

信诚优质纯债债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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：2019年08月26日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人对本基金募集、发售、上市交易、运作、申购、赎回等事宜承担连带的法律责任。
本基金年度报告经三分之二以上独立董事同意，并由董事长签发。
基金管理人和中信银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2019年8月23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，保证报告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财产，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2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金简介

| 2.1 基金基本情况 | |
|-----------------|----------------|
| 基金简称 | 信诚优质纯债债券 |
| 基金主代码 | 560018 |
| 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 |
| 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 | 39,867,772.94份 |
| 基金份额持有人数 | 11,484,500.91户 |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚优质纯债债券A |
| 下属分级基金的交易代码 | 560018 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 28,373,265.93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增值保值，为投资者实现稳定的收入。 | |
|---|--|--|
| | 1. 资产配置策略 在整体资产配置方面，本基金将通过考察不同类型的固定收益品种的信用评级、信用风险、流动风险、利率风险、税收等因素，综合分析各券种的性价比，择优选择具有较高流动性和较低风险的品种，以获得较高的资本增值。 | |
| 2. 固定收益类的投资策略 （1）类属资产配置 在整体资产配置方面，本基金将通过考察不同类型的固定收益品种的信用评级、信用风险、流动风险、利率风险、税收等因素，综合分析各券种的性价比，择优选择具有较高流动性和较低风险的品种，以获得较高的资本增值。 | | |
| 3. 行业配置策略 本基金将通过考察不同行业的信用评级、信用风险、流动风险、利率风险、税收等因素，综合分析各券种的性价比，择优选择具有较高流动性和较低风险的品种，以获得较高的资本增值。 | | |
| 4. 普通债券投资策略 本基金将通过考察不同地区的信用评级、信用风险、流动风险、利率风险、税收等因素，综合分析各券种的性价比，择优选择具有较高流动性和较低风险的品种，以获得较高的资本增值。 | | |
| 5. 灵活配置策略 本基金将通过考察不同期限的信用评级、信用风险、流动风险、利率风险、税收等因素，综合分析各券种的性价比，择优选择具有较高流动性和较低风险的品种，以获得较高的资本增值。 | | |
| 6. 其他资产配置策略 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 7. 资产配置比例 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 8. 风险管理策略 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 9. 其他 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 10. 投资组合构建 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 11. 信用风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 12. 利率风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 13. 流动性风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 14. 其他 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 15. 信用风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 16. 利率风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 17. 流动性风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 18. 其他 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 19. 信用风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 20. 利率风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 21. 流动性风险管理 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 22. 其他 本基金将通过考察不同类型的资产配置，以获得较高的资本增值。 | | |
| 23. 基金管理人和基金托管人 | | |

3.1 主要会计数据和财务指标

| 金额单位：人民币元 | |
|--------------------------------------|--|
| 3.1 期间数据和指标 | |
| 信诚优质纯债债券A 信诚优质纯债债券B | |
| 本期已实现收益 476,916.43 1,213,186.00 | |
| 本期利润 469,313.63 1,169,477.65 | |
| 期初至报告期初的基金份额净值增长率 0.0306% 0.0283% | |
| 3.2 期末数据和指标 | |
| 报告期利润 908,033.49 2,081,903.87 | |
| 期末可供分配基金份额利润 0.0791 0.0734 | |
| 期末基金资产净值 12,506,324.52 30,962,366.95 | |
| 基金份额净额 1,097 1,092 | |

3.1.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。

3.2.本基金管理人已于2012年12月20日在中国证监会指定媒体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.cticprfundsf.com

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

| 报告期内数据和指标 | | 信诚优质纯债债券A | | 信诚优质纯债债券B | |
|-------------------|---------------|---------------|--|-----------|--|
| 本期已实现收益 | 476,916.43 | 1,213,186.00 | | | |
| 本期利润 | 469,313.63 | 1,169,477.65 | | | |
| 期初至报告期初的基金份额净值增长率 | 0.0306% | 0.0283% | | | |
| 3.2 期末数据和指标 | | | | | |
| 报告期利润 | 908,033.49 | 2,081,903.87 | | | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0791 | 0.0734 | | | |
| 期末基金资产净值 | 12,506,324.52 | 30,962,366.95 | | | |
| 基金份额净额 | 1,097 | 1,092 | | | |

3.2.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。

3.3.本基金管理人已于实现收益扣除非经常性收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益扣除非相关费用后的余额)、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除非相关费用后的余额。

3.4.期间可供分配利润，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值。

3.5.基金净值表现

3.5.1.本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.2.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.3.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.4.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.5.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.6.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.7.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.8.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.9.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.10.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.11.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.12.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.13.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.14.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.15.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.16.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.17.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.18.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.19.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.20.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.21.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.22.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.23.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.24.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.25.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.26.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.27.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券A

3.5.28.本基金同期净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

信诚优质纯债债券B

3.5.29.本基金同期净值增长率及其与同期