信诚至远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:中国银行股份有限公司
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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚至远		
场内简称	-		
基金主代码	550015		
交易代码	-	-	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年08月31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		
报告期末基金份额总额	30,940,948.86份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	信诚至远A	信诚至远C	
下属分级基金的场内简称	-	-	
下属分级基金的交易代码	550015	550016	
报告期末下属分级基金的份额总额	14,629,543.20份	16,311,405.66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收益回报。
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、国家财政政策和货币政策、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,在严格控制风险、保持合理流动性的基础上,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收益回报。 2.股票投资策略 在风险收益原则下的资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法把握宏观的上位论点,严选具中安全边际较高的个股构建投资组合:自上自下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争壁垒等分析把握其投资机会;自下而上地评估企业的产品、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.债券投资策略 本基金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。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、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交易行为基本面的入调研分析,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,选取具有投资价值的短期公司债券进行投资。 5.中小企业私募债券投资策略 在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,选择具有相对较高的收益和较小信用风险的、期限、通过期限和品种的分散投资降低基金资产中小企业私募债券的风险,并来风险和流动性风险。 6.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和基础上,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,采取目标收益率曲线策略、信用利差曲线策略、期限利率曲线等策略等和类主动的投资策略,投资于资产支持证券。 7.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,在宏观策略分析系统、市场中长期趋势分析、市场短期趋势分析、中长期、短期、超短期多层次时间维度的基础上,对股指期货的流动性、风险收益特性、市场基差、期现价格偏离、股指期货的市场情绪、股指期货的交易成本等多种因素进行综合分析,力求实现股指期货投资的稳健性、流动性和收益性。 8.国债期货投资策略 本基金将根据相关法律法规的规定,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,在宏观策略分析、市场中长期趋势分析、市场短期趋势分析、中长期、短期、超短期多层次时间维度的基础上,对国债期货的流动性、风险收益特性、市场基差、期现价格偏离、国债期货的市场情绪、国债期货的交易成本等多种因素进行综合分析,力求实现国债期货投资的稳健性、流动性和收益性。 9.权证投资策略 本基金将根据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,结合投资动机等各种因素,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。 10.退保投资策略 本基金在与基金资产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,参与基金资产,本基金将基于对长期分析和动态风险收益的分析,通过定期对长、短期收益率以及收益比例,来选择退保基金管理人对基金资产的运用,本基金将从其最新规定。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中证标会债券收益率。	
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	haozhou@ticprufunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942

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

登载基金年年度报告正文的管理人互联网网址	www.ticprufunds.com.cn
基金年年度报告备置地点	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)	
	信诚至远A	信诚至远C
本期已实现收益	-704,388.80	-1,010,154.75
本期利润	-546,181.30	-996,227.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0341	-0.0658
本期基金份额净值增长率	-3.61%	-3.67%
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	0.2385	0.4128
期末基金资产净值	14,411,669.02	23,114,397.17
期末基金份额净值	0.9851	1.4171

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

信诚至远A

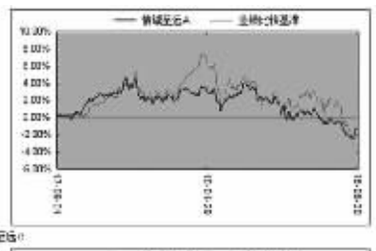
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.05%	0.35%	-3.57%	0.64%	2.52%	-0.29%
过去三个月	-3.68%	0.39%	-4.07%	0.57%	0.39%	-0.18%
过去六个月	-3.61%	0.37%	-4.61%	0.58%	1.00%	-0.21%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.49%	0.36%	-2.00%	0.50%	0.51%	-0.14%

信诚至远C

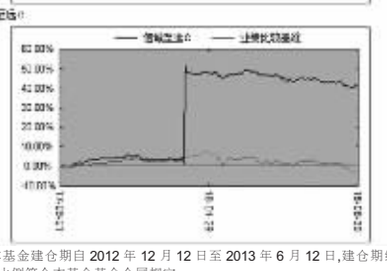
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.05%	0.35%	-3.57%	0.64%	2.52%	-0.29%
过去三个月	-3.52%	0.38%	-4.07%	0.57%	0.55%	-0.19%
过去六个月	-3.67%	3.75%	-4.61%	0.58%	41.40%	3.17%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	41.71%	2.90%	-2.00%	0.50%	43.71%	2.40%

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

信诚至远A



信诚至远C



注:1.本基金建仓期自2012年12月12日至2013年6月12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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王国强	本基金基金经理,信诚优质纯债债券基金、信诚年年有余定期开放债券基金基金、信诚惠利债券型基金、信诚理财28日盈债券型基金的基金经理,固定收益总监	2012年12月12日	-	18	管理学硕士,曾任职于新江国际信托投资公司,从事投行业务即债券发行;于融邦证券股份有限公司,担任债券研究员;于银河基金管理有限公司,担任机构投资部研究员,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、信诚惠利债券型基金、信诚理财28日盈债券型基金的基金经理。

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《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至远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,未出现多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

上半年经济增长平稳,但需求放缓压力显现。投资受信用紧缩等因素影响,增速明显放缓。二季度以来,中美贸易谈判无果,贸易摩擦加剧外需下行压力。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。监管稳步推进,资管新规落地,去杠杆、去影子银行,社融增长明显放缓,实体经济信用收缩。央行货币政策由稳健中性转宽松,对中信用紧缩风险,保持信贷和社融的平稳适度增长,四月降准1个百分点,同时通过公开市场操作和MLF等货币政策工具投放货币。在宽货币、紧信用的大政策格局下,债市分化明显,总体呈现牛市格局,中证综合债涨幅5.25%,利率债强于信用债,高等级信用债强于低等级信用债。利率债需求旺盛,利率大幅下行,10年国债、金融债利率分别下行40BP和57BP;信用债分化明显,高等级信用债收益下行幅度较大,3年AAA级信用债利率下行74BP,低等级信用债收益率下行幅度较小,部分民企债券收益率上行明显,信用债利差明显扩大。

上半年,资管新规落地、国内中美贸易战、棚改政策调整等因素影响国内经济需求偏弱,外需受到明显抑制,股票市场盈利预期转弱,估值下行,本基金维持较低股票仓位,重点配置消费类和具备创新能力的成长公司。债券方面重配长久期利率债和高等级信用债,保持较长的组合久期对冲股票持仓的波动风险,二季度以来取得较好的成效。

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-3.61%和36.79%,同期业绩比较基准收益率为-4.61%,基金A份额超越业绩比较基准1%,基金C份额超越业绩比较基准41.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观政策更注重稳增长,抵御外需的不确定性风险,预计经济增长仍将保持在合理的运行区间。受外需波动影响较小的行业中的优质公司,投资价值突出,在市场下行的过程中将出现较好的买点。

货币政策将注重流动性的合理充裕,货币市场资金面将保持宽松,利率仍将保持下行趋势,利率债的投资价值仍然突出。金融监管政策将更注重节奏和力度,信用风险将在宽信用政策的稳步推进下有效纾解,信用利差将合理修复,经营良好、债务杠杆较低的发行人发行的债券投资价值凸显。

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

基金收益分配原则如下:

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相应类别的基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配,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,本基金自2018年4月12日起至2018年6月29日止基金资产净值低于五千万元。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:信诚至远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)
资产:		
银行存款		1,081,409.10
结算备付金		58,889.45
存出保证金		12,375.25
交易性金融资产		38,727,792.90
其中:股票投资		4,243,112.60
基金投资		-
债券投资		34,484,680.30
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		-
应收利息		421,540.16
应收股利		-
应收申购款		22,044.61
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		40,324,051.47
负债和所有者权益	附注号	本期末(2018年06月30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		1,500,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		203,594.92
应付管理人报酬		19,265.13
应付托管费		5,779.56
应付销售服务费		7,010.22
应付交易费用		26,074.00
应交税费		575,265.45
应付利息		1,043.84
递延所得税负债		-
其他负债		459,982.16
负债合计		2,797,985.28
所有者权益:		
实收基金		27,018,776.46
未分配利润		10,507,289.73
所有者权益合计		37,526,066.19
负债和所有者权益总计		40,324,051.47

注:1.截止本报告期末,基金份额总额30,940,948.86份。下属分级基金:信诚至远A的基金份额净值0.9851元,基金份额总额14,629,543.20份;信诚至远C基金份额净值1.4171元,基金份额总额16,311,405.66份。

2.本财务报表的上年度编制期间为2017年9月1日(转型后首日)至2017年12月31日止期间。

6.2 利润表

会计主体:信诚至远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)
一、收入		-1,197,444.80
1.利息收入		618,243.75
其中:存款利息收入		16,581.86
债券利息收入		600,861.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		800.00
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-2,119,346.42
其中:股票投资收益		-2,200,491.18
基金投资收益		-
债券投资收益		19,009.00
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		62,135.76
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		172,134.70
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		131,523.17
减:二、费用		344,964.05
1.管理人报酬		113,901.38
2.托管费		34,170.41
3.销售服务费		38,140.19
4.交易费用		75,450.05
5.利息支出		21,145.55
其中:卖出回购金融资产支出		21,145.55
6.税金及附加		807.14
7.其他费用		61,349.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,542,408.85
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-1,542,408.85

本基金生效日为2017年9月1日,无上年度可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚至远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)	18,642,456.11	5,285,981.09	23,928,437.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,542,408.85	-1,542,408.85
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)	8,376,320.35	6,763,717.49	15,140,037.84
其中:1.基金申购款	40,040,039.77	18,774,067.20	58,814,106.97
2.基金赎回款	-31,663,719.42	-12,010,349.71	-43,674,069.13
四、本期向基金分配利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)	27,018,776.46	10,507,289.73	37,526,066.19

本基金生效日为2017年9月1日,无上年度可比期间。

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

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(原“信诚添金分级债券型证券投资基金”)(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”)《关于核准信诚添金分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1523号文)和《关于信诚添金分级债券型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2012]1124号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原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》等相关法规和《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年12月12日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币3,092,807,521.16元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。根据《信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告》,自2017年8月31日日终,本基金正式实施基金转型,基金名称由“信诚添金分级债券型证券投资基金”变更为“信诚至远灵活配置混合型证券投资基金”,基金类别由债券型基金转型为混合型,运作方式由原“运作周年滚动”运作方式改为常规契约性开放式,取消分级运作机制。于2017年8月31日(基金正式实施转型日)日终,信诚添金分级债券型证券投资基金之季季添金和岁岁添金份额转换为信诚至远灵活配置混合型证券投资基金的A类基金份额。2017年9月1日(基金转型后首日),《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,基金规模为45,841,287.99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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围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、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、中小企业私募债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、国债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%。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资策略届时将做相应调整。本基金的业绩比较基准为:50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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

(1) 主要税项说明

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