信诚优质纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年09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

报告送出日期:2018年10月24日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚优质纯债债券	
基金主代码	550018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年02月07日	
报告期末基金份额总额	64,301,605.64份	
投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金主要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、流动性管理、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。	
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	
下属分级基金的基金简称	信诚优质纯债债券A	信诚优质纯债债券B
下属分级基金的交易代码	550018	550019
报告期末下属分级基金的份额总额	50,645,004.63份	13,656,601.01份

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。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	信诚优质纯债债券A 报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)	信诚优质纯债债券B 报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-200,192.37	-24,530.25
2.本期利润	-678,741.34	-19,001.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0053	-0.0014
4.期末基金资产净值	51,402,348.66	13,876,326.00
5.期末基金份额净值	1.015	1.016

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

信诚优质纯债债券A

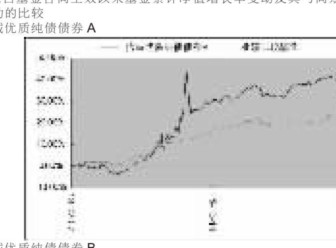
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	0.23%	1.32%	0.06%	-1.32%	0.17%

信诚优质纯债债券B

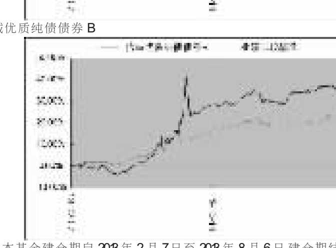
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.20%	0.23%	1.32%	0.06%	-1.52%	0.17%

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

信诚优质纯债债券A



信诚优质纯债债券B



注:1、本基金建仓期自2013年2月7日至2013年8月6日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由"中信标普全债指数收益率"变更为"中证综合债指数收益率"。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王国强	本基金基金经理,兼任固定收益总监,信诚至远灵活配置混合基金、信诚年年有余定期开放债券基金、信诚理财28日盈债券基金的基金经理	2014年02月11日	-	19	管理学硕士。曾任职于浙江国际信托投资公司,从事投行业务部债券发行;于健桥证券股份有限公司,担任债券研究员;于银河基金管理有限公司,担任机构理财部研究员。2006年8月加入中信保诚基金管理有限公司,担任固定收益分析师。现任固定收益总监,信诚至远灵活配置混合基金、信诚年年有余定期开放债券基金、信诚优质纯债债券基金、信诚理财28日盈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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同》、《信诚优质纯债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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长转弱,需求放缓压力显现。投资受信用紧缩等因素影响,增速明显放缓。中美贸易战开打,关税的提升加剧外需下行压力,我国加大对外开放,降低除美国以外的其他国家商品的关税水平,对冲中美贸易的风险。居民收入增长乏力以及居民杠杆水平较高等因素抑制消费增长,汽车等可选消费明显下滑。消费物价维持较低水平,服务类项目和能源价格小幅上涨将推动物价温和上涨。7月央行资管新规细则出台,监管政策适度调整,实体经济信用紧缩局面得到适度缓解。央行货币政策由稳健中性转宽松,7月5日降准0.5个百分点,同时运用MLF工具对银行放贷和购买信用债提供流动性支持,进一步缓释信用紧缩风险。三季度货币市场资金宽松,资金利率下降到较低水平,1个月期Shibor利率从4%下降到2.7%左右。债市总体呈现牛市格局,中证综合债涨幅1.32%。利率债受地方债发行偏多影响,利率呈震荡态势,10年国债上行18BP,金融债利率下行5BP。信用债继续延续分化态势,AA+以上高等级信用债强于低等级信用债,3年AA+级评级以上的信用债利率下行40BP,AA以下低等级信用债收益率持平。三季度新增违约企业数量和违约债券金额创历史新高,导致部分民企债券收益率上行明显,信用债利差明显扩大。

三季度,本基金重点配置长久期利率债和城投债,并对利率债进行了波段操作,提升收益水平。3季度可转债机会少,无可转债配置。本季度本基金规模变化较大,造成较大的交易冲击成本,故收益低于基准涨幅。本基金特别注重信用风险管理,通过严格的内部信用评级体系,有效甄别和防范信用风险。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A、B份额净值增长率分别为0.00%和-0.20%,同期业绩比较基准收益率为1.32%,基金A、B份额落后业绩比较基准分别为1.32%和1.52%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,149,706.51	59.27
	其中:债券	85,149,706.51	59.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	50,869,868.58	35.41
8	其他资产	7,655,800.34	5.33
9	合计	143,675,375.43	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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股票投资。

5.2.2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的股票。

5.3报告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

5.3.1报告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。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	33,019,500.00	50.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,622,297.60	17.80
	其中:政策性金融债	6,562,797.60	10.05
4	企业债券	39,460,850.70	60.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,047,058.21	1.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,149,706.51	130.44

5.5报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180006	18附息国债06	200,000	20,160,000.00	30.88
2	019547	16国债19	150,000	12,859,500.00	19.70
3	018005	国开1701	65,360	6,562,797.60	10.05
4	124552	PR如金鑫	100,000	6,108,000.00	9.36
5	124812	PR长交02	100,000	6,106,000.00	9.35

5.6报告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。

5.7报告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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8报告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。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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

中国银河证券股份有限公司于2018年7月5日收到中国人民银行出具的《行政处罚决定书》(银反洗罚决字[2018]第4号),对公司未按照规定履行客户身份识别义务的行为处人民币50万元罚款,与身份不明的客户进行交易的行为处人民币50万元罚款,合计处人民币100万元罚款。

对"14银河G2"的投资决策程序说明: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,该处罚事项未对银河证券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,本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,712.00
2	应收证券清算款	6,149,179.60
3	应收股利	-
4	应收利息	1,473,609.38
5	应收申购款	1,299.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,655,800.34

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	513,677.11	0.79

5.11.5报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限情况。

5.11.6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。

§6基金中基金

6.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

6.2当期交易及持有基金产生的费用

6.3本报告期持有的基金发生的重大影响事件

§7开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚优质纯债债券A	信诚优质纯债债券B
报告期期初基金份额总额	171,726,872.20	14,661,052.28
报告期期间基金总申购份额	71,903.60	201,838.71
减:报告期期间基金总赎回份额	121,153,771.17	1,206,289.98
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	50,645,004.63	13,656,601.01

总申购份额含红利再投、份额强增和转换入份额;总赎回份额含份额强减、转换出份额。

§8基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1基金管理人持有本基金份额变动情况

8.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§10影响投资者决策的其他重要信息

10.1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	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	20180701至20180930	91,574,175.82	-	47,000,000.00	44,574,175.82	69.32%
机构	2	20180701至20180820	51,677,706.92	-	51,677,706.92	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

（前四列为"报告期内持有基金份额变化情况"，后两列为"报告期末持有基金情况"）

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份额总份额的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。

10.2影响投资者决策的其他重要信息

无

§11备查文件目录

11.1备查文件目录

1、信诚优质纯债债券型证券投资基金相关批准文件

2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程

3、信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同

4、信诚优质纯债债券型证券投资基金招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

11.2存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

11.3查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2018年10月24日

信诚优胜精选混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年09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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚优胜精选混合
基金主代码	550008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年08月26日
报告期末基金份额总额	1,468,303,213.04份
投资目标	通过投资于具有积极变化特征的上市公司,追求高于基准的超额收益,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金定位为混合型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在此前提下,本基金将根据MVRS模型,综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内作战术性资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 本基金认为,上市公司的长期发展遵循"优胜劣汰"的规律。企业应根据所处的外部环境变化而不断积极变化。精选该类"优胜"上市公司,能够实现基金长期稳定增值的投资目标。同时,上市公司的积极变化会依次在管理人态度、公司财务数据和股票价格上先后反映。在积极变化反映到股票价格之前,介入该类上市公司的投资,能够创造超额收益。 鉴于此,本基金的股票投资将以"自下而上"的精选策略为主,以甄别产生积极变化的上市公司。
业绩比较基准	80%×中信标普A股综合指数收益率+20%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-31,036,530.61
2.本期利润	-166,659,349.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1135
4.期末基金资产净值	1,758,022,629.09
5.期末基金份额净值	1.197

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。

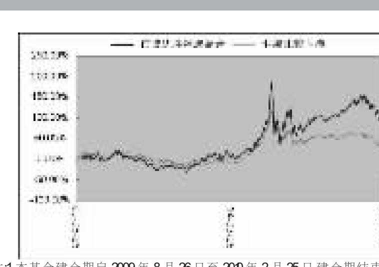
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-8.70%	1.43%	-3.16%	1.01%	-5.54%	0.42%

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



注:1、本基金建仓期自2009年8月26日至2010年2月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由"中信标普A股综合指数收益率*80%+中信全债指数收益率*20%"变更为"中信标普A股综合指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%"。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王睿	本基金基金经理,信诚基金研究副总监职务,信诚精萃成长混合基金基金经理。	2015年04月30日	-	8	经济学硕士。曾任职于上海甫瀚咨询管理有限公司,担任咨询师;于美国国际集团(AIG),担任投资部研究员。2009年10月加入中信保诚基金管理有限公司,历任研究员、专户投资经理。现任研究副总监,信诚优胜精选混合基金、信诚精萃成长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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚优胜精选混合型证券投资基金基金合同》、《信诚优胜精选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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度指数分化较大,个股大部分以下跌为主。上证指数在7月初延续二季度下跌态势后在月底一度反弹至2900点上方,但此后中美贸易冲突进一步升级,美国预期对其余2000亿中国贸易品加征关税,人民币对美元汇率出现快速下跌,同时国内经济数据始终没有起色,市场对于经济预期进一步悲观,指数陆续刷新年内新低,一度跌至2644点,距离16年熔断后的2638点仅一步之遥。9月底指数出现触底迹象,并在中美贸易冲突第一阶段落地以及政策预期放松的催化下出现了一波较快反弹。此轮触底反弹的主力是权重板块,个股表现明显弱于指数。整个三季度,上证指数微跌0.92%,但深成指下跌超过10%,创业板指下跌12%,中小板指下跌11%。分板块看,三季度银行,保险,石油石化等权重板块有非常明显的超额受益,一方面此类板块受到贸易战以及房地产周期影响较小,另一方面,流动性较好,在反弹的过程中受到增量资金的青睐。相比之下,家电,家居等地产后周期板块受到房地产调控预期影响跌幅较大;安防,苹果产业链等受到中美贸易冲突影响估值受到极大挤压,处于持续的下跌中;医药股在二季度冲高后受到带量招标等压制价格的预期影响也出现了较大幅度回调。整个市场交易量也非常低迷,两市交易量较长时期处于3000亿以下,一度下降至2000亿附近,投资者信心比较脆弱,避险情绪浓厚。我们认为目前的市场行为反映了对于短期后市经济以及国际关系较为悲观的预期,但是因为中长期经济新动力还没有出现,中美的贸易冲突可能长期化,震荡筑底会是目前市场可能性较大的状态。

展望四季度,我们认为经济数据会陆续如预期般变差,包括之前比较坚挺的地产数据;但是随着信用体系,财政体系以及货币体系的调控效果慢慢体现,一些对于短期经济走势的预期可能会发生变化,政策对于经济和贸易的对冲可能是四季度资本市场的主基调。目前沪深300的大部分股票估值水平已经接近于历史低位,但基本面明显好于当时情况,估值的修复可能带来四季度一波反弹机会。但同时,还是防范石油价格高企带来的输入型通胀风险以及中美利差收窄带来的汇率波动风险。

我们会较为谨慎的参与市场反弹,选择三季报和年报预期较正面,估值水平较合理的行业及公司的买入机会;重点关注通胀预期带来的投资机会;长期看好先进制造等细分领域。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-8.70%,同期业绩比较基准收益率为-3.16%,基金落后业绩比较基准5.54%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,451,170,741.19	82.01
	其中:股票	1,451,170,741.19	82.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	317,729,711.33	17.96
8	其他资产	629,562.36	0.04
9	合计	1,769,530,014.88	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	-	-
C	制造业	912,044,728.12	51.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	177,076,497.00	10.07
G	交通运输、仓储和邮政业	32,600,000.00	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,345,000.00	1.38
J	金融业	101,654,550.88	5.78
K	房地产业	187,850,000.00	10.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	19,965.19	0.00
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	15,580,000.00	0.89
S	综合	-	-
	合计	1,451,170,741.19	82.55

5.2.2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。

5.3报告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

5.3.1报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁易购	6,499,300	87,610,564.00	4.98
2	002050	三花智控	6,299,910	83,914,801.20	4.77
3	601155	新城控股	3,000,000	78,570,000.00	4.47
4	000858	五粮液	900,000	61,155,000.00	3.48
5	601601	中国太保	1,699,902	60,363,520.02	3.43
6	002271	东方雨虹	3,869,940	56,230,228.20	3.20
7	600690	青岛海尔	3,300,000	54,516,000.00	3.10
8	601607	上海医药	2,599,921	53,298,380.50	3.03
9	600048	保利地产	4,000,000	48,680,000.00	2.77
10	002236	大华股份	3,206,900	47,365,913.00	2.69

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5报告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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6报告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投资。

5.7报告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。

5.8报告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投资。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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

5.9.2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

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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

本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	532,258.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	66,554.16
5	应收申购款	30,750.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	629,562.36

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告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。

5.11.6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。

§6基金中基金

6.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

6.2当期交易及持有基金产生的费用

6.3本报告期持有的基金发生的重大影响事件

§7开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚优胜精选混合
报告期期初基金份额总额	1,467,824,065.77
报告期期间基金总申购份额	1,962,002.07
减:报告期期间基金总赎回份额	1,482,854.80
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,468,303,213.04

§8基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1基金管理人持有本基金份额变动情况

8.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§10影响投资者决策的其他重要信息

10.1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	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	20180701至20180930	1,171,079,429.74	-	-	1,171,079,429.74	79.76%
个人	-	-	-	-	-	-	-

（前四列为"报告期内持有基金份额变化情况"，后两列为"报告期末持有基金情况"）

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份额总份额的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。

10.2影响投资者决策的其他重要信息

无

§11备查文件目录

11.1备查文件目录

1、(原)信诚优胜精选股票型证券投资基金相关批准文件

2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程

3、信诚优胜精选混合型证券投资基金基金合同

4、信诚优胜精选混合型证券投资基金招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

11.2存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

11.3查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2018年10月24日

信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

2018年09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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚全球商品主题(QDII-FOF-LOF)
场内简称	信诚商品
基金主代码	165513
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	51,482,251.13份
投资目标	通过在全球范围内积极配置商品类相关资产,在有效分散风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将根据宏观及商品分析进行资产配置,并通过全球范围内精选基金构建组合,以达到预期的风险收益水平。
业绩比较基准	标准普尔高盛商品总收益指数
风险收益特征	本基金主要投资全球商品类基金,商品价格具有较高的波动性,因此,本基金属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	-
境外投资顾问中文名称	-
境外资产托管人英文名称	-
境外资产托管人中文名称	-

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。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	信诚全球商品主题(QDII-FOF-LOF) 报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	976,854.09
2.本期利润	1,603,742.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293
4.期末基金资产净值	26,826,664.77
5.期末基金份额净值	0.521

1、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。

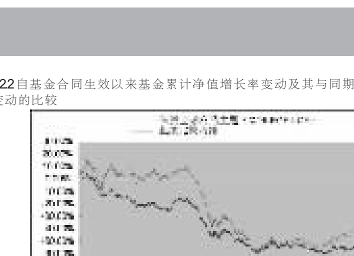
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

阶段	净值增长率①	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
2018年第3季度	6.54%	1.09%	1.34%	0.99%	5.20%	0.10%

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



注:本基金建仓期自2011年12月20日至2012年6月20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基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘儒明	本基金基金经理,兼任海外投资副总监、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)的基金经理。	2013年01月15日	-	24	工学硕士。曾任职于永昌证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富邦证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于金复华证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于台湾工银证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富国基金管理有限公司,担任境外投资部经理。2009年6月加入中信保诚基金管理有限公司。现任海外投资副总监,信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)及信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)的基金经理。
李舒禾	本基金基金经理	2011年12月20日	-	14	商学硕士。曾任职于台湾证券投资信托股份有限公司,历任宝来全球ETF稳健组合证券投资信托基金经理、宝来黄金期货信托基金经理。2011年3月加入中信保诚基金管理有限公司。现任信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)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。

4.4公平交易专项说明

4.4.1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。

4.4.2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)。

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年第三季,基金基准高盛商品指数(美金)上涨1.34%,其中能源分类指数(美金)上涨4.31%,贵金属分类指数(美金)下跌5.44%,基础金属分类指数(美金)下跌6.46%,农产品分类指数(美金)下跌5.42%,人民币兑美元贬值3.6%,收在6.86人民币兑美金,标普500指数(美金)上涨7.2%,美国十年期公债上扬20bps,收在3.0612%。基金过去半年能源部位平均仓位64%,贵金属7.24%,基础金属5.7%,农产品1.9%,其他投资2.36%,贡献17bps;现金平均仓位18%。基金第三季上涨6.54%,基准含汇上涨5.36%,超越基准1.18%,主要超配能源得到了超额报酬。

未来投资策略还是着重于原油的投资。在供应方面,虽然旺季已过,Midland页岩油因为油管瓶颈无法供应到市场,且利率高企不利于页岩油商筹措资金,美国产量增长有限;委内瑞拉因为金融崩坏,开采无法进行,所以产量续降;OPEC虽然增产,截至九月底的剩余产能只剩下240万桶/日,离2008年全球剩余产能200万桶只剩下一步之遥,扣除伊朗的产能全球供应非常吃紧,对于油价上涨压力巨大。在需求方面,美国经济甚好提供今明年需求主要动力。做多原油主要风险点在于美国释放战备储油及美国对伊朗不制裁。

在贵金属方面,因为油价上扬及美国经济良好推升长端美债收益率上行达三年新高,且对美元升值提供动力,美元美债利率双涨非常不利于贵金属的表现。在基础金属方面,受到中国贸易战及降准仍看淡。农产品看跌深反弹行情,天气无助益。

本报告期内,本基金份额净值增长率为6.54%,同期业绩比较基准收益率为1.34%,基金超越业绩比较基准5.20%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金自2016年8月22日起至2018年9月28日止基金资产净值低于五千万元,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投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	21,821,951.96	79.40
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,803,687.68	10.20
8	其他资产	2,857,686.05	10.40
9	合计	27,483,325.69	100.00

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4报告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及存托凭证投资股票明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	INVESCO DB OIL FUND	ETF基金	契约型开放式	-	4,961,141.46	18.49
2	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF基金	契约型开放式		4,911,348.43	18.31
3	PROSHARES ULTRA BLOOMBERG CR	ETF基金	契约型开放式		4,180,654.94	15.58
4	ISHARES S&P GSCI COMMODITY I	ETF基金	契约型开放式		3,924,342.83	14.63
5	VELOCI-TYSHARES 3X	ETF基金	契约型开放式		3,191,687.39	11.90
6	ETFS LEAN HOGS	ETF基金	契约型开放式		272,501.62	1.02
7	ISHARES SILVER TRUST	ETF基金	契约型开放式		264,463.96	0.99
8	DIREXION DAILY GOLD MINERS I	ETF基金	契约型开放式		115,811.33	0.43

本基金本报告期末仅持有上述基金。

5.10投资组合报告附注

5.10.1本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,827,848.34
3	应收股利	15,768.36
4	应收利息	208.55
5	应收申购款	13,860.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,857,686.05

5.10.4报告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。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限情况。

5.10.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	61,108,587.47
报告期期间基金总申购份额	1,659,236.35
减:报告期期间基金总赎回份额	11,285,572.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	51,482,251.13

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1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

9.2影响投资者决策的其他重要信息

无

§10备查文件目录

10.1备查文件目录

1、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)相关批准文件

2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程

3、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同

4、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

10.3查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2018年10月24日