中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2019年1月30日(基金合同生效日)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	中信保诚创新成长
基金主代码	006392
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01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
报告期末基金份额总额	66,085,396.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极投资于具有较高成长性和较强创新能力的上市公司股票,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1.资产配置策略 本基金主要通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境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各类资产相对收益率的基础上,动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金等大类资产的配置,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。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。 2.股票投资策略 (1)创新成长主题的界定 本基金注重挖掘具备较强创新能力、具备创新可持续性、或具备较高成长性的上市公司。本基金将着重挖掘:能够通过产品创新、服务创新、技术创新、流程创新、管理创新或商业模式创新等方式提升创新能力,从而提升生产运营效率、降低成本、提高产品质量或提升客户服务水平,进而提升长期竞争优势或盈利能力的上市公司;或能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司;同时,本基金还将着重挖掘能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。 (2)个股精选 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。 由于本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,因而本基金将在前述股票投资策略的基础上严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。 (3)灵活调整股票资产配置比例 本基金主要通过考量盈利增速与估值的匹配程度来灵活调整股票资产的配置比例。具体而言,本基金将采用沪深300指数作为市场的代表性指数,基于上市公司定期报告数据或市场预期数据,计算沪深300指数的市场市盈率对盈利增长率的比率(PEG),并以此为基准调整本基金的股票资产比例配置。当沪深300指数的PEG大于3时,本基金的股票资产占基金资产的比例为0-50%;当沪深300指数的PEG大于2且小于等于3时,本基金的股票资产占基金资产的比例为40%-80%;当沪深300指数的PEG小于等于2时,本基金的股票资产占基金资产的比例为50%-95%。基金管理人应当自上述条件触发之日的下一工作日起10个交易日内将本基金股票资产比例调整至符合上述比例范围。 3.债券投资策略 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,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、回购放大策略等策略进行主动投资。 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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 7.国债期货投资策略 本基金将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。 8.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。 9.股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。 10.融资投资策略 本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的,本基金将从其最新规定。 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	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*40%+恒生指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*40%。
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。本基金如果投资港股通标的股票,还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	田青
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

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(2019年01月30日(基金合同生效日)-2019年06月30日)
本期已实现收益	4,619,950.85
本期利润	3,179,612.64
加权平均基金份额本期利润	0.0247
本期基金份额净值增长率	1.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配利润	761,091.87
期末可供分配基金份额利润	0.0115
期末基金资产净值	66,846,488.16
期末基金份额净值	1.0115

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。

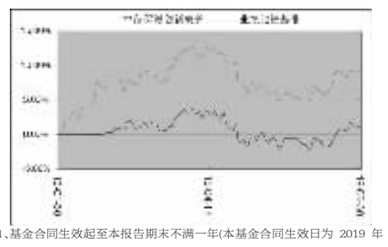
4、本基金合同生效日为 2019 年 1月30日。

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

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	1.69%	0.58%	3.59%	0.62%	-1.90%	-0.04%
过去三个月	-0.10%	0.70%	-0.41%	0.74%	0.31%	-0.04%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.15%	0.58%	9.12%	0.79%	-7.97%	-0.21%

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、基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为 2019 年 1 月 30 日)。

2、本基金建仓期自 2019 年 1 月 30 日至 2019 年 7 月 30 日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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2019年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为67只,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保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、信诚新全宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新活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)、中信保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、中信保诚惠泽18个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保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、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放债券型证券投资基金、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、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长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		
王睿	本基金基金经理,兼任信诚优胜精选混合基金、中信保诚精萃成长混合基金的基金经理。	2019年01月30日	-	9	经济学硕士。曾任职于上海申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、中信保诚精萃成长混合基金、中信保诚创新成长灵活配置混合基金的基金经理。

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《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金合同》、《中信保诚创新成长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

19年上半年A股市场出现反弹行情。一季度中美贸易摩擦阶段性落定,双方进入谈判期,同时由于18年4季度经济出现明显下滑,政府释放了较多流动性,社融大幅提升,A股市场出现快速反弹,风险偏好明显提升,券商,TMT等板块领涨,创业板上涨超过35%,交易量快速放大。四月份,国常会发言宣告流动性边际收紧,同时五月初中美贸易谈判阶段性破裂,美国威胁对剩余3000亿进口货物施加高额关税,并将华为等中国科技企业列入实体名单,A股出现较明显回调;此阶段,业绩相对出色且受贸易战影响较小的消费类核心资产,比如白酒,免税,医疗服务等逆势大幅上涨,基金抱团迹象明显。整个上半年,上证指数上涨19.45%,沪深300上涨27%,创业板指上涨20.87%,消费类核心资产超额收益明显。

一季度宏观经济在补库和天量社融两种力量推动下表现强劲,超出市场预期,同时也宣告了流动性高度宽松的阶段性结束。但是如果把19年一季度和表现异常的18年4季度两个季度合起来看,经济增速相比18年三季度仍然是下滑的。在供给侧改革和棚改货币化两大引擎边际贡献大幅下降以后,经济目前还没有找到短期的增长点。到二季度末,大部分经济指标已经出现较为明显的疲软态势,投资中只有地产投资相对坚挺,但随着拿地和资金来源两个先行指标的弱化,下半年的地产数据恐难以维系上半年的强势。消费数据上半年比较好,尤其是6月份,但是如果扣除6月份汽车国5升国6的提前消费,消费数据不如表观出色。政策角度看,货币政策在一季度显示了较大魄力,但是宽松的货币政策一直受到汇率和CPI两个因素的掣肘;而从财政政策角度,尽管一直在发力,但传统基建领域的边际贡献已经相对有限。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率分别为1.15%,同期业绩比较基准收益率为9.12%,基金份额落后业绩比较基准分别为7.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

转向下半年,我们认为经济将继续面临下行压力,同时中美的谈判仍然存在较多变数,政策端或成为市场行情的希翼,尤其是货币政策。在下半年CPI下行预期较强且全球宽松预期增强的大环境下,中国的货币宽松仍然有空间。目前市场的估值水平处于历史上中值偏下的位置,反应了较多的悲观预期,且交易量也萎缩到了很低的水平,一旦货币政策出现放松或者放松的预期,我们认为在此位置上市场向上的动力将较大。

方向上,我们认为成长股未来几年会存在景气度持续提升的机会,尤其是5G应用,云计算,人工智能,新能源车,半导体等新兴产业方向;我们会从中选择增速较快,竞争力较强的细分龙头长期关注。消费方面,我们重点关注医疗服务领域的机会;随着老龄化确定来临,医疗服务需求确定增长,在带量采购对行业的负面影响逐渐落地后,板块可能迎来新一轮的机会。本基金在结束建仓期后将积极参与以上看好的领域。

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、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、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,可申请召开估值决策委员会临时会议,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. 每份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。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性 不利影响的前提下,基金管理人经与基金托管人协商一致可调整基金收益的分配 原则,不需召开基金份额持有人大会。

本基金于本报告期内未进行过利润分配,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二百人)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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末(2019年06月30日)
资产:		
银行存款	6.4.7.1	33,830,368.45
结算备付金		274,020.43
存出保证金		28,976.64
交易性金融资产	6.4.7.2	33,850,415.25
其中:股票投资		33,850,415.25
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	6,614.73
应收股利		-
应收申购款		492.61
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		67,990,888.11
负债和所有者权益	附注号	本期末(2019年06月30日)
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		775,666.29
应付赎回款		101,975.67
应付管理人报酬		81,312.02
应付托管费		13,552.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	94,734.84
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	77,159.13
负债合计		1,144,399.95
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	66,085,396.29
未分配利润	6.4.7.10	761,091.87
所有者权益合计		66,846,488.16
负债和所有者权益总计		67,990,888.11

注:1、截止本报告期末,基金份额总额66,085,396.29份、基金份额净值1.0115元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2019年1月30日(基金合同生效日)至 2019年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体:中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月30日(基金合同生效日)-2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期(2019年01月30日(基金合同生效日)至2019年06月30日)
一、收入		4,528,749.57
1.利息收入		809,160.46
其中:存款利息收入	6.4.7.11	601,574.83
债券利息收入		351.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		207,234.55
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		4,208,389.90
其中:股票投资收益	6.4.7.12	4,166,982.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-354,282.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	395,690.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-1,440,338.21
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	951,537.42
减:二、费用		1,349,136.93
1. 管理人报酬		833,050.62
2. 托管费		138,841.78
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	292,338.40
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		1.17
7. 其他费用	6.4.7.20	84,904.96
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,179,612.64
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,179,612.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月30日(基金合同生效日)-2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2019年01月30日(基金合同生效日)至2019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)	315,410,558.63	-	315,410,558.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,179,612.64	3,179,612.64
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)	-249,325,162.34	-2,418,520.77	-251,743,683.11
其中:1.基金申购款	2,344,271.36	23,849.72	2,368,121.08
2.基金赎回款	-251,669,433.70	-2,442,370.49	-254,111,804.19
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)	66,085,396.29	761,091.87	66,846,488.16

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:

唐世春	陈逸平	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

中信保诚创新成长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[2018] 1372 号《关于准予中信保诚创新成长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《中信保诚创新成长灵活配置混合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315,317,055.27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(2019)第 0020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2019年1月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为315,410,558.63份基金份额,其中认购资金利息折合92,703.36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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、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、超短期融资券、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、国债期货、股票期权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%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%,投资于创新成长主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*40%。

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》、《中信保诚创新成长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2019年1月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月30日(基金合同生效日)至2019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

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月30 日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日之间的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其价值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易日最近交易日后未发生影响公允价值计量的的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当