

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转
型)

2020 年年度报告

2020 年 12 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 03 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 03 月 25 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。

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金由信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转型而来。信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 02 月 06 日止,中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金报告期自 2020 年 02 月 07 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 2	基金简介	8
2.1	基金基本情况	8
2.2	基金产品说明	8
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1	主要会计数据和财务指标	10
3.2	基金净值表现	10
3.3	过去三年基金的利润分配情况	13
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	13
3.1	主要会计数据和财务指标	13
3.2	基金净值表现	14
3.3	过去三年基金的利润分配情况	17
§ 4	管理人报告	17
4.1	基金管理人及基金经理情况	17
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	20
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9	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	22
§ 5	托管人报告	22
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	22
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	22
§ 6	审计报告	22
6.1	审计报告基本信息	22
6.2	审计报告的基本内容	23
§ 6	审计报告	24
6.1	审计报告基本信息	24
6.2	审计报告的基本内容	25
§ 7	年度财务报表	26
7.1	资产负债表	26
7.2	利润表	28

7.3	所有者权益（基金净值）变动表	29
7.4	报表附注	29
§ 7	年度财务报表	47
7.1	资产负债表	47
7.2	利润表	48
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	49
7.4	报表附注	50
§ 8	投资组合报告	71
8.1	期末基金资产组合情况	71
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	72
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	72
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6	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	72
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8	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贵金属投资明细	73
8.9	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	73
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12	投资组合报告附注	73
§ 8	投资组合报告	74
8.1	期末基金资产组合情况	74
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	75
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	75
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6	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	75
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
8.8	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贵金属投资明细	76
8.9	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	76
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12	投资组合报告附注	76
§ 9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	78
§ 9	基金份额持有人信息	78
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	79
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	79

9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	79
§ 10	开放式基金份额变动	79
§ 10	开放式基金份额变动	80
§ 11	重大事件揭示	80
11.1	基金份额持有人大会决议	80
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4	基金投资策略的改变	81
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	83
§ 11	重大事件揭示	85
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1	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	86
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	87
§ 13	备查文件目录	87
13.1	备查文件目录	87
13.2	存放地点	87
13.3	查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

基金名称	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金	
基金简称	中信保诚至泰中短债	
基金主代码	004155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 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	105,954,260.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚至泰中短债 A	中信保诚至泰中短债 C
下属分级基金的交易代码	004155	004156
报告期末下属分级基金的份额总额	60,933,977.74 份	45,020,283.19 份

注：自 2020 年 2 月 7 日起，信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转型为中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

2.2 基金产品说明

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短期债券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）类属资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>（2）普通债券投资策略</p>

	<p>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。</p> <p>3、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期银行定期存款利率(税后)*20%
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。
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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	姜敏
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024
注册地址		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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		张翔燕	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	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

§ 2 基金简介

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	信诚至泰	
基金主代码	004155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 06 月 06 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	124,889,713.68 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚至泰 A	信诚至泰 C
下属分级基金的交易代码	004155	004156
报告期末下属分级基金的份额总额	24,843,483.54 份	100,046,230.14 份

注：自 2020 年 2 月 7 日起，信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转型为中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

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回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过通过对宏观经济运行状况、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回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上,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</p>

	<p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>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</p>
--	--

	理内在价值, 构建交易组合。 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	30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证综合债指数收益率
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	-

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

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 (2020 年 02 月 07 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日)	
	中信保诚至泰中短债 A	中信保诚至泰中短债 C
本期已实现收益	966, 923. 16	3, 727, 058. 05
本期利润	118, 980. 40	2, 503, 376. 48
加权平均基金份额本期利润	0. 0016	0. 0094
本期加权平均净值利润率	0. 15%	0. 81%
本期基金份额净值增长率	0. 95%	0. 88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2020 年 12 月 31 日)	
	中信保诚至泰中短债 A	中信保诚至泰中短债 C
期末可供分配利润	5, 663, 591. 02	6, 870, 460. 67
期末可供分配基金份额利润	0. 0929	0. 1526
期末基金资产净值	66, 597, 568. 76	51, 890, 743. 86
期末基金份额净值	1. 0929	1. 1526
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2020 年 12 月 31 日)	
	中信保诚至泰中短债 A	中信保诚至泰中短债 C
基金份额累计净值增长率	0. 95%	0. 88%

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、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、本基金合同在当期生效, 本报告期不足一年。

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

中信保诚至泰中短债 A:

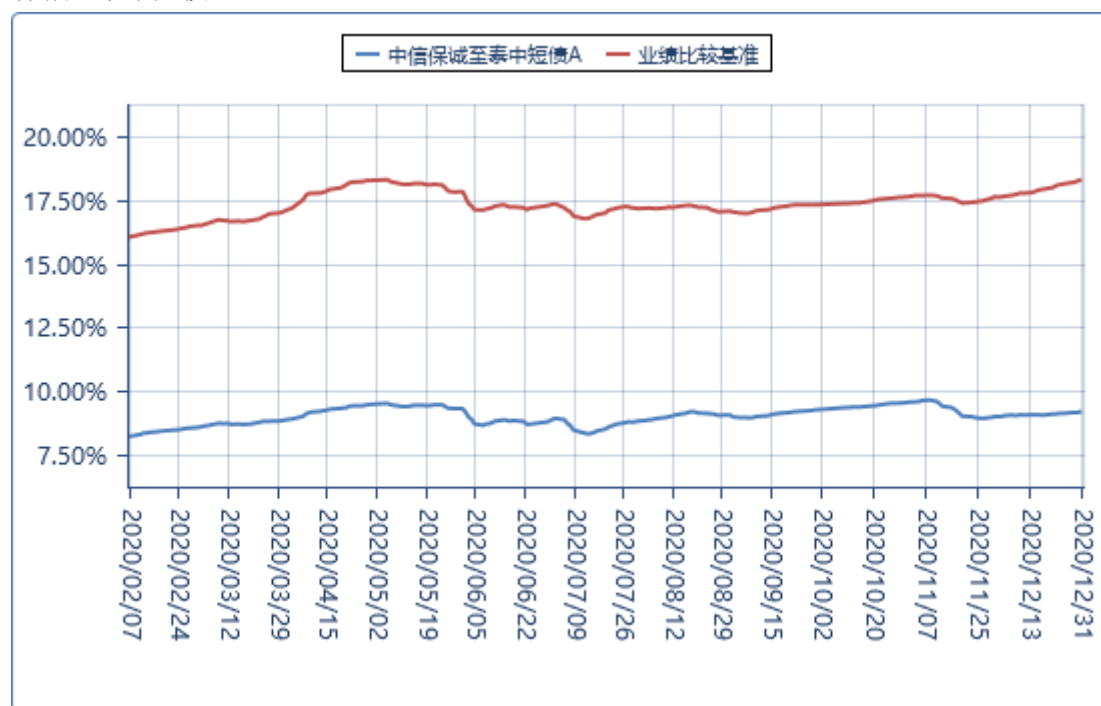
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.05%	0.03%	0.84%	0.03%	-0.89%	0.00%
过去六个月	0.39%	0.04%	0.87%	0.03%	-0.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.95%	0.04%	1.96%	0.05%	-1.01%	-0.01%

中信保诚至泰中短债 C:

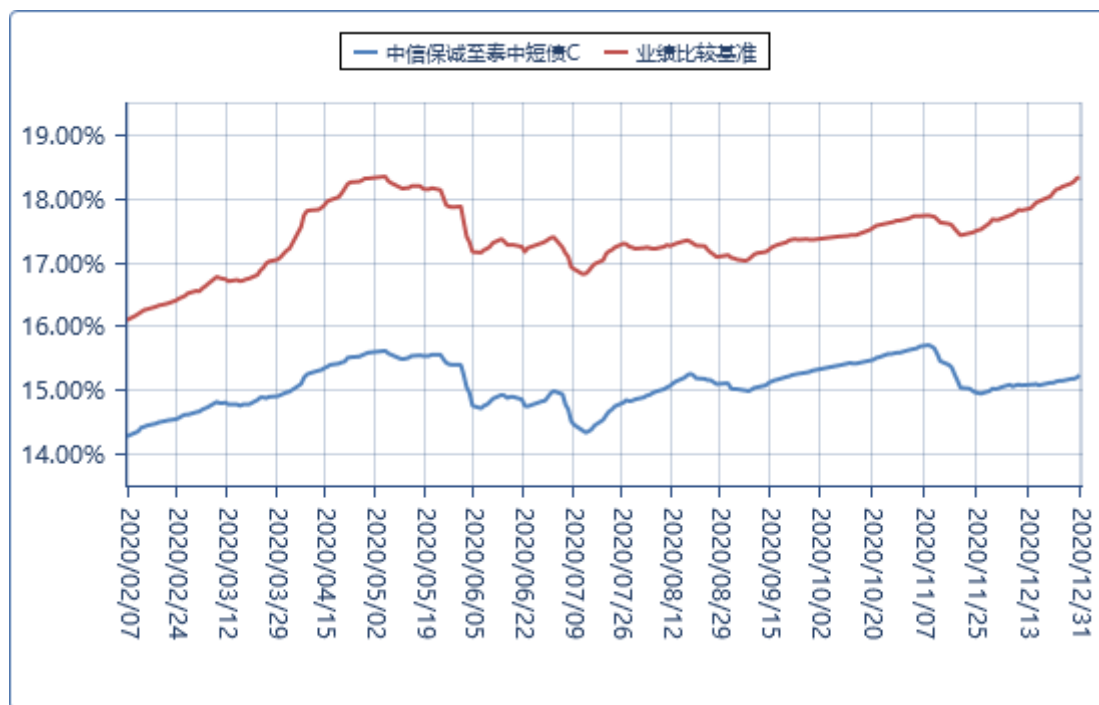
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.06%	0.03%	0.84%	0.03%	-0.90%	0.00%
过去六个月	0.35%	0.04%	0.87%	0.03%	-0.52%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.04%	1.96%	0.05%	-1.08%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额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

中信保诚至泰中短债 A:



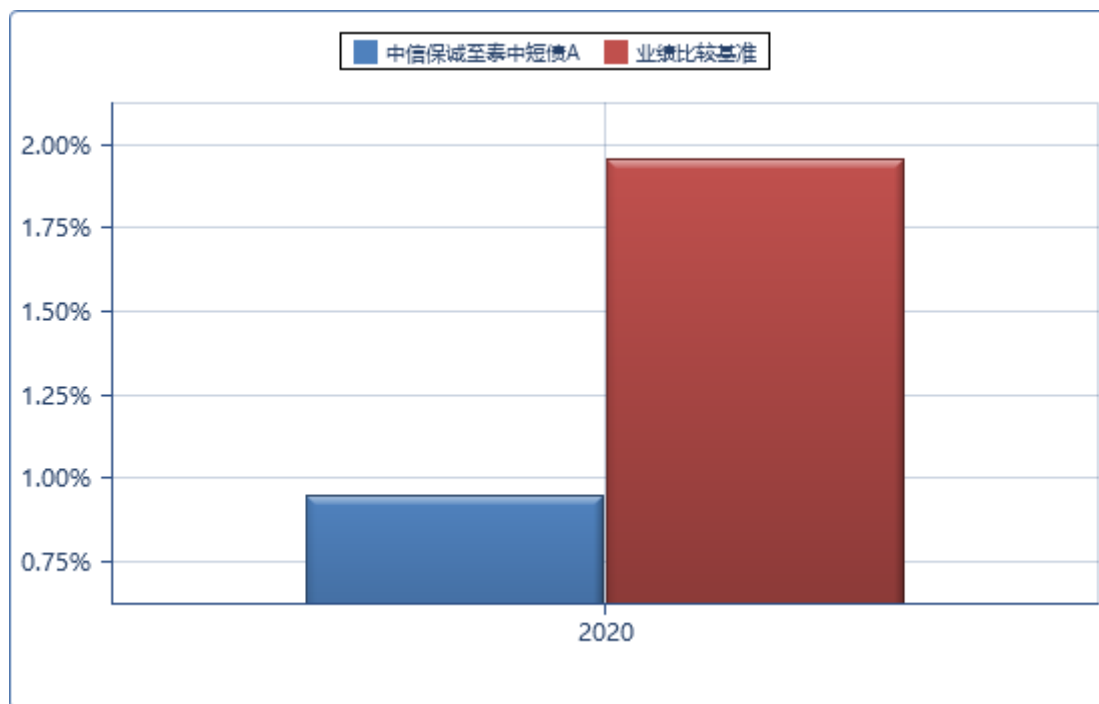
中信保诚至泰中短债 C:



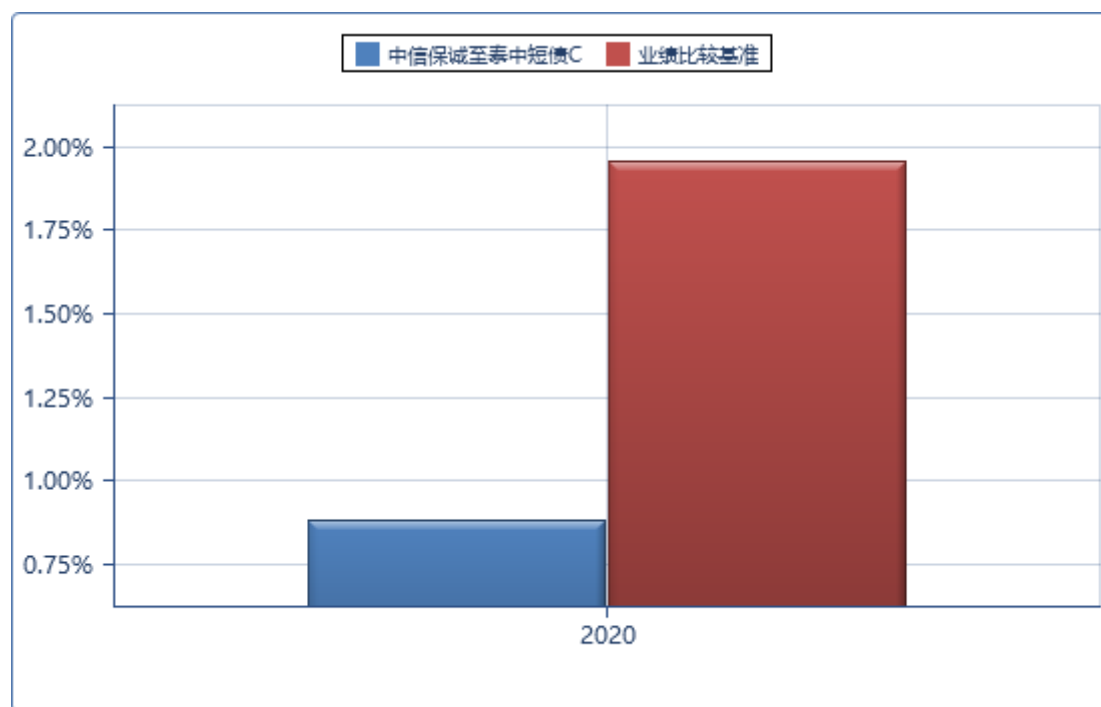
注：本基金转型日期为 2020 年 02 月 07 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

3.2.3 过去五年/自基金合同生效/自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚至泰中短债 A:



中信保诚至泰中短债 C:



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

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	2020年		2019年		2018年	
	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C
本期已实现收益	80,683.07	400,726.76	4,309,091.00	1,166,692.30	16,751,550.07	109,255.48
本期利润	114,275.06	574,892.30	4,093,037.30	1,176,335.80	3,414,459.05	-32,626.14
加权平均基金份额本期利润	0.0053	0.0062	0.0413	0.0393	0.0415	-0.0050
本期加权平均净值利润率	0.49%	0.54%	3.92%	3.49%	3.88%	-0.46%
本期基金份额净值增长率	0.53%	0.51%	3.70%	3.50%	-6.15%	-6.03%

3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C
期末可供分配利润	2,051,177.14	14,260,933.89	2,057,279.99	13,089,956.25	7,359,327.56	1,678,342.31
期末可供分配基金份额利润	0.0826	0.1425	0.0769	0.1367	0.0385	0.0983
期末基金资产净值	26,894,660.68	114,307,164.03	28,819,053.78	108,847,851.45	198,560,751.07	18,747,320.26
期末基金份额净值	1.0826	1.1425	1.0769	1.1367	1.0385	1.0983
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C	信诚至泰 A	信诚至泰 C
基金份额累计净值增长率	8.26%	14.25%	7.69%	13.67%	3.85%	9.83%

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、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

信诚至泰 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
2020年01月01日-2020年02月06日	0.53%	0.04%	-0.49%	0.59%	1.02%	-0.55%
2019年10月01日-2020年02月06日	1.22%	0.03%	2.56%	0.35%	-1.34%	-0.32%
2019年04月01日-2020年02月06日	3.06%	0.03%	3.77%	0.36%	-0.71%	-0.33%
2017年06月06日-2020年02月06日	8.26%	0.46%	16.08%	0.36%	-7.82%	0.10%

信诚至泰 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
2020年01月	0.51%	0.04%	-0.49%	0.59%	1.00%	-0.55%

01日-2020年 02月06日						
2019年10月 01日-2020年 02月06日	1.18%	0.02%	2.56%	0.35%	-1.38%	-0.33%
2019年04月 01日-2020年 02月06日	2.92%	0.03%	3.77%	0.36%	-0.85%	-0.33%
2017年06月 06日-2020年 02月06日	14.25%	0.49%	16.08%	0.36%	-1.83%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额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

信诚至泰 A:

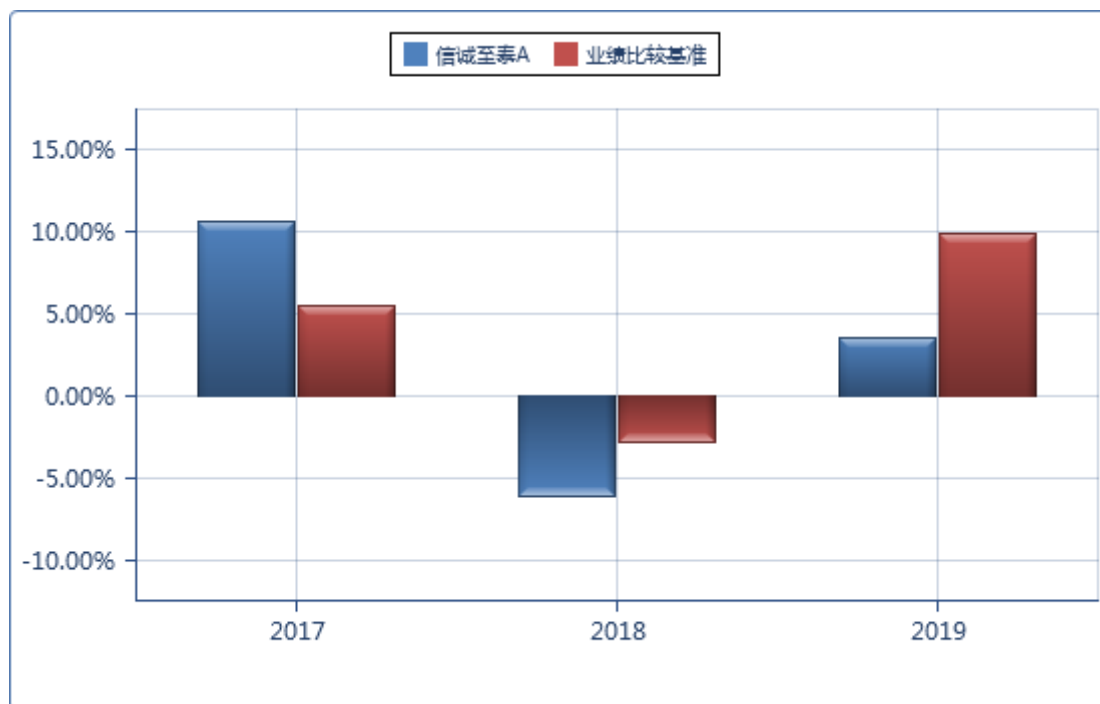


信诚至泰 C:

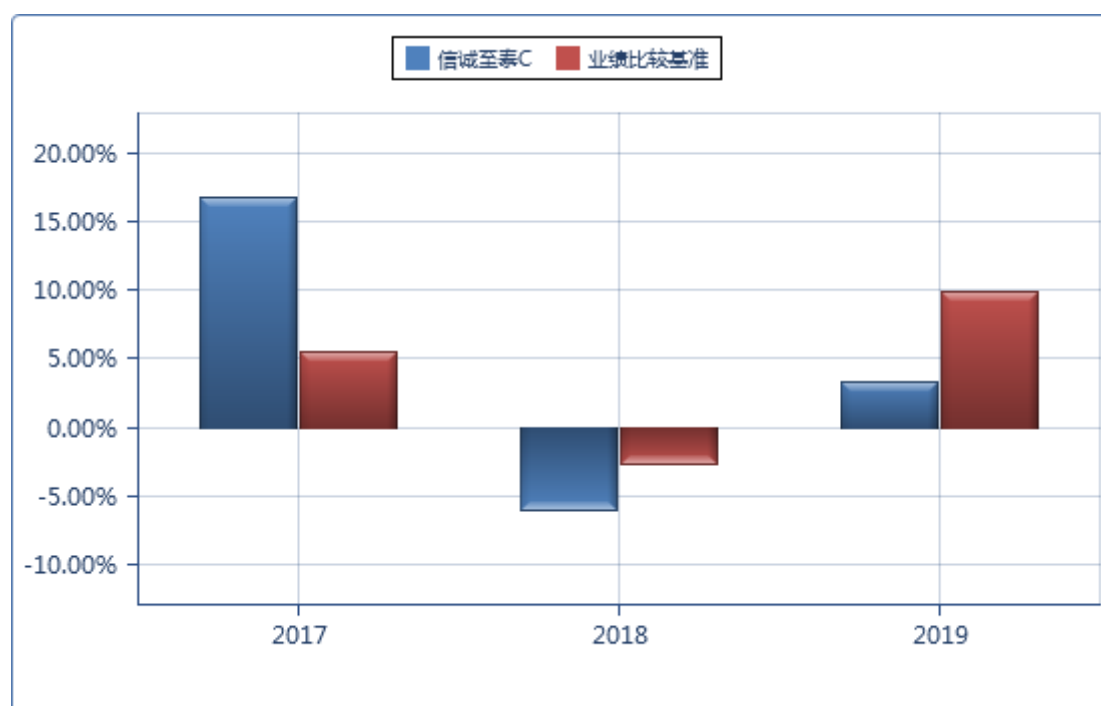


3.2.3 过去五年/自基金合同生效/自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚至泰 A:



信诚至泰 C:



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§ 4 管理人报告

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

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。

2020年12月31日，本基金管理人管理的运作中基金为74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）、中信保诚景华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、信诚中证建筑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、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、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 3 个月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、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
席行懿	本基金基金经理、公司固定收益部副总监	2019 年 12 月 30 日	-	11	工商管理硕士。曾任职于德勤华永会计师事务所，担任高级审计师。2009 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任基金会计经理、交易员、固定收益研究员。现任固定收益部副总监，信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金的基金经理。

缪夏美	本基金基金经理	2018 年 09 月 14 日	2020 年 01 月 15 日	3	经济学硕士。曾任职于方正中期期货有限公司,担任宏观研究员;于合众资产管理股份有限公司,担任投资经理助理。2016 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司,历任固定收益部研究员、投资经理。
-----	---------	------------------	------------------	---	---

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《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》、《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金招募说明书》、《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至泰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 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,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》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 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。

4.3.3 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

回顾 2020 年,在新冠肺炎疫情冲击下,国内外形势复杂严峻,主要得益于有力的疫情防控措施和有效的宏观调控政策,我国率先复工复产,出口持续超预期的同时,内需也逐步恢复,GDP 在经历了 1 季度的深度下跌后逐季回升,全年 GDP 同比增长 2.3%,成为 2020 年全球唯一实现正增长的主要经济体,截至年底,除消费以外的多数经济指标已经回到甚至超过疫情前水平。

通胀方面,受生猪产能恢复和 2019 年高基数效应等因素影响,CPI 呈现前高后低走势,全年同比上涨 2.5%。PPI 走势先下后上,全年同比下降 1.8%。

货币政策方面,年初面对疫情带来的内外部不确定因素,央行采取了降准、MLF 降息等较为宽松的货币政策,5 月以后,随着经济加快恢复,央行货币政策逐步回归常态,11 月信用事件冲击后,央行对流动性呵护态度明显,11 月中至年底的流动性呈现阶段性宽松。

从债券市场来看,年初在疫情冲击和货币政策宽松的影响下,债券收益率快速下行,10 年国债收益率从年初的 3.15%回落到 2.5%的历史最低位附近。随着 5 月以后国内疫情好转、经济基本面快速修复和货币政策回归正常化,债券收益率逐步回升,10 年国债收益率逐步回升到 3.3%左右。11 月信用事件冲击后,央行对流动性呵护态度明显,资金利率下行带动市场情绪小幅回暖,10 年国债收益率小幅回落到 3.14%左右,与年初位置基本持平。信用债方面,全年信用利差走势基本跟随利率,但永煤违约后信用利差经历了一波无差别上行,此后随着央行呵护流动性,高等级利差有所修复,但利差仍然呈现分化局面。

配置上,组合策略为信用债打底,利率债进行波段操作。年初受疫情影响,货币政策开启了一轮宽松周期,组合规模增长较快,主要配置了 3Y 内高等级信用债以及少量利率债和商业金融债。5 月份以后,货币政策回归常态,短端利率剧烈波动,3 年内债券收益率在一个月内上行了 100BP 以上,收益率曲线迅速熊平,组合受伤较重并遭遇了巨额赎回。操作上组合在确保流动性的同时降低了组合久期至 1 年以内,同时减持了利率债和商业金融债。进入下半年,长端债券收益率进入震荡期,10Y 期国开活跃券收益率在 3.6%-3.9%之间宽幅震荡。特别是 11 月永煤超预期违约发生后,债券收益率快速上行,各等级信用债以及利率债遭遇了大规模非理性抛售,1Y 国股存单利率也快速上行至最高 3.36%,信用债利差也迅速走阔,操作上组合迅速卖出了长久期资产并将组合杠杆降至 100%以内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,原信诚至泰 A(2020/1/1 至 2020/2/6)份额净值增长率为 0.53%,同期业绩比较基准收益率为-0.49%;原信诚至泰 C(2020/1/1 至 2020/2/6)份额净值增长率为 0.51%,同期业绩比较基准收益率为-0.49%。

中信保诚至泰中短债 A(2020/2/7 至 2020/12/31)份额净值增长率为 0.95%,同期业绩比较基准收益率为 1.96%;中信保诚至泰中短债 C(2020/2/7 至 2020/12/31)份额净值增长率为 0.88%,同期业绩比较基准收益率为 1.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年,宏观经济方面,预计社融增速将逐步回落至 11.8%,与 2021 年名义 GDP 增速基本匹配,宏观杠杆率基本保持稳定。但考虑 2020 年 3%左右的名义增速和 13.3%的社融增速,2021

年实体经济层面将感受到融资偏紧。此外，国内库存周期确定性开启，预计本轮补库存周期将至少持续到今年 2 季度，在此过程中，企业盈利将进一步修复，且有利于整体制造业投资的进一步提升。整体企业盈利恢复的同时，龙头企业的盈利回升将更具有弹性和确定性。

通胀方面，CPI 仍受猪价下行趋势影响，预计全年均值在 1-2%左右。受油价和库存周期影响，PPI 全年均值在 1.5%左右。中性情景下，CPI、PPI 较为温和，对货币政策影响小。

在 2021 年宏观政策“不急转弯”、货币政策“稳”字当头的总基调下，政策退出节奏仍将保持相对平缓。整体流动性将保持“不缺不溢”，货币政策在关注稳定宏观杠杆率的同时，也会更加关注经济恢复和风险防范之间的关系。

从债市投资策略来看，利率方面，预计利率债仍以震荡为主；信用方面，信用利差在经历事件冲击后，长期来看显得保护仍然不足，信用债须重视提升资质。

操作上，21 年一季度组合整体将延续保守操作。在债券标的选择上，由于当前信用债市场估值重塑尚未完成，且在今年宏观稳杠杆的大背景下，信用债投资仍存较大不确定性，组合将挑选高资质无瑕品种进行配置，并在合适的机会配置一定比例存单作为流动性管理品种。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管规范要求，坚持保护基金份额持有人利益，继续致力于完善公司内部合规与内控机制，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司规章制度建设，完善公司规章制度体系；开展内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作；完成并提交监察稽核定期项目，对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，根据法规要求对董事、高级管理人员、基金经理任免事项进行备案；规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易，维护持有人、本公司和股东的合法权益；严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；开展合规培训、法规咨询、更新法规汇编，对产品、采购与行政合同进行审核；完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规向监管部门进行数据报送并开展日常联络等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强公司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、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,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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金)2020 年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,中信保诚基金管理有限公司在中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金)2020 年年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

报告编号	普华永道中天审字(2021)第 20860 号
------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“中信保诚至泰中短债债券基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年2月7日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了中信保诚至泰中短债债券基金2020年12月31日的财务状况以及2020年2月7日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信保诚至泰中短债债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中信保诚至泰中短债债券基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中信保诚至泰中短债债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中信保诚至泰中短债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信保诚至泰中短债债券基金的财务报告过程。</p>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信保诚至泰中短债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信保诚至泰中短债债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>陈熹、俞伟敏</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2021 年 03 月 23 日</p>

§ 6 审计报告

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
报告编号	普华永道中天审字(2021)第 20873 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚至泰混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了信诚至泰混合基金 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于信诚至泰混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>信诚至泰混合基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚至泰混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算信诚至泰混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督信诚至泰混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对信诚至泰混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信诚至泰混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹、俞伟敏
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 23 日

§ 7 年度财务报表

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

7.1 资产负债表

会计主体：中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,868,922.11
结算备付金	-	1,116,473.70
存出保证金	-	16,874.89
交易性金融资产	7.4.7.2	106,357,717.20
其中：股票投资	-	-
债券投资	-	103,487,917.20
资产支持证券投资	-	2,869,800.00
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,900,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	7.4.7.5	2,138,202.38
应收股利	-	-
应收申购款	-	149,901.02
递延所得税资产	-	-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计	-	119,548,091.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	774,770.42
应付管理人报酬	-	33,969.07
应付托管费	-	11,323.00
应付销售服务费	-	5,672.01
应付交易费用	7.4.7.7	4,071.25
应交税费	-	10,289.82
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	7.4.7.8	219,683.11
负债合计	-	1,059,778.68
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	105,954,260.93
未分配利润	7.4.7.10	12,534,051.69

所有者权益合计	-	118,488,312.62
负债和所有者权益总计	-	119,548,091.30

注：1、本财务报表的实际编制期间为2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间。

2、截止本报告期末，基金份额总额105,954,260.93份。下属分级基金：中信保诚至泰中短债A的基金份额净值1.0929元，基金份额总额60,933,977.74份；中信保诚至泰中短债C的基金份额净值1.1526元，基金份额总额45,020,283.19份。

7.2 利润表

会计主体：中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年02月07日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
一、收入	-	5,346,638.67
1. 利息收入	-	13,915,920.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,127.81
债券利息收入	-	13,322,165.84
资产支持证券利息收入	-	453,674.61
买入返售金融资产收入	-	100,952.07
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	-6,600,171.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,670,028.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	69,857.32
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,071,624.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	102,513.91
减：二、费用	-	2,724,281.79
1. 管理人报酬	-	1,058,827.39
2. 托管费	-	352,942.45
3. 销售服务费	-	280,607.34
4. 交易费用	7.4.7.18	30,524.90
5. 利息支出	-	691,266.87
其中：卖出回购金融资产支出	-	691,266.87
6. 税金及附加	-	45,068.74
7. 其他费用	7.4.7.19	265,044.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	2,622,356.88

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	2,622,356.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 02 月 07 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 02 月 07 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	124,889,713.68	16,312,111.03	141,201,824.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,622,356.88	2,622,356.88
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）	-18,935,452.75	-6,400,416.22	-25,335,868.97
其中：1. 基金申购款	1,397,234,687.78	196,982,640.99	1,594,217,328.77
2. 基金赎回款	-	-	-
	1,416,170,140.53	203,383,057.21	1,619,553,197.74
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）	105,954,260.93	12,534,051.69	118,488,312.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

唐世春

基金管理人负责人

陈逸辛

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚至泰灵活配置混合基金”)转型而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2824号《关于准予信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》以及本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于2020年2月7日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，中信保诚基金管理有限公司于2020年1月8日起至2020年2月4日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册有关事项的议案》。原信诚至泰灵活配置混合基金自2020年2月7日起转型为本基金，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订为《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》。自2020年2月7日起《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。原信诚至泰灵活配置混合基金于基金合同失效前日未经审计的基金资产净值为141,201,824.71元，已于本基金的转型后首日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股

份有限公司。

根据《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费与销售服务费等费率收费差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费、但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》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，包括债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场工具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)。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1-3 年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2021 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《信诚至泰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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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 2020 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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和资产支持证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。

7.4.4.4 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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证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估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，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，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度

固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	1,868,922.11
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,868,922.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	73,269,698.47	72,135,817.20
	银行间市场	31,768,547.90	31,352,100.00
	合计	105,038,246.37	103,487,917.20
资产支持证券	2,869,500.00	2,869,800.00	300.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	107,907,746.37	106,357,717.20	-1,550,029.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,900,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,900,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	376.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	552.64

应收债券利息	2,127,819.13
应收资产支持证券利息	8,603.78
应收买入返售证券利息	842.36
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.36
合计	2,138,202.38

注：其他包括应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	4,071.25
合计	4,071.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	683.11
应付审计费	90,000.00
应付信息披露费	120,000.00
应付账户维护费	9,000.00
合计	219,683.11

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 实收基金

中信保诚至泰中短债 A:

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效 日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	24,843,483.54	24,843,483.54
本期申购	211,211,465.34	211,211,465.34
本期赎回（以“-”号填列）	-175,120,971.14	-175,120,971.14

本期末	60,933,977.74	60,933,977.74
-----	---------------	---------------

中信保诚至泰中短债 C:

金额单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 02 月 07 日 (基金合同生效 日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	100,046,230.14	100,046,230.14
本期申购	1,186,023,222.44	1,186,023,222.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,241,049,169.39	-1,241,049,169.39
本期末	45,020,283.19	45,020,283.19

注: 1. 申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有), 赎回含转换出份额(如有)。

2. 原信诚至泰灵活配置混合基金基金合同失效前的基金份额为 124,889,713.68 份, 已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

中信保诚至泰中短债 A:

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	4,302,857.76	-2,251,680.62	2,051,177.14
本期利润	966,923.16	-847,942.76	118,980.40
本期基金份额交易产生的变动数	5,676,728.72	-2,183,295.24	3,493,433.48
其中: 基金申购款	37,211,682.07	-17,986,350.66	19,225,331.41
基金赎回款	-31,534,953.35	15,803,055.42	-15,731,897.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,946,509.64	-5,282,918.62	5,663,591.02

中信保诚至泰中短债 C:

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	23,854,961.06	-9,594,027.17	14,260,933.89
本期利润	3,727,058.05	-1,223,681.57	2,503,376.48
本期基金份额交易产生的变动数	-16,581,323.98	6,687,474.28	-9,893,849.70
其中: 基金申购款	286,270,649.51	-	177,757,309.58
基金赎回款	-302,851,973.49	108,513,339.93	-187,651,159.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,000,695.13	-4,130,234.46	6,870,460.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 02 月 07 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	23,224.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,738.54
其他	164.93
合计	39,127.81

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年 12月31日
债券投资收益—买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,670,028.56
债券投资收益—赎回差价收入	-
债券投资收益—申购差价收入	-
合计	-6,670,028.56

7.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至 2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,694,340,437.72
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,679,555,455.78
减：应收利息总额	21,455,010.50
买卖债券差价收入	-6,670,028.56

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	24,620,554.65
减：卖出资产支持证券成本总额	24,130,500.00
减：应收利息总额	420,197.33

资产支持证券投资收益	69,857.32
------------	-----------

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年02月07日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,071,624.33
--股票投资	-
--债券投资	-2,069,524.33
--资产支持证券投资	-2,100.00
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,071,624.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年02月07日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	99,911.97
转换费收入	2,601.94
合计	102,513.91

注：1、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的25%归入转出基金的基金资产。

2、本基金的场外赎回费率不高于1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的25%归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 02 月 07 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	3,588.65
银行间市场交易费用	26,936.25
合计	30,524.90

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 02 月 07 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	83,934.59
信息披露费	107,868.81
账户维护费	32,340.70
其他	40,900.00
合计	265,044.10

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,058,827.39
其中：支付销售机构的客户维护费	636,458.16

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	352,942.45

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020 年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚至泰 中短债A	中信保诚至泰 中短债C	合计
中信保诚基金	-	13,902.55	13,902.55
中信银行	-	265,535.92	265,535.92

合计	-	279,438.47	279,438.47
----	---	------------	------------

注：本基金中信保诚至泰中短债 A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚至泰中短债 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

中信保诚至泰中短债 C 的销售服务费按前一日中信保诚至泰中短债 C 资产净值的 0.10%年费率计提。

计算公式为：中信保诚至泰中短债 C 基金日销售服务费=中信保诚至泰中短债 C 基金份额前一日资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年02月07日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,868,922.11	23,224.34

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末 2020 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金, 预期风险与预期收益低于股票型基金、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。本基金投资的金融工具主要包括债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设。在董事会下设立风控与审计委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等; 在管理层层面设立风险管理委员会, 实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策; 公司设立独立的监察稽核部和风险管理部, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统对风险进行持续监控。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行, 本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外, 本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 审慎进行债券投资, 通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	10,041,000.00
A-1 以下	-
未评级	16,006,400.00
合计	26,047,400.00

注: 以上评级取自第三方评级机构的债项评级, 未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	54,854,320.00
AAA以下	22,527,150.00
未评级	59,047.20
合计	77,440,517.20

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	2,869,800.00
AAA以下	-
未评级	-
合计	2,869,800.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。)

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末,本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币
元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,868,922.11	-	-	-	-	-	1,868,922.11
结算备付金	1,116,473.	-	-	-	-	-	1,116,473.7

	70						0
存出保证金	16,874.89	-	-	-	-	-	16,874.89
交易性金融资产	11,017,200.00	30,303,125.00	24,192,000.00	40,845,392.20	-	-	106,357,717.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,900,000.00	-	-	-	-	-	7,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,138,202.38	2,138,202.38
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	149,901.02	149,901.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,919,470.70	30,303,125.00	24,192,000.00	40,845,392.20	-	2,288,103.40	119,548,091.30
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	-	-	-	-	-	774,770.42	774,770.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,969.07	33,969.07
应付托管费	-	-	-	-	-	11,323.00	11,323.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,672.01	5,672.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,071.25	4,071.25
应交税费	-	-	-	-	-	10,289.82	10,289.82
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	219,683.11	219,683.11

						1	
负债总计	-	-	-	-	-	1,059,778.68	1,059,778.68
利率敏感度缺口	21,919,470.70	30,303,125.00	24,192,000.00	40,845,392.20	-	1,228,324.72	118,488,312.62

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2020年12月31日）	
	市场利率下降25个基点	236,585.34
市场利率上升25个基点	-235,021.37	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金未持有证券交易所上市的股票，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于本报告期末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债。因此其他价格风险的变动对本基金资产的净值无重大影响。本基金合同自2020年02月07日起生效，无上年度末数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为106,357,717.20元，无属于第一或第三层次的余额

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

7.1 资产负债表

会计主体:信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2020年02月06日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2020年02月06日	上年度末 2019年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	1,132,177.01	3,721,813.00
结算备付金	-	159,127.92	71,432.96
存出保证金	-	6,050.97	5,823.75
交易性金融资产	7.4.7.2	167,594,628.60	138,930,358.30
其中:股票投资	-	-	-
基金投资	-	-	-
债券投资	-	157,592,228.60	134,930,358.30
资产支持证券投资	-	10,002,400.00	4,000,000.00
贵金属投资	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款	-	-	797,835.69
应收利息	7.4.7.5	2,660,577.23	2,467,534.08
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	1,810,000.00	3,970,705.47
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计	-	173,362,561.73	149,965,503.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年02月06日	上年度末 2019年12月31日
负债:			

短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	24,634,791.50	10,861,000.00
应付证券清算款	-	-	174,224.87
应付赎回款	-	7,180,127.72	877,402.13
应付管理人报酬	-	13,805.32	67,221.08
应付托管费	-	2,300.89	11,203.50
应付销售服务费	-	1,963.90	8,532.32
应付交易费用	7.4.7.7	4,137.66	1,978.93
应交税费	-	19,717.00	8,842.86
应付利息	-	2,037.13	-807.67
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	301,855.90	289,000.00
负债合计	-	32,160,737.02	12,298,598.02
所有者权益:	-	-	-
实收基金	7.4.7.9	124,889,713.68	122,519,668.99
未分配利润	7.4.7.10	16,312,111.03	15,147,236.24
所有者权益合计	-	141,201,824.71	137,666,905.23
负债和所有者权益总计	-	173,362,561.73	149,965,503.25

注：1、截止本报告期末，基金份额总额 124,889,713.68 份。下属分级基金：信诚至泰 A 的基金份额净值 1.0826 元，基金份额总额 24,843,483.54 份；信诚至泰 C 的基金份额净值 1.1425 元，基金份额总额 100,046,230.14 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 02 月 06 日（基金合同失效前日）止期间。

7.2 利润表

会计主体：信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 02 月 06 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年01月01 日至2020年02 月06日	上年度可比期间 2019年01月01 日至2019年12月 31日
一、收入	-	886,914.30	7,490,452.88
1. 利息收入	-	638,512.19	6,398,943.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,011.17	39,167.31
债券利息收入	-	603,668.67	6,327,941.72
资产支持证券利息收入	-	32,832.35	2,093.89
买入返售金融资产收入	-	-	29,740.34
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	39,670.58	1,129,870.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-

债券投资收益	7.4.7.13	39,670.58	1,129,870.91
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	207,757.53	-206,410.20
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	974.00	168,048.91
减：二、费用	-	197,746.94	2,221,079.78
1.管理人报酬	-	79,949.30	832,888.16
2.托管费	-	13,324.89	138,814.62
3.销售服务费	-	11,093.76	33,231.49
4.交易费用	7.4.7.18	1,476.80	12,190.02
5.利息支出	-	54,722.45	936,482.58
其中：卖出回购金融资产支出	-	54,722.45	936,482.58
6.税金及附加	-	2,112.54	20,116.41
7.其他费用	7.4.7.19	35,067.20	247,356.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-	689,167.36	5,269,373.10
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-	689,167.36	5,269,373.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年02月06日

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年02月06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)	122,519,668.99	15,147,236.24	137,666,905.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	689,167.36	689,167.36
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)	2,370,044.69	475,707.43	2,845,752.12
其中：1.基金申购款	75,336,539.78	9,864,042.26	85,200,582.04
2.基金赎回款	-72,966,495.09	-9,388,334.83	-82,354,829.92
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)	124,889,713.68	16,312,111.03	141,201,824.71
项目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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)	208,270,401.46	9,037,669.87	217,308,071.33

二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	5,269,373.10	5,269,373.10
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)	-85,750,732.47	840,193.27	-84,910,539.20
其中: 1. 基金申购款	185,877,460.81	22,063,118.13	207,940,578.94
2. 基金赎回款	- 271,628,193.28	- 21,222,924.86	- 292,851,118.14
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)	122,519,668.99	15,147,236.24	137,666,905.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

唐世春	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚至泰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[2016]2121号《关于准予信诚至泰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”)《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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205,229,992.34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(2017)第493号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年6月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,238,907.78份基金份额,其中认购资金利息折合8,915.44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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于2017年12月20日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》,经中华人民共和国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”,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《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费与销售服务费等费率收费差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购或申购时收取认购费或申购费,但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购或申购时不收取认购费或申购费,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚至泰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、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、存出保证金和应收申购款等。基金的业绩比较基准

为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2021 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《信诚至泰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 7.4.4 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。

如财务报表附注 7.4.8.2 所述，本基金于 2020 年 2 月 7 日变更注册为中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 2 月 6 日(基金合同失效前日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

7.4.4.4 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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，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，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指

数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 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, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 02 月 06 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	1, 132, 177. 01	3, 721, 813. 00
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1, 132, 177. 01	3, 721, 813. 00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 02 月 06 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	26, 496, 698. 78	26, 593, 428. 60
	银行间市场	130, 576, 334. 66	130, 998, 800. 00
	合计	157, 073, 033. 44	157, 592, 228. 60
资产支持证券	10, 000, 000. 00	10, 002, 400. 00	2, 400. 00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	167, 073, 033. 44	167, 594, 628. 60	521, 595. 16
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	22,182,366.78	22,215,158.30	32,791.52
	银行间市场	112,434,153.89	112,715,200.00	281,046.11
	合计	134,616,520.67	134,930,358.30	313,837.63
资产支持证券		4,000,000.00	4,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		138,616,520.67	138,930,358.30	313,837.63

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年02月06日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,738.88	982.24
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	280.81	35.31
应收债券利息	2,621,571.40	2,464,356.85
应收资产支持证券利息	35,974.14	2,156.71
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	12.00	2.97
合计	2,660,577.23	2,467,534.08

注：其他包括应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 02 月 06 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	4,137.66	1,978.93
合计	4,137.66	1,978.93

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 02 月 06 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付审计费	66,065.41	60,000.00
应付信息披露费	232,131.19	220,000.00
应付账户维护费	3,659.30	9,000.00
合计	301,855.90	289,000.00

7.4.7.9 实收基金

信诚至泰 A:

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 02 月 06 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	26,761,773.79	26,761,773.79
本期申购	11,097,700.61	11,097,700.61
本期赎回(以“-”号填列)	-13,015,990.86	-13,015,990.86
本期末	24,843,483.54	24,843,483.54

信诚至泰 C:

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 02 月 06 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	95,757,895.20	95,757,895.20
本期申购	64,238,839.17	64,238,839.17
本期赎回(以“-”号填列)	-59,950,504.23	-59,950,504.23
本期末	100,046,230.14	100,046,230.14

注：申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有)，赎回含转换出份额(如有)。

7.4.7.10 未分配利润

信诚至泰 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	4,525,748.71	-2,468,468.72	2,057,279.99
本期利润	80,683.07	33,591.99	114,275.06
本期基金份额交易产生的变动数	-303,574.02	183,196.11	-120,377.91
其中：基金申购款	1,919,850.23	-1,008,761.80	911,088.43
基金赎回款	-2,223,424.25	1,191,957.91	-1,031,466.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,302,857.76	-2,251,680.62	2,051,177.14

信诚至泰 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,434,909.94	-9,344,953.69	13,089,956.25
本期利润	400,726.76	174,165.54	574,892.30
本期基金份额交易产生的变动数	1,019,324.36	-423,239.02	596,085.34
其中：基金申购款	15,173,068.44	-6,220,114.61	8,952,953.83
基金赎回款	-14,153,744.08	5,796,875.59	-8,356,868.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,854,961.06	-9,594,027.17	14,260,933.89

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年02月06日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	1,756.64	25,207.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	245.50	13,809.70
其他	9.03	149.67
合计	2,011.17	39,167.31

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年02月06日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
债券投资收益—买卖债券（、债转股及债	39,670.58	1,129,870.91

券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	39,670.58	1,129,870.91

7.4.7.13.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年02月06日	2019年01月01日至2019年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	36,151,599.43	473,178,115.56
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	35,612,880.44	463,497,346.95
减：应收利息总额	499,048.41	8,550,897.70
买卖债券差价收入	39,670.58	1,129,870.91

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年02月06日	2019年01月01日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	207,757.53	-206,410.20
--股票投资	-	-
--债券投资	205,357.53	-206,410.20
--资产支持证券投资	2,400.00	-
--基金投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

--权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	207,757.53	-206,410.20

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年02月06日	2019年01月01日至2019年12月31日
基金赎回费收入	974.00	152,410.33
转换费收入	-	15,638.58
合计	974.00	168,048.91

注: 1、本基金的场外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年02月06日	2019年01月01日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	109.30	230.02
银行间市场交易费用	1,367.50	11,960.00
合计	1,476.80	12,190.02

7.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年02月06日	2019年01月01日至2019年12月31日
审计费用	6,065.41	60,000.00
信息披露费	12,131.19	120,000.00
银行费用	2,911.30	21,156.50
账户维护费	3,659.30	45,000.00
其他	10,300.00	1,200.00
合计	35,067.20	247,356.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，于 2020 年 2 月 7 日，本基金正式实施变更注册，修订后的《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。基金名称由“信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金”变更为“中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金”。

除以上情况外，截至本财务报告批准报出日，本基金无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至 2020年02月06日	2019年01月01日至 2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	79,949.30	832,888.16
其中：支付销售机构的客户维护费	35,797.89	375,078.14

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年 02月06日	2019年01月01日至2019 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,324.89	138,814.62

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年01月01日至2020年02月06日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚至泰 A	信诚至泰 C	合计
中信保诚基金	-	1.19	1.19
中信银行	-	11,090.35	11,090.35
合计	-	11,091.54	11,091.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚至泰 A	信诚至泰 C	合计
中信保诚基金	-	1.68	1.68
中信银行	-	33,037.08	33,037.08
合计	-	33,038.76	33,038.76

注：本基金信诚至泰 A 基金份额不收取销售服务费，信诚至泰 C 基金份额的销售服务费年费率为0.10%。

信诚至泰 C 的销售服务费按前一日信诚至泰 C 资产净值的0.10%年费率计提。

计算公式为：信诚至泰 C 基金日销售服务费=信诚至泰 C 基金份额前一日资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年02月06日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,132,177.01	1,756.64	3,721,813.00	25,207.94

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末2020年02月06日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				类型			位: 张)			
149030	20 领益 01	2020 年 01 月 21 日	2020 年 02 月 21 日	新发 未上 市	100.00	100.39	10,000	1,000,000. 00	1,003,900. 00	

7.4.12.1.2 受限证券类别：资产支持证券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位: 张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
13838 7	元熹 1 优 1	2020 年 01 月 08 日	2020 年 02 月 17 日	新发未 上市	100.0 0	100.00	60,000	6,000,000.0 0	6,000,000.0 0	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 02 月 06 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 16,999,791.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011901656	19 青岛城 投 SCP006	2020 年 02 月 07 日	100.31	100,000	10,031,000.00
011902088	19 海通恒 信 SCP005	2020 年 02 月 07 日	100.11	80,000	8,008,800.00
101800413	18 厦门特 房 MTN001	2020 年 02 月 07 日	102.62	20,000	2,052,400.00
合计				200,000	20,092,200.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 02 月 06 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,635,000.00 元，于 2020 年 02 月 11 日、2020 年 02 月 18 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经

营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设。在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;公司设立独立的监察稽核部和风险管理部,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统对风险进行持续监控。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行,本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外,本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,审慎进行债券投资,通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2020年02月06日	上年度末 2019年12月31日
A-1	10,050,000.00	10,034,500.00
A-1以下	-	-
未评级	42,128,291.30	46,112,100.00
合计	52,178,291.30	56,146,600.00

注:以上评级取自第三方评级机构的债项评级,未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2020年02月06日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
AAA	10,002,400.00	4,000,000.00
未评级	-	-
合计	10,002,400.00	4,000,000.00

注:以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 02 月 06 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	19,629,000.00
合计	-	19,629,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 02 月 06 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	66,406,200.00	22,523,300.00
AAA 以下	32,669,600.00	32,599,200.00
未评级	6,338,137.30	4,032,258.30
合计	105,413,937.30	59,154,758.30

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末,除所持有的卖出回购金融资产款将在一年以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求

对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。)

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末,本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2020 年 02 月 06 日	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,132,177.0	-	-	-	-	-	1,132,177.0

	1						1
结算备付金	159,127.92	-	-	-	-	-	159,127.92
存出保证金	6,050.97	-	-	-	-	-	6,050.97
交易性金融资产		33,595,837.30	55,235,291.30	78,763,500.00	-	-	167,594,628.60
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	-	-	-	-	-	2,660,577.23	2,660,577.23
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,810,000.00	1,810,000.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,297,355.90	33,595,837.30	55,235,291.30	78,763,500.00	-	4,470,577.23	173,362,561.73
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	24,634,791.50	-	-	-	-	-	24,634,791.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,180,127.72	7,180,127.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,805.32	13,805.32
应付托管费	-	-	-	-	-	2,300.89	2,300.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,963.90	1,963.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,137.66	4,137.66
应交税费	-	-	-	-	-	19,717.00	19,717.00
应付利息	-	-	-	-	-	2,037.13	2,037.13
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	301,855.90	301,855.90
负债总计	24,634,791.50	-	-	-	-	7,525,945.52	32,160,737.02

利率敏感度缺口	23,337,435.60	33,595,837.30	55,235,291.30	78,763,500.00		-3,055,368.29	141,201,824.71
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,721,813.00	-	-	-	-	-	3,721,813.00
结算备付金	71,432.96	-	-	-	-	-	71,432.96
存出保证金	5,823.75	-	-	-	-	-	5,823.75
交易性金融资产	6,003,600.00	17,105,700.00	72,959,758.30	42,861,300.00	-	-	138,930,358.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-797,835.69	797,835.69
应收利息	-	-	-	-	-	2,467,534.08	2,467,534.08
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,970,705.47	3,970,705.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,802,669.71	17,105,700.00	72,959,758.30	42,861,300.00	-	7,236,075.24	149,965,503.25
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	10,861,000.00	-	-	-	-	-	10,861,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-174,224.87	174,224.87
应付赎回款	-	-	-	-	-	-877,402.13	877,402.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,221.08	67,221.08
应付托管费	-	-	-	-	-	11,203.50	11,203.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,532.32	8,532.32

应付交易费用	-	-	-	-	1,978.93	1,978.93
应交税费	-	-	-	-	8,842.86	8,842.86
应付利息	-	-	-	-	-807.67	-807.67
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-289,000.00	289,000.00
负债总计	10,861,000.00	-	-	-	1,437,598.02	12,298,598.02
利率敏感度缺口	-1,058,330.29	17,105,700.00	72,959,758.30	42,861,300.00	5,798,477.22	137,666,905.23

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年02月06日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	508,500.48	260,856.31
市场利率上升 25 个基点	-504,633.11	-259,192.34	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金未持有证券交易所上市股票，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债。因此其他价格风险的变动对本基金资产的净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 167,594,628.60 元，无属于第一或第三层次的余额(上年度末：第二层次 138,930,358.30 元，无第一或第三层次)

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	106,357,717.20	88.97
	其中：债券	103,487,917.20	86.57
	资产支持证券	2,869,800.00	2.40
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,900,000.00	6.61
	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	2,985,395.81	2.50

8	其他各项资产	2,304,978.29	1.93
9	合计	119,548,091.30	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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境内投资股票。

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票买卖交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,049,447.20	6.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	66,127,370.00	55.81
5	企业短期融资券	18,057,000.00	15.24
6	中期票据	11,254,100.00	9.50
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	103,487,917.20	87.34

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	042000072	20 攀钢集 CP001	100,000	10,041,000.00	8.47

2	136257	16 新投 02	85,000	8,497,450.00	7.17
3	012001570	20 国投交控 SCP001	80,000	8,016,000.00	6.77
4	112423	16 株国投	80,000	8,000,800.00	6.75
5	019640	20 国债 10	80,000	7,990,400.00	6.74

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	138497	平汽 5A2	30,000	2,869,800.00	2.42

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

8.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,874.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,138,202.38
5	应收申购款	149,901.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,304,978.29

8.12.4 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。

8.12.5 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投资，不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§8 投资组合报告

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	167,594,628.60	96.67
	其中：债券	157,592,228.60	90.90
	资产支持证券	10,002,400.00	5.77
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	1,291,304.93	0.74
8	其他各项资产	4,476,628.20	2.58
9	合计	173,362,561.73	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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境内投资股票。

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票买卖交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,340,928.60	5.91
	其中：政策性金融债	8,340,928.60	5.91
4	企业债券	22,395,500.00	15.86
5	企业短期融资券	50,175,500.00	35.53
6	中期票据	76,680,300.00	54.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	157,592,228.60	111.61

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101800350	18 津渤海 MTN002	100,000	10,523,000.00	7.45
2	102000012	20 鲁钢铁 MTN001	100,000	10,094,000.00	7.15
3	011901557	19 西安高新	100,000	10,044,000.00	7.11

		SCP007			
4	011901656	19 青岛城投 SCP006	100,000	10,031,000.00	7.10
5	011902088	19 海通恒信 SCP005	100,000	10,011,000.00	7.09

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
1	ZC0004	元熹 1 优 1	60,000	6,000,000.00	4.25
2	165602	PR21A1	40,000	4,002,400.00	2.83

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

8.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,050.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,660,577.23
5	应收申购款	1,810,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,476,628.20

8.12.4 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。

8.12.5 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投资,不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信保诚至泰中短债 A	230	264,930.34	45,740,554.39	75.07%	15,193,423.35	24.93%
中信保诚至泰中短债 C	2,276	19,780.44	8,938,094.41	19.85%	36,082,188.78	80.15%
合计	2,506	42,280.23	54,678,648.8	51.61%	51,275,612.13	48.39%

			0		
--	--	--	---	--	--

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚至泰中短债 A	91.91	0.00%
	中信保诚至泰中短债 C	126.40	0.00%
	合计	218.31	0.00%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚至泰中短债 A	0~10
	中信保诚至泰中短债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚至泰中短债 A	0
	中信保诚至泰中短债 C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 基金份额持有人信息

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信诚至泰 A	199	124,841.63	11,087,699.8	44.63%	13,755,783.70	55.37%

			4			
信诚至泰 C	264	378,962.99	0.00	0.00%	100,046,230.14	100.00%
合计	463	269,740.20	11,087,699.84	8.88%	113,802,013.84	91.12%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信诚至泰 A	110.31	0.00%
	信诚至泰 C	135.13	0.00%
	合计	245.44	0.00%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信诚至泰 A	0~10
	信诚至泰 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚至泰 A	0
	信诚至泰 C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 10 开放式基金份额变动

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

单位：份

项目	中信保诚至泰中短债 A	中信保诚至泰中短债 C
----	-------------	-------------

基金合同生效日(2020年02月07日) 基金份额总额	24,843,483.54	100,046,230.14
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	211,211,465.34	1,186,023,222.44
减:基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	175,120,971.14	1,241,049,169.39
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	60,933,977.74	45,020,283.19

§ 10 开放式基金份额变动

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

单位:份

项目	信诚至泰 A	信诚至泰 C
基金合同生效日(2017年06月06日) 基金份额总额	185,175,191.88	20,063,715.90
本报告期期初基金份额总额	26,761,773.79	95,757,895.20
本报告期基金总申购份额	11,097,700.61	64,238,839.17
减:本报告期基金总赎回份额	13,015,990.86	59,950,504.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	24,843,483.54	100,046,230.14

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为自2020年1月8日起至2020年2月4日17:00止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。本次会议于2020年2月6日表决通过了《关于信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册有关事项的议案》,会议详情请见基金管理人于2020年1月6日在《中国证券报》及指定网站刊登的《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,基金份额持有人大会的决议自该日起生效。自2020年2月7日起,本基金正式实施基金转型,基金名称变更为“中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金”,修订后的《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同》、《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金托管协议》、《中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金招募说明书》生效,原《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》自同日起失效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。
2. 本报告期内,中信银行股份有限公司根据工作需要,于2020年10月9日,任命杨璋琪先生担任本行资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金召开基金份额持有人大会转型，转型后本基金投资策略变更为：

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、债券投资策略

(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、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。

1) 目标久期控制

本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。

2) 期限结构配置

在确定债券组合的久期之后，本基金将采用收益率曲线分析策略，自上而下进行期限结构配置。具体来说，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹型、哑铃型、梯形等配置方法，确定在短、中、长期债券的投资比例。

3) 信用利差策略

一般来说，信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。本基金将从宏观经济环境与信用债市场供需状况两个方面对市场信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于信用债市场供求，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。

4) 相对价值投资策略

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。

5) 回购放大策略

本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当地通过回购融资来提高资金利用率，以增强组合收益。

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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 83,934.59 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	72,099,157.52	18.84%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	63,922,734.70	16.70%	470,448,000.00	22.88%	-	-	-
西藏东财	39,120,787.48	10.22%	883,300,000.00	42.96%	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	126,148,200.47	32.96%	358,282,000.00	17.42%	-	-	-
中信建投	81,425,780.00	21.28%	344,300,000.00	16.74%	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 01 日
2	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2020 年 01 月 02 日
3	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2020 年 01 月 02 日
4	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	同上	2020 年 01 月 02 日
5	中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	同上	2020 年 01 月 06 日
6	中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的第一次提示性公告	同上	2020 年 01 月 07 日
7	中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的第二次提示性公告	同上	2020 年 01 月 08 日
8	中信保诚基金管理有限公司基金经理变更公告	同上	2020 年 01 月 16 日
9	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	同上	2020 年 01 月 17 日
10	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第四季度报告	同上	2020 年 01 月 17 日

11	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2020 年 01 月 17 日
12	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	同上	2020 年 01 月 17 日
13	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告	同上	2020 年 01 月 30 日
14	关于召开信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的补充公告	同上	2020 年 02 月 04 日
15	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同	同上	2020 年 02 月 07 日
16	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金托管协议	同上	2020 年 02 月 07 日
17	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金招募说明书	同上	2020 年 02 月 07 日
18	中信保诚基金管理有限公司关于信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	同上	2020 年 02 月 07 日
19	中信保诚基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	同上	2020 年 03 月 21 日
20	中信保诚基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	同上	2020 年 04 月 14 日
21	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	同上	2020 年 04 月 22 日
22	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转型)2020 年第一季度报告	同上	2020 年 04 月 22 日
23	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	同上	2020 年 04 月 25 日
24	信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	同上	2020 年 04 月 25 日
25	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁基金基金转换费率优惠活动的公告	同上	2020 年 07 月 16 日
26	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第二季度报告提示性公告	同上	2020 年 07 月 21 日
27	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金 2020 年第二季度报告	同上	2020 年 07 月 21 日
28	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	同上	2020 年 08 月 28 日

29	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(原信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金转型)2020年中期报告	同上	2020年08月28日
30	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	同上	2020年09月01日
31	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	同上	2020年09月01日
32	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金2020年第三季度报告提示性公告	同上	2020年10月28日
33	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金2020年第三季度报告	同上	2020年10月28日
34	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	同上	2020年11月27日
35	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	同上	2020年11月27日
36	中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金更新招募说明书(2020年11月)	同上	2020年11月27日

§ 11 重大事件揭示

信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	3,249,324.90	43.02%	3,800,000.00	15.27%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	4,304,332.00	56.98%	3,086,000.00	12.40%	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	18,000,000.00	72.33%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	2020-09-25 至 2020-09-28, 2020-10-27 至 2020-11-01	-	43,376,420.58	43,376,420.58	-	-
	2	2020-10-20 至 2020-12-31	-	45,740,554.39	-	45,740,554.39	43.17%
	3	2020-10-27 至 2020-10-28	-	69,303,228.84	60,365,134.43	8,938,094.41	8.44%

个人	1	2020-02-13 至 2020-02-13	-	46,111,777 .18	46,111,777 .18	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、(原)信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、(原)信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、(原)信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 5、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金基金合同
- 6、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金招募说明书
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 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

2021 年 03 月 26 日