

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF) (原信诚鼎利定增灵活配置混合型
证券投资基金转型)2017 年第四季度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 1 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2017 年 11 月 27 日起,本基金的基金名称由“信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金”变更为“信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。根据基金合同约定,本基金在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额;封闭期届满后,本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。本基金的封闭期自 2016 年 5 月 24 日起至 2017 年 11 月 24 日止,自 2017 年 11 月 25 日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金本报告期自 2017 年 10 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日止,信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)本报告期自 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

基金简称	信诚鼎利(LOF)
场内简称	信诚鼎利
基金主代码	165528
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2016 年 5 月 24 日
报告期末基金份额总额	676,621,757.79 份
投资目标	在严格控制风险的前提下,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	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</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,</p>

	<p>严选安全边际较高的个股。</p> <p>本基金在进行个股筛选时, 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; ROE、ROIC、毛利率、净利率等; PE、PEG、PB、PS 等。</p> <p>3、固定收益投资策略</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。</p> <p>4、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>5、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, 确定其合理内在价值, 构建交易组合。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券, 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	50%×沪深 300 指数收益率+50%×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, 属于较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注: 本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.2 原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	信诚鼎利定增
场内简称	信诚定增
基金主代码	165528
基金运作方式	契约型基金。基金合同生效后, 在封闭期内不开放申购、赎回业务, 但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封

	闭期届满后, 本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。
基金合同生效日	2016 年 5 月 24 日
报告期末基金份额总额	1, 216, 702, 748. 19 份
投资目标	在严格控制风险的前提下, 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	本基金在基金合同生效后 18 个月内, 将积极参与上市公司的定向增发。通过宏观经济、行业分析、实施定向增发公司的定增条款和基本面深入研究基础上, 利用定向增发项目的事件性特征与折价优势, 优选具有较高折价保护并通过定向增发能够改善企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资, 同时考虑行业偏离及风险, 用量化的方法进行组合配置, 规避非系统风险。本基金转为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后, 投资策略相应调整。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×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, 属于较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注: 本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	8, 711, 885. 93
2. 本期利润	-6, 193, 878. 75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0079
4. 期末基金资产净值	684, 415, 760. 31
5. 期末基金份额净值	1. 012

3.1 主要财务指标

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2017 年 10 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日)
1. 本期已实现收益	8, 884, 909. 53
2. 本期利润	-85, 287, 961. 25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0701
4. 期末基金资产净值	1, 236, 504, 477. 82
5. 期末基金份额净值	1. 016

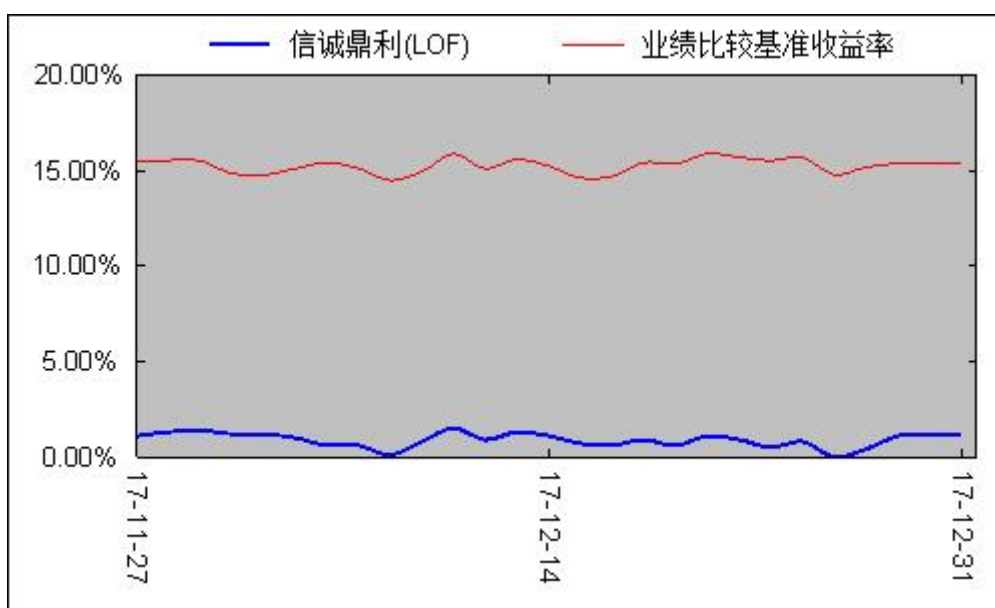
3.2 基金净值表现

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	-0.39%	0.42%	-0.73%	0.43%	0.34%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金转型日期为2017年11月24日，截止报告期末，本基金转型未满一年。

2、本基金建仓期自2016年5月24日至2016年11月24日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

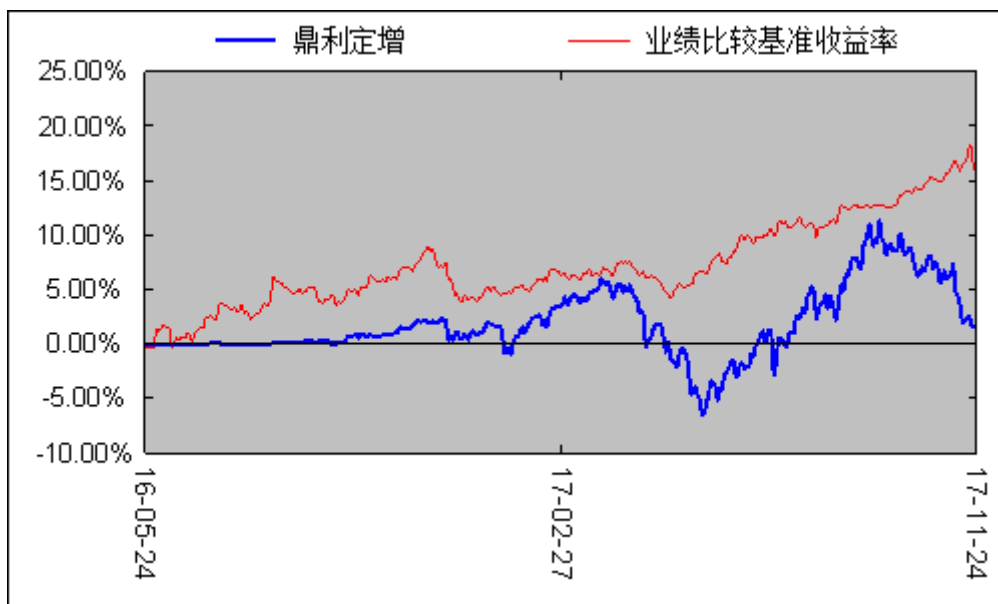
3.2 基金净值表现

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	-6.45%	0.71%	3.06%	0.39%	-9.51%	0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期自 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 11 月 24 日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

3.3 其他指标

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
殷孝东	本基金基金经理, 信诚多策略灵活配置混合基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合基金的基金经理, 投资银行部董事总经理	2016 年 12 月 16 日	-	15	工商管理硕士。曾任职于大鹏证券有限公司, 担任资讯部分析师; 于中信证券股份有限公司, 历任研究部行业首席分析师、研究部执行总经理、研究部运营负责人、投行委能源化工组执行总经理、经发管委执行总经理等职。2016 年 3 月加入中信保诚基金管理有限公司, 担任投行部董事总经理。现兼任信诚鼎利灵活配置混合基金(LOF)、信诚多策略灵活配置混合基金(LOF)、信诚鼎泰多策略灵活配置

					混合基金的基金经理。
韩益平	本基金基金经理	2017 年 7 月 4 日	-	4	理学硕士。曾任职于中化国际（新加坡）公司，担任交易员；于中信证券股份有限公司，担任研究部高级分析师。2016 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任高级投资经理。现任信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。
杨旭	本基金基金经理，兼任信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理。	2015 年 8 月 6 日	2017 年 10 月 31 日	5	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司，担任数量分析师；于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司，担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、专户投资经理。现任量化投资二部副总监，信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证建设工程指数型基金（LOF）、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理。

--	--	--	--	--	--

注:1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 17 年四季度,市场经历的两个阶段,从 10 月初到 11 月底,在基本面和十九大等政策因素预期下,市场走出较强的上升走势,基本面强劲的大消费和大金融板块表现亮眼,同时半导体和 5G 主题表现活跃。11 月底开始市场由于流动性紧张和年底效应,进入较为剧烈的调整阶段,前期涨幅较高蓝筹龙头面临较大幅度的调整,市场整体走势偏弱。

本基金于 2017 年 11 月 24 日封闭期满,于 11 月 25 日起转化为上市开放式基金(LOF),并于 11 月 27 日更名为“信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

本报告期内,本基金为保证基金开放后申购赎回的流动性,从 10 月下旬开始逐步降低股票仓位,在 11 月底开放申购市最低仓位为 30%,因此抵御了 12 月市场的大幅调整。从 12 月中下旬开始,基于对市场企稳的判断和对 2018 年整体市场的谨慎乐观,我们逐步增加仓位。

在具体配置上,我们坚持“守正+出奇”,以保证在低波动的前提下获得绝对收益。“守正”即严格按照沪深 300 的比例配置大金融、地产和基本面确定的大消费等蓝筹个股,根据市场的变化适当低配或者超配其中的部分子行业;“出奇”即将除蓝筹外剩余的大约 60%权益仓位重仓于先进制造和创新领域的 100 亿以上中等市值成长股,以获取绝对收益和业绩弹性。我们认为大金融的低估值和大消费确定基本面会使守正类资产的波动率较低,作为良好的防御品种,可以抵御中等市值成长股市场预期不一致情况下的不确定性带来的股价波动,同时中等市值成长股大部分股价相对涨幅较低,业绩和估值双重反转有望带来超额收益,是良好的进攻性品种。

展望 2018 年一季度,我们认为市场目前的风格依然存在不确定性,但是整体市场调整风险已经在 2017 年四季度得到充分释放,判断准确市场的结构性机会和精选个股长期持有是取得超额收益的关键。基于前期定增投资的个股精选能力是本产品管理人的核心能力,我们也将继续坚持寻找增长与估值匹配的中等市值优质成长龙头配置策略,并适当结合沪深 300 做均衡配置,以降低产品的波动性,获得绝对收益。

从 2018 年开始,本产品将不再参加定增投资,坚持“守正+出奇”的均衡配置大方向,以绝对收益和低

波动为目标,为持有人创造价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金(2017-10-1至2017-11-24)基金份额净值增长率为-6.45%,同期业绩比较基准收益率为3.06%,基金落后业绩比较基准9.51%。信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017-11-25至2017-12-31)基金份额净值增长率为-0.39%,同期业绩比较基准收益率为-0.73%,基金超越业绩比较基准0.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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两百人)的情形。

§5 投资组合报告

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	437,724,833.04	63.04
	其中:股票	437,724,833.04	63.04
2	固定收益投资	150,355,750.00	21.65
	其中:债券	150,355,750.00	21.65
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	60,000,000.00	8.64
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	44,087,272.76	6.35
7	其他资产	2,240,245.17	0.32
8	合计	694,408,100.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	23.46	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	282,175,722.41	41.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	518,122.10	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,660,900.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	4,518,957.94	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	-
J	金融业	101,384,388.97	14.81
K	房地产业	25,580,000.00	3.74

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,852,594.06	3.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	11.55	-
	合计	437,724,833.04	63.96

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未进行沪港通投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002503	搜于特	5,921,579	32,073,829.52	4.69
2	600887	伊利股份	879,968	28,326,169.92	4.14
3	600036	招商银行	841,186	24,411,217.72	3.57
4	002142	宁波银行	1,351,925	24,077,784.25	3.52
5	000807	云铝股份	2,281,116	21,785,047.08	3.18
6	002573	清新环境	915,982	20,820,270.86	3.04
7	300285	国瓷材料	1,018,100	20,362,000.00	2.98
8	600436	片仔癀	315,000	19,908,000.00	2.91
9	601688	华泰证券	1,150,000	19,849,000.00	2.90
10	601288	农业银行	5,000,100	19,150,383.00	2.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	990,100.00	0.14
8	同业存单	149,365,650.00	21.82
9	其他	-	-
10	合计	150,355,750.00	21.97

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值
----	------	------	-------	---------	---------

					比例 (%)
1	111715481	17 民生银行 CD481	1,500,000	149,365,650.00	21.82
2	128024	宁行转债	9,901	990,100.00	0.14

注：本基金本报告期末仅持有上述债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

5.7 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

5.9.2 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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,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。

5.11.2

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	449,011.03
2	应收证券清算款	1,382,555.10
3	应收股利	-
4	应收利息	408,679.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,240,245.17
---	----	--------------

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002503	搜于特	13,246,621.50	1.94	非公开发行有明确锁定期
2	000807	云铝股份	11,669,541.24	1.71	非公开发行有明确锁定期

5.11.6 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。

§ 5 投资组合报告

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	330,263,011.92	26.63
	其中:股票	330,263,011.92	26.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	759,986,853.64	61.28
7	其他资产	149,883,393.68	12.09
8	合计	1,240,133,259.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	20.60	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	270,002,358.42	21.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,485.27	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,237,700.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	43,032,736.54	3.48

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,893,700.00	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	11.09	-
	合计	330,263,011.92	26.71

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未进行沪港通投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002503	搜于特	10,221,579	60,502,219.09	4.89
2	000807	云铝股份	5,484,616	48,417,543.72	3.92
3	601318	中国平安	390,000	29,101,800.00	2.35
4	600887	伊利股份	649,903	19,497,090.00	1.58
5	601137	博威合金	1,606,439	19,148,752.88	1.55
6	600531	豫光金铅	2,660,402	17,571,955.21	1.42
7	002099	海翔药业	2,656,226	16,030,134.25	1.30
8	600036	招商银行	449,806	13,534,662.54	1.09
9	603806	福斯特	350,000	12,572,000.00	1.02
10	600584	长电科技	552,158	12,274,472.34	0.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期内未进行债券投资。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期内未进行债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

5.7 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

5.9.2 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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,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。

5.11.2

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	240,001.90
2	应收证券清算款	149,439,590.64
3	应收股利	-
4	应收利息	203,801.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,883,393.68

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002503	搜于特	28,640,906.49	2.32	非公开发行有明确锁定期
2	601137	博威合金	19,148,752.88	1.55	非公开发行有明确锁定期
3	600531	豫光金铅	17,571,955.21	1.42	非公开发行有明确锁定期
4	002099	海翔药业	12,875,615.74	1.04	非公开发行有明确锁定期
5	000807	云铝股份	10,351,387.08	0.84	非公开发行有明确锁定期

5.11.6 其他需说明的重要事项

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。

§ 6 开放式基金份额变动

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,216,702,748.19
报告期期间基金总申购份额	109,761.08
减：报告期期间基金总赎回份额	540,190,751.48
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	676,621,757.79

§ 6 开放式基金份额变动

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,216,702,748.19
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,216,702,748.19

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,257,048.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,257,048.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.19

注：报告期期间买入/申购总份额包含申购，转入，份额强增和红利再投；报告期期间卖出/赎回总份额包含赎回，转出和份额强减。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期管理人未运用固有资金投资本基金交易。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,357,048.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	100,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,257,048.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.10

注:报告期期间买入/申购总份额包含申购,转入,份额强增和红利再投;报告期期间卖出/赎回总份额包含赎回,转出和份额强减。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人持有本基金份额变动来自份额强减。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2017 年 11 月 24 日发布了《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)及基金名称变更的公告》。根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。本基金的封闭期是指自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日(若该日为非工作日或无该对应日,则为该日之前的最后一个工作日)的期间。封闭期届满后,本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。本基金的封闭期自 2016 年 5 月 24 日起至 2017 年 11 月 24 日止,自 2017 年 11 月 25 日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。自 2017 年 11 月 27 日起,本基金的基金名称变更为“信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”,场外基金简称变更为“信诚鼎利(LOF)”,场内基金简称变更为“信诚鼎利”,基金代码为 165528。转换后的信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的申购、赎回 2017 年 11 月 27 日开始办理,详见本基金管理人于 2017 年 11 月 22 日发布的《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、(原)信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件

- | |
|--|
| <ol style="list-style-type: none">2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程3、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同4、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书6、本报告期内按照规定披露的各项公告 |
|--|

10.2 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

10.3 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.xcfunds.com。

中信保诚基金管理有限公司

2018 年 1 月 19 日