

# 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算报告

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

清算报告出具日期：二〇一八年六月十二日

清算报告公告日期：二〇一八年七月二十六日

## 1、重要提示

### 1.1 重要提示

信诚基金管理有限公司经中国证监会批准于 2005 年 9 月 30 日注册成立。因业务发展需要，经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”（以下简称“我司”），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《中华人民共和国合同法》第七十六条的规定，合同当事人名称变动不影响合同义务的履行。本次我司名称变更后，以“信诚基金管理有限公司”或“中信保诚基金管理有限公司”签署的法律文件（包括但不限于公司合同、公告等，以下简称“原法律文件”）不受任何影响，我司将按照原法律文件的约定行使权利、履行义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的，以原法律文件的说明为准。

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），是由信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金转型而来。中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）于 2017 年 11 月 7 日获得中国证监会《关于准予信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]2012 号）；于 2017 年 12 月 12 日基金份额持有人大会会计票通过了《关于信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2018 年 1 月 15 日生效。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金管理人于 2018 年 3 月 30 日起至 2018 年 4 月 26 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 27 日表决通过了《关于终止信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效，表决结果及决议生效的公告详见 2018 年 5 月 2 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站和基金管理人网站上的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为 2018 年 5 月 2 日，并于 2018 年 5 月 3 日进入清算期。

本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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2018 年 5 月 3 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计、上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金简称 信诚鼎泰策略(LOF)（场内简称：信诚鼎泰）

基金主代码 165532

基金运作方式 契约型，上市开放式

基金合同生效日 2018年1月15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

基金合同存续期 不定期

## 2.2 基金产品说明

**投资目标** 本基金将灵活运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。

### 投资策略 1、资产配置策略

本基金主要通过宏观经济运行状况、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

#### (1)二级市场定增策略

本基金将充分关注已完成定增但定增股份未解禁的股票,当其市价低于定增价格时,本基金在择时和优选个股的前提下,在二级市场买入个股;在上市公司定增预案后,可筛选优质定增标的,先在二级市场建仓,充分把握定增预案后上市公司的涨幅。

#### (2)价值策略

本基金将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据对行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2)定量分析:主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标,选取具备选成长性好,估值合理的股票,主要采用的指标包括但不限于:公司收入、未来公司利润增长率等;净资产收益率(ROE)、资本回报率(ROIC)、毛利率、净利率等;市盈率(PE)、市稳增长比率(PEG)、市净率(PB)、市销率(PS)等。

#### (3)成长策略

本基金将挖掘内生增长型公司和外延增长型公司。

内生增长型公司通常资产盈利能力较强,表现出良好的成长性,具备内生增长特质。本基金将深入研究符合内生增长量化指标评估的上市公司,考察其所处行业的竞争格局、业务模式、盈利能力、持续增长能力、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平,从而做出投资判断和决定。

外延增长型公司主要指通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究,综合评估并购重组企业的行业增长前景;以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应,包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等,从而做出投资判断和决定。

#### (4)主题投资策略

随着中国经济发展和经济结构的转型,在技术经济效益、人口年龄结构变化以及国家政策导向等因素的影响下,将不断涌现出的有影响力的投资主题。本基金将通过系统、细致、前瞻性的宏观经济和国家政策等因素研究,发掘具备成长性、具有投资价值的主题行业。

### 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。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,以套期保值为目的,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。

**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。

### 3、基金运作情况概述

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2016]2431号文准予注册,由基金管理人于2017年4月24日至2017年7月21日向社会公开发行募集,《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月28日正式生效,募集规模为222,436,056.26基金份额。

本基金由信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金转型而来。本基金管理人于2017年11月7日获得中国证监会《关于准予信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2017]2012号);于2017年12月12日基金份额持有人大会会计票通过了《关于信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,本基金《基金合同》于2018年1月15日生效。

鉴于市场环境的变化,为保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》有关规定,本基金基金份额持有人大会已于2018年3月30日起至2018年4月26日以通讯方式召开,审议并通过了《关于终止信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为2018年5月2日,自2018年5月3日起进入清算期。

### 4、财务会计报告

#### 4.1 资产负债表（已经审计）

会计主体：信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年5月2日

最后运作日

2018年05月02日

资产：

银行存款 1,083,743.59

结算备付金 3,636.36

存出保证金

交易性金融资产

其中：股票投资

基金投资

债券投资

资产支持证券投资

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 1,175.38

应收股利

应收申购款

其他资产

资产总计 1,088,555.33

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

应付证券清算款

应付赎回款

应付管理人报酬 1,403.47

应付托管费 233.84

应付销售服务费

应付交易费用

应交税费

应付利息

应付利润

其他负债 200,356.80

负债合计 201,994.11

所有者权益：

实收基金 899,794.77

未分配利润 -13,233.55

所有者权益合计 886,561.22

负债和所有者权益总计 1,088,555.33

注：1、根据《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金名称变更及实施转型的提示性公告》及《信

诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)合同生效公告》的有关约定, 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额转换基准日为 2018 年 1 月 12 日。在基金份额转换基准日日终, 以信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金份额的基金份额净值为基准(基金份额净值为 1.0000 元), 原场内的信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金份额 108,067.00 份, 按照 0.997944917 的转换比例转换为信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的场内份额 107,844.00 份, 原场外的信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金份额 1,402,105.43 份, 按照 0.997944917 的转换比例转换为信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的场外份额 1,399,223.99 份。《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2018 年 1 月 15 日生效。

#### 4.2 利润表(已经审计)

项目 本期

2018 年 01 月 01 日至 2018 年 05 月 02 日

(基金最后运作日)

一、收入 10,771.52

1.利息收入 8,512.55

其中: 存款利息收入 7,746.19

债券利息收入

资产支持证券利息收入

买入返售金融资产收入 766.36

2.投资收益(损失以“-”填列)

其中: 股票投资收益

基金投资收益

债券投资收益

资产支持证券投资收益

衍生工具收益

衍生工具收益

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)

4.其他收入(损失以“-”号填列) 2,258.97

二、费用 28,345.51

1、管理人报酬 6,698.69

2、托管费 1,116.42

3、销售服务费

4、交易费用

5、利息支出

其中: 卖出回购金融资产支出

6、其他费用 20,530.40

三、利润总额 -17,573.99

5、基金财产分配

本基金自 2018 年 5 月 3 日起进入清算程序, 基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算, 全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

5.1 清算费用

自 2018 年 05 月 03 日至 2018 年 05 月 16 日止清算期间, 未发生清算费用。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币 1,170.74 元、应收清算备付金利息人民币 4.64 元, 共计

人民币 1,175.38 元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金人民币 3,636.36 元，已于 2018 年 5 月 3 日转回托管户。

### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 1,403.47 元，该款项将于 2018 年 05 月 16 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费人民币 233.84 元，该款项将于 2018 年 05 月 16 日后支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债人民币 200,356.80 元。其中，其他应付款人民币 55.00 元，为预计支付各类账面费用所需的银行汇划手续费，该款项将于每笔费用实际支付日由托管行扣缴；应付审计费人民币 13,150.40 元，该款项将于 2018 年 05 月 16 日后支付；应付信息披露费人民币 187,151.40 元，该款项将于 2018 年 05 月 16 日后支付。

(4) 本基金于 2018 年 05 月 02 日收到赎回申请，并于 05 月 03 日确认赎回申请，共计 29.91 份，确认金额为 29.49 元，归属本基金的赎回费收入为 0.03 元。此笔应付赎回款已于 2018 年 05 月 04 日支付完毕。

客户类型	确认日期	申请日期	业务类型	确认金额	确认份额	处理结果	归基金资产费用	确认价格	确认金额全额
------	------	------	------	------	------	------	---------	------	--------

个人	2018-05-03	2018-05-02	赎回	9.83	9.97	确认成功	0.01	0.9873	9.84
----	------------	------------	----	------	------	------	------	--------	------

个人	2018-05-03	2018-05-02	赎回	9.83	9.97	确认成功	0.01	0.9873	9.84
----	------------	------------	----	------	------	------	------	--------	------

个人	2018-05-03	2018-05-02	赎回	9.83	9.97	确认成功	0.01	0.9873	9.84
----	------------	------------	----	------	------	------	------	--------	------

29.49 29.91 0.03 29.52

### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2018 年 05 月 03 日至 2018 年 05 月 16 日止清算期间

#### 一、清算收益

1、利息收入-银行存款利息收入（注 1） 304.42

2、利息收入-清算备付金利息收入（注 1） 0.16

2、其他收入-赎回费收入 0.03

清算收入小计 304.61

#### 二、清算费用

清算费用小计 0.00

#### 三、清算净收益

304.61

注 1：利息收入计提的自 2018 年 05 月 03 日至 2018 年 05 月 16 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息

### 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 05 月 02 日基金净资产 886,561.22

加：清算期间净收益 304.61

收到应收申购款 0.00

减：确认全额赎回金额（注 1） 29.52

二、2018 年 05 月 16 日基金净资产 886,836.31

注 1：此处清算期间全额赎回金额包含归属本基金的其他收入一赎回费收入。

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 05 月 16 日本基金剩余财产为人民币 886,836.31 元。清算结束日 2018 年 05 月 16 日至清算款划出日，预计将会产生如下清算费用，具体金额以实际发生为准。

项目 自 2018 年 05 月 16 日至清算款划出日

## 1、银行费用 20.00

### 清算费用小计 20.00

根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2018 年 05 月 03 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属于基金份额持有人所有。

### 5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## 6、备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

(1) 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）财务报表及审计报告

(2) 上海源泰律师事务所关于信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算事宜之法律意见

### 6.2 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。

### 6.3 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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

二〇一八年七月二十六日