0.58
7	其他各项资产	1,329,290.56	1.19
8	合计	111,440,073.71	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	649,000.00	0.61
C	制造业	14,768,344.00	13.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	681,108.00	0.64
E	建筑业	608,736.00	0.57
F	批发和零售业	359,600.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	2,625,840.00	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	19,724,510.00	18.62
K	房地产业	1,186,600.00	1.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,603,738.00	38.32

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,800	5,705,388.00	5.39
2	601398	工商银行	565,000	3,005,800.00	2.84
3	601318	中国平安	50,000	2,929,000.00	2.76
4	600036	招商银行	100,000	2,644,000.00	2.50
5	600887	伊利股份	90,000	2,511,000.00	2.37
6	601939	建设银行	380,000	2,489,000.00	2.35
7	601166	兴业银行	139,300	2,005,920.00	1.89
8	600660	福耀玻璃	60,000	1,542,600.00	1.46
9	601211	国泰君安	101,000	1,488,740.00	1.41
10	601988	中国银行	390,000	1,407,900.00	1.33

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600018	上港集团	1,619,124.00	0.76
2	600009	上海机场	1,488,626.00	0.70
3	600377	宁沪高速	1,471,279.00	0.69
4	600519	贵州茅台	766,066.00	0.36
5	600362	江西铜业	757,492.00	0.35
6	600183	生益科技	439,056.88	0.21
7	600380	健康元	390,455.00	0.18
8	600436	片仔癀	347,740.00	0.16
9	600196	复星医药	183,220.00	0.09
10	603156	养元饮品	166,828.87	0.08
11	600901	江苏租赁	155,843.75	0.07
12	002236	大华股份	108,970.00	0.05
13	600004	白云机场	96,256.00	0.05
14	601838	成都银行	89,465.01	0.04
15	600535	天士力	87,721.00	0.04
16	601828	美凯龙	79,425.72	0.04
17	603680	今创集团	47,171.67	0.02
18	603516	淳中科技	16,458.32	0.01
19	601138	工业富联	13,770.00	0.01
20	603356	华菱精工	12,650.19	0.01

注: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。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600436	片仔癀	4,105,433.67	1.92
2	600009	上海机场	3,905,685.00	1.83
3	000538	云南白药	3,609,601.00	1.69
4	600377	宁沪高速	2,812,847.00	1.32
5	600018	上港集团	1,688,320.00	0.79
6	600085	同仁堂	1,666,627.00	0.78
7	000333	美的集团	1,515,269.00	0.71
8	000513	丽珠集团	1,432,048.00	0.67
9	600036	招商银行	1,186,204.59	0.56
10	000651	格力电器	1,093,325.00	0.51
11	000999	华润三九	1,067,599.00	0.50
12	600837	海通证券	1,066,650.00	0.50
13	002415	海康威视	1,044,815.66	0.49
14	601939	建设银行	853,862.00	0.40
15	601988	中国银行	802,807.00	0.38
16	002242	九阳股份	711,746.45	0.33
17	600887	伊利股份	696,161.00	0.33
18	002304	洋河股份	681,012.00	0.32
19	600993	马应龙	680,925.00	0.32
20	000400	许继电气	648,921.00	0.30

注: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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	8,337,619.41
卖出股票收入(成交)总额	39,306,778.28

注: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。

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	5,411,340.00	5.11
	其中:政策性金融债	5,411,340.00	5.11
4	企业债券	9,816,000.00	9.26
5	企业短期融资券	15,090,000.00	14.24
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	38,538,000.00	36.37
9	其他	-	-
10	合计	68,855,340.00	64.99

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	111810164	18兴业银行CD164	200,000	19,388,000.00	18.30
2	111713105	17浙商银行CD105	200,000	19,150,000.00	18.07
3	011800150	18南京新港SCP001	100,000	10,063,000.00	9.50
4	136865	16新希01	100,000	9,816,000.00	9.26
5	018005	国开1701	54,000	5,411,340.00	5.11

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

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

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,"其他衍生工具-股指期货投资"与"证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款",符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将"其他衍生工具-股指期货投资"的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

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

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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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

中国银行保险监督管理委员会网站于2018年5月4日发布的行政处罚信息公开表显示,兴业银行股份有限公司于2018年4月19日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监银罚决字〔2018〕1号),兴业银行因(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规等12项违法违规事实被银保监会罚款5870万元。

对兴业银行的投资决策程序的说明:本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质,我们认为,该处罚事项未对兴业银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

中国银行保险监督管理委员会网站于2018年5月4日发布的行政处罚信息公开表显示,招商银行股份有限公司于2018年2月12日收到中国银监会行政处罚决定书(银监罚决字〔2018〕1号),招商银行因(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本等等14项违法违规事实被银保监会罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

对招商银行的投资决策程序的说明:本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质,我们认为,该处罚事项未对招商银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余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	20,555.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,308,635.06
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,329,290.56

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的情况。

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
信诚至瑞A	643	105,889.36	-	-	68,086,859.70	100.00%
信诚至瑞C	186	171,793.10	18,589,124.34	58.18%	13,364,393.07	41.82%
合计	829	120,675.97	18,589,124.34	18.58%	81,451,252.77	81.42%

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	信诚至瑞A	679,559.24	1.00%
	信诚至瑞C	100.01	0.00%
	合计	679,659.25	0.68%

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

项目	份额级别	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	信诚至瑞A	50~100
	信诚至瑞C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚至瑞A	50~100
	信诚至瑞C	-
	合计	50~100

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	信诚至瑞A	信诚至瑞C
基金合同生效日(2016年10月21日)基金份额总额	543,061,971.90	124,173,897.37
本报告期期初基金份额总额	158,452,698.48	38,840,987.10
本报告期基金总申购份额	923,383.80	2,062,760.66
减:本报告期基金总赎回份额	91,289,222.58	8,950,230.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	68,086,859.70	31,953,517.41

§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、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

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
长城证券	1	16,410,295.04	34.87%	15,282.76	40.54%	-
中泰证券	1	12,426,979.11	26.41%	9,087.82	24.11%	-
光大证券	1	10,614,979.63	22.55%	7,762.70	20.59%	-
东方证券	2	4,746,935.88	10.09%	3,471.27	9.21%	-
西部证券	2	2,863,594.50	6.08%	2,094.03	5.55%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	24,577,580.82	45.74%	66,400,000.00	23.02%	-	-
中泰证券	22,572.95	0.04%	-	-	-	-
光大证券	13,706,183.70	25.51%	38,500,000.00	13.34%	-	-
东方证券	15,429,627.22	28.71%	51,000,000.00	17.68%	-	-
西部证券	-	-	132,600,000.00	45.96%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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

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