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 年年度报告

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

送出日期：2018 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 3 月 29 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。

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 1 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....7
§2 基金简介.....7
2.1 基金基本情况.....7
2.2 基金产品说明.....7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....8
3.1 主要会计数据和财务指标.....8
3.2 基金净值表现.....8
3.3 其他指标.....9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....10
§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 其他指标.....12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....12
§4 管理人报告.....12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 18
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
§6 审计报告 18
6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18
§6 审计报告 20
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
§7 年度财务报表 22
7.1 资产负债表 22
7.2 利润表 23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 24
7.4 报表附注 25
§7 年度财务报表 44
7.1 资产负债表 44
7.2 利润表 46
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 47
7.4 报表附注 48
§8 投资组合报告 72
8.1 期末基金资产组合情况 72
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 73
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 73
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 76
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 77
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 77
8.8 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 77
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 77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 77
8.12 投资组合报告附注 78
§8 投资组合报告 78
8.1 期末基金资产组合情况 78
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 79

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.....80
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....82
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.....82
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.....82
8.8 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.....82
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.....82
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....83
8.12 投资组合报告附注.....83
§9 基金份额持有人信息.....84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....84
9.2 期末上市基金前十名持有人.....84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....85
9.4 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的情况.....85
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....85
§9 基金份额持有人信息.....85
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....85
9.2 期末上市基金前十名持有人.....86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....86
9.4 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的情况.....86
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....86
§10 开放式基金份额变动.....87
§10 开放式基金份额变动.....87
§11 重大事件揭示.....87
11.1 基金份额持有人大会决议.....87
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.....87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....88
11.4 基金投资策略的改变.....88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....88
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.....89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....89
11.8 其他重大事件.....90
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....91
12.7 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.....91
12.8 影响投资者决策的其他重要信息.....92
§13 备查文件目录.....92
13.7 备查文件名称.....92
13.8 备查文件存放地点.....92
13.9 备查文件查阅方式.....92

§2 基金简介

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2.1 基金基本情况

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	676,621,757.79 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2016 年 8 月 31 日

注：根据基金合同约定,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)”。

2.2 基金产品说明

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	1、资产配置策略 本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。 2、股票投资策略 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,严选安全边际较高的个股。 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。 3、固定收益投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。 4、股指期货投资策略

	基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 5、权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。 6、资产支持证券投资策略 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,采用数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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	郭明
	联系电话	021-68649788	（010）66105799
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0066	95588
传真		021-50120888	（010）66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		张翔燕	易会满

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

项目	名称	办公地址
-	-	-

§2 基金简介

原信诚鼎利定增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	鼎利定增
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
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
报告期末基金份额总额	1,216,702,748.19
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2016 年 8 月 31 日

注：根据基金合同约定,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)”。

2.2 基金产品说明

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。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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（2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日）
本期已实现收益	8,711,885.93
本期利润	-6,193,878.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0079
本期加权平均净值利润率	-0.78%
本期基金份额净值增长率	-0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 12 月 31 日）
期末可供分配利润	7,794,002.52
期末可供分配基金份额利润	0.0115
期末基金资产净值	684,415,760.31
期末基金份额净值	1.012
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 12 月 31 日）
基金份额累计净值增长率	-0.39%

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。

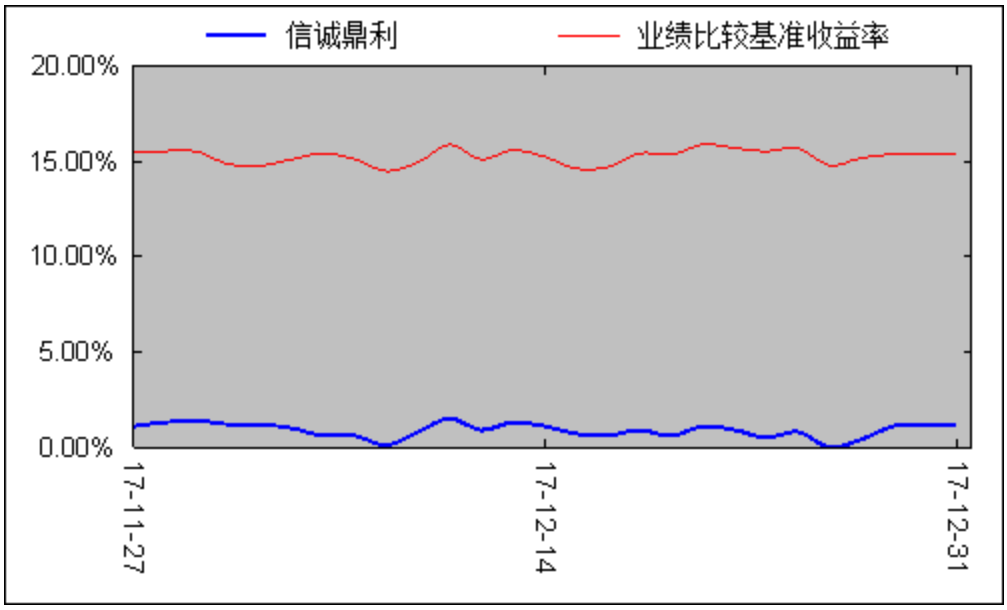
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	-0.39%	0.42%	-0.73%	0.43%	0.34%	-0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.39%	0.42%	-0.73%	0.43%	0.34%	-0.01%

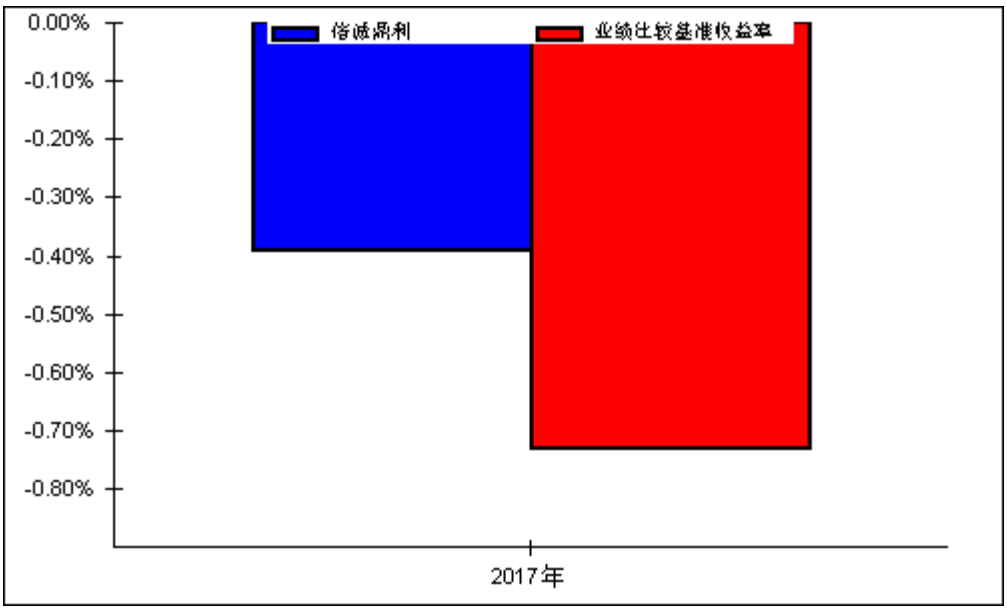
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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. 本基金建仓日自 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。

3.2.3 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



注:2017 年的净值增长率按照基金转型后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

其他指标	报告期(2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)
-	-

其他指标	报告期末(2017 年 12 月 31 日)
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2016	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近三年未进行利润分配

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 24 日,本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

原信诚鼎利定增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	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日）	报告期(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日）
本期已实现收益	7,496,580.57	1,218,331.49
本期利润	7,552,711.72	12,249,017.91
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0101
本期加权平均净值利润率	0.60%	1.00%
本期基金份额净值增长率	0.59%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 11 月 24 日）	报告期末（2017 年 11 月 24 日）
期末可供分配利润	8,714,912.06	1,218,331.49
期末可供分配基金份额利润	0.0072	0.0010
期末基金资产净值	1,236,504,477.82	1,228,951,766.10
期末基金份额净值	1.016	1.010
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 11 月 24 日）	报告期末（2017 年 11 月 24 日）
基金份额累计净值增长率	1.60%	1.00%

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。

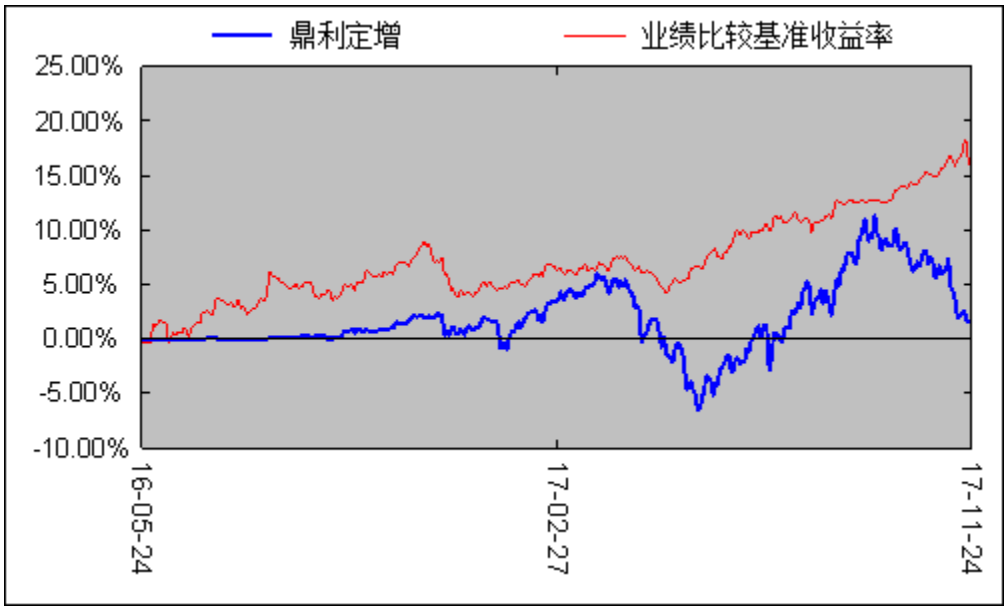
3.2 基金净值表现

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

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	-6.45%	0.71%	3.06%	0.39%	-9.51%	0.32%

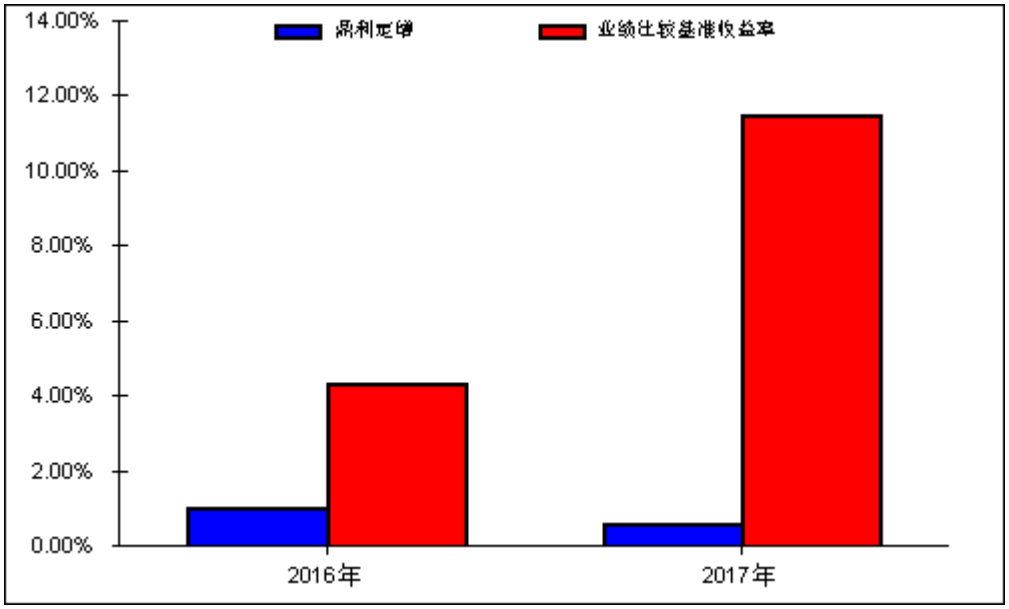
过去六个月	3.67%	0.88%	5.78%	0.33%	-2.11%	0.55%
过去一年	0.59%	0.77%	11.46%	0.31%	-10.87%	0.46%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.60%	0.60%	16.25%	0.36%	-14.65%	0.24%

3.2.2 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



本基金建仓日自 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。

3.2.3 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



3.3 其他指标

其他指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日）
-	-

其他指标	报告期末(2017 年 11 月 24 日)
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017		-	-	-	本基金本期未分红。
2016	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近三年未进行利润分配

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2017 年 12 月 31 日,本基金管理人管理的运作中基金为 73 只, 分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券性证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级

证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠选债券型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚智惠金货币市场基金、信诚至盛灵活配置混合型证券投资基金。另外,信诚月月定期支付债券型证券投资基金已于 2017 年 12 月 12 日进入清算程序、信诚至信灵活配置混合型证券投资基金已于 2017 年 12 月 20 日进入清算程序、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金已于 2017 年 12 月 26 日进入清算程序。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、信诚中证基建工程指数型基金(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遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚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 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,如有异常情况将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 2017 年,A 股市场呈现出明显的分化走势,以消费,金融,地产和周期品为代表的价值蓝筹表现抢眼,而前一轮牛市中表现抢眼的中小成长股相对较差,传媒,军工等高估值板块呈现深不见底的下跌趋势。我们认为市场分化是在全球经济逐步复苏,利率攀升的背景下市场投资者对盈利确定性和现金流的严格追求所导致的,其背后的宏观逻辑值得我们深思。

本产品在 2017 年主要以被动持有定增股票为主,且定向增发资产主要分布于中小成长股和周期股板块,因此产品相对收益明显跑输沪深 300 比较基准,且回撤较大。2017 年 11 月 24 日本产品从封闭式基金转换为开放式基金,前期已投资定增股票也陆续到期解禁,投资策略逐步转向为二级市场投资,配置资产类别和仓位控制进一步灵活。

本产品配置方向逐步从以中小创和周期为代表的定增类资产逐步向消费升级,大金融和先进制造转变。

考虑到从封闭式基金转换为开放式基金过程中可能存在的大额赎回需求,本产品在打开后保持在较低的仓位,以稳健低波动的大金融和大消费配置为主。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

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(2017/1/1 至 2017/11/24)份额净值增长率为 0.59% ,同期业绩比较基准收益率为 11.46%,基金落后业绩比较基准 10.87%。

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)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%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年,我们认为全球经济复苏进程将逐步加速,可能进入经济过热阶段,以大消费,大金融和周期板块为代表的价值蓝筹的基本面依然处于景气向上进程中。但是由于价值蓝筹个股已经积累了 2016-2017 年两年的巨大涨幅,短期市场预期的变化可能带来股价的大幅波动,整体市场的波动将会进一步加剧。

同时以创业板为代表成长股经过近两年的调整,部分优质企业估值已经回到相对合理的水平。但是在利率上升周期中,产业链下游面临成本上涨,现金流紧张,盈利前景不确定等问题,大股东与投资者对企业价值的分歧继续加大。一方面大股东不断增持,一方面投资者依然观望并期待右侧机会。我们认为 2018 年创业板可能迎来长周期底部,更重要的是部分优质的新兴产业成长股已经进入底部左侧布局区域,值得价值投资者深入研究与发掘。

具体配置策略上,我们将仍然以价值蓝筹为主要配置方向,但紧密关注新兴产业中优质成长股的机会,兼顾价值“守正”,成长“出奇”的策略。

在价值蓝筹上,我们认为在经济逐步走向过热的过程中,股价弹性空间和波动性都存在周期股〉金融股〉消费股的特点。由于 2018 年市场整体波动较大,我们将根据市场情况灵活调整仓位,对不同板块做适当轮动,以绝对收益和低波动为努力方向。

在成长股筛选上,以储备长期左侧投资品种为主,根据市场整体风格变化的情况逐步增加成长股仓位。优选以 5G,半导体,军工等为代表的国家战略新兴产业,同时筛选大股东大比例增持等内在驱动因子较强的个股选择性布局。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年度内,依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1、对公司规章制度体系不断补充和完善。

公司监察稽核部组织各业务部门对公司相关规章制度进行梳理补充和完善,主要包括投资、销售、风控、产品、电子商务、信息技术、营销策划、运营、监察稽核、子公司等业务范畴。推进了公司规章制度建设,完善了公司规章制度体系。

2、开展各类合规监察工作。

监察稽核部严格遵照法律法规和公司制度,对基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况进行监督检查,防范内幕交易,防范不正当关联交易和利益输送,确保基金运作的独立性、公平性及合规性,维护基金份额持有人的合法权益。

3、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时将新颁布的监管法规传递给公司相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4、开展各类内外部审计工作,包括 4 次常规审计、20 项专项检查、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成多项自查工作等。

5、完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法规要求进行信息披露和公告,并按法律法规规定报监管机构备案。

6、牵头开展反洗钱的各项工作,进一步更新完善了反洗钱制度,按照相关规定将可疑交易报告及时上报中国反洗钱监测中心,根据中国人民银行通知要求组织开展反洗钱培训和宣传工作。

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、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2.基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

4.基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次每份基金份额可供分配利润的 25%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

4.9 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两百人)的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对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)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,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)的管理人--中信保诚基金管理有限公司在信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人依法对中信保诚基金管理有限公司编制和披露的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 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20940 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) 全体基金份额持有人
审计意见	审计意见段
形成审计意见的基础	形成审计意见的基础
强调事项	审计报告强调事项
其他事项	审计报告其他事项
其他信息	审计报告其他信息
管理层和治理层对	信诚鼎利混合基金(LOF)的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称

财务报表的责任	“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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚鼎利混合基金(LOF)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鼎利混合基金(LOF)、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鼎利混合基金(LOF)的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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: (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。 (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。 (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。 (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,就可能导致对信诚鼎利混合基金(LOF)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鼎利混合基金(LOF)不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 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。

注册会计师的姓名	
薛　　竞	
赵　　钰	

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)
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	2018 年 3 月 28 日

注：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 11 月 25 日（转型后首日）至 2017 年 12 月 31 日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出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文

§6 审计报告

原信诚鼎利定增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
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20940 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) 全体基金份额持有人
审计意见	审计意见段
形成审计意见的基础	形成审计意见的基础
强调事项	审计报告强调事项
其他事项	审计报告其他事项
其他信息	审计报告其他信息
管理层和治理层对财务报表的责任	信诚鼎利混合基金(LOF)的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(原“信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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚鼎利混合基金(LOF)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鼎利混合基金(LOF)、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鼎利混合基金(LOF)的财务报告过

	程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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: (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。 (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。 (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。 (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,就可能导致对信诚鼎利混合基金(LOF)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鼎利混合基金(LOF)不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 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。

注册会计师的姓名	
薛　　竞	
赵　　钰	

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)
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	2018 年 3 月 28 日

注：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金 2017 年 11 月 24 日（基金转型前一日）的资产负债表,2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日（基金转型前一日）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出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文

§7 年度财务报表

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

7.1 资产负债表

会计主体：信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	38,680,254.29
结算备付金		5,407,018.47
存出保证金		449,011.03
交易性金融资产	7.4.7.2	588,080,583.04
其中：股票投资		437,724,833.04
基金投资		-
债券投资		150,355,750.00
资产支持证券投资		-
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	60,000,000.00
应收证券清算款		1,382,555.10
应收利息	7.4.7.5	408,679.04
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		694,408,100.97
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 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		4,744,847.58

应付赎回款		1,595,124.39
应付管理人报酬		943,482.32
应付托管费		157,247.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,814,851.35
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	736,787.99
负债合计		9,992,340.66
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	676,621,757.79
未分配利润	7.4.7.10	7,794,002.52
所有者权益合计		684,415,760.31
负债和所有者权益总计		694,408,100.97

注：

1.报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.012 元,基金份额总额 676,621,757.79 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2017 年 11 月 25 日(转型后首日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-4,087,751.20
1.利息收入		639,579.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	294,789.47
债券利息收入		286,597.83
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		58,191.78
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,718,977.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,718,977.33
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.17	-14,905,764.68

填列）		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,459,457.07
减：二、费用		2,106,127.55
1．管理人报酬		1,222,227.14
2．托管费		203,704.50
3．销售服务费		-
4．交易费用	7.4.7.19	633,282.76
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．其他费用	7.4.7.20	46,913.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,193,878.75
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,193,878.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 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）	1,216,702,748.19	19,801,729.63	1,236,504,477.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,193,878.75	-6,193,878.75
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）	-540,080,990.40	-5,813,848.36	-545,894,838.76
其中：1.基金申购款	109,761.08	905.28	110,666.36
2.基金赎回款	-540,190,751.48	-5,814,753.64	-546,005,505.12
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）	676,621,757.79	7,794,002.52	684,415,760.31

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：

吕涛　　陈逸辛　　刘卓

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为“信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金”,以下简称“本基金”)是根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,由原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转型而来。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金为契约型基金,封闭期是 2016 年 5 月 24 日(转型后首日)起至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日的期间。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。2017 年 11 月 24 日封闭期届满后,信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。自 2017 年 11 月 25 日起,原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金更名为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF),原《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,236,504,477.82 元,已于本基金的基金合同生效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(原名为“信诚基金管理有限公司”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 573 号文审核同意,本基金 408,791,677.00 份基金份额于 2016 年 8 月 31 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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、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)。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例范围为 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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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 2018 年 3 月 27 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚鼎利灵活配置混合型证券

投资基金(LOF)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 2017 年 11 月 25 日(转型后首日)至 2017 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 11 月 25 日(转型后首日)至 2017 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 2017 年 11 月 25 日(转型后首日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

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和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入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和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其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。

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和托管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

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,其中场外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,场内基金份额持有人只能选择现金分红。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和债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)》,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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外),按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责

任公司所独立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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。

(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。

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 2017 年 12 月 31 日
活期存款	38,680,254.29
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	38,680,254.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		

	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	441,543,780.15	437,724,833.04	-3,818,947.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券交易所市场	990,100.00	990,100.00	-
债券银行间市场	149,365,650.00	149,365,650.00	-
债券合计	150,355,750.00	150,355,750.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	591,899,530.15	588,080,583.04	-3,818,947.11

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 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	60,000,000.00	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	60,000,000.00	-

注:交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为 60,000,000.00 人民币元。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末,未持有任何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 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	25,372.29
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	38,315.04
应收债券利息	286,597.83
应收买入返售证券利息	58,191.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	202.10
合计	408,679.04

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 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,814,851.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,814,851.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,444.82
预提审计费	100,000.00
预提信息披露费	600,000.00
其他	35,343.17
合计	736,787.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
本期申购	109,761.08	109,761.08
本期赎回（以“-”号填列）	-540,190,751.48	-540,190,751.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	676,621,757.79	676,621,757.79

注:

1.原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前的实收基金为 1,216,702,748.19 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的实收基金。

2.截至 2017 年 12 月 31 日止,本基金于深交所上市的基金份额为 184,570,751.00 份,托管在场外未上市交易的基金份额为 492,051,006.79 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

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	8,714,912.06	11,086,817.57	-
本期利润	8,711,885.93	-14,905,764.68	-6,193,878.75
本期基金份额交易产生的变动数	-6,315,093.93	501,245.57	-5,813,848.36
其中：基金申购款	1,941.06	-1,035.78	905.28
基金赎回款	-6,317,034.99	502,281.35	-5,814,753.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,111,704.06	-3,317,701.54	7,794,002.52

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	285,390.26
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	8,193.47
其他	1,205.74
合计	294,789.47

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

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	185,346,780.46
减：卖出股票成本总额	176,627,803.13
买卖股票差价收入	8,718,977.33

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益---赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益---申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-14,905,764.68
——股票投资	-14,905,764.68
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-14,905,764.68

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,459,457.07
合计	1,459,457.07

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	633,282.76
银行间市场交易费用	-
合计	633,282.76

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	10,137.84
信息披露费	30,413.52
银行费用	278.43
债券账户维护费	-
基金上市费	6,083.36
上清所 CFCA 数字证书服务费	-
其他	-
合计	46,913.15

7.4.7.21 分部报告

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

截至财务报表报出日,本基金并无须作披露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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
中信保诚人寿保险有限公司(“中信保诚人寿”)	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

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交易。

7.4.10.1.5 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 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,222,227.14
其中：支付销售机构的客户维护费	420,390.20

注:支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	203,704.50

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2016 年 5 月 24 日)持有的基金份额	1,257,048.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动的份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	1,257,048.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%

注:本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金合同公布的费率执行。

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本基金基金合同公布的费率执行,本基金本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 2017 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入

中国工商银行	38,680,254.29	285,390.26

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币 4,660,826.90 元。

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 其它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

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	网下新股申购未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下新股申购未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下新股申购	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

				未上市						
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下新股申购未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
600531	豫光金铅	2016-12-20	2017-12-17	非公开定向增发	7.50	6.06	1,330,201	9,976,507.50	8,061,018.06	-
000807	云铝股份	2016-11-18	2017-11-20	非公开定向增发	5.20	9.03	1,292,308	6,720,001.60	11,669,541.24	-
002099	海翔药业	2016-09-19	2017-09-18	非公开定向增发	10.28	5.51	2,153,113	22,134,001.64	11,863,652.63	-
601137	博威合金	2016-08-18	2017-08-18	非公开定向增发	11.20	10.83	1,200,233	13,442,609.60	12,998,523.39	-
002503	搜于特	2016-11-11	2017-11-13	非公开定	6.30	5.25	2,523,166	15,895,945.80	13,246,621.50	-

				向增发						

7.4.12.1.2 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
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	新债申购未上市	100.00	100.00	9,901	990,100.00	990,100.00	-

证券类别	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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:基金可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603986	兆易创新	2017-11-01	重大资产重组	153.73	2018-03-02	150.00	50,000	6,603,096.00	7,686,500.00	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-02-09	8.24	811,493	6,504,888.86	7,425,160.95	-
600227	赤天化	2017-10-27	重大资产重组	7.09	2018-02-01	6.38	295,428	1,775,522.28	2,094,584.52	-
300730	科创信息	2017-12-25	股价异常波动停牌核查	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

002919	名臣健康	2017-12-28	股价异常波动停牌核查	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注:本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。本基金主要投资于消费服务行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳定增值。

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;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,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与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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、拒绝支付到期本息等情况,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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2017 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	149,365,650.00
合计	149,365,650.00

注:债券评级取自第三方评级机构的债项评级,未评级部分为同业存单。

7.4.13.2.2 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 2017 年 12 月 31 日
AAA	990,100.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	990,100.00

注:债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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,另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。

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。

于 2017 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的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,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位:人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月到 1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产									
资产总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债									
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	38,680,254.29	-	-	-	-	-	-	38,680,254.29
结算备付金	5,407,018.47	-	-	-	-	-	-	5,407,018.47
存出保证金	449,011.03	-	-	-	-	-	-	449,011.03
交易性金融资产	149,365,650.00	-	-	-	-	990,100.00	437,724,833.04	588,080,583.04
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	-	-	-	60,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	1,382,555.10	1,382,555.10
应收利息	-	-	-	-	-	-	408,679.04	408,679.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	253,901,933.79	-	-	-	-	990,100.00	439,516,067.18	694,408,100.97
负债								
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	4,744,847.58	4,744,847.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	1,595,124.39	1,595,124.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	943,482.32	943,482.32
应付托管费	-	-	-	-	-	-	157,247.03	157,247.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	1,814,851.35	1,814,851.35
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	736,787.99	736,787.99
负债总计	-	-	-	-	-	-	9,992,340.66	9,992,340.66
利率敏感度缺口	253,901,933.79	-	-	-	-	990,100.00	429,523,726.52	684,415,760.31

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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(2017 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点	18,374.22
	市场利率上升 25 个基点	-18,369.73

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,并通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(ValueatRisk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产-股票投资	437,724,833.04	63.96
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	437,724,833.04	63.96

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	假设
	除业绩比较基准中的股票指数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(2017 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	17,818,826.11
	业绩比较基准中的股票指数下降5%	-17,818,826.11

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1.-
	2.-

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 2017 年 12 月 31 日,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一层次的余额为 362,530,722.55 元,属于第二层次的余额为 225,549,860.49 元,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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股票和债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,确定相关股票和债券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 2017 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外,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

原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

7.1 资产负债表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 11 月 24 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	753,616,829.34	102,998,999.62
结算备付金		6,370,024.30	308,619.14
存出保证金		240,001.90	45,884.68
交易性金融资产	7.4.7.2	330,263,011.92	1,127,245,007.10
其中：股票投资		330,263,011.92	1,087,285,007.10
基金投资		-	-
债券投资		-	39,960,000.00
资产支持证券投资		-	-
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		149,439,590.64	-
应收利息	7.4.7.5	203,801.14	768,621.32
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,240,133,259.24	1,231,367,131.86
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 11 月 24 日**	**上年度末 2016 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		-	-
应付管理人报酬		1,259,377.19	1,565,041.88
应付托管费		209,896.19	260,840.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,410,799.59	154,140.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	748,708.45	435,343.17
负债合计		3,628,781.42	2,415,365.76

所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
未分配利润	7.4.7.10	19,801,729.63	12,249,017.91
所有者权益合计		1,236,504,477.82	1,228,951,766.10
负债和所有者权益总计		1,240,133,259.24	1,231,367,131.86

注：

1.报告截止日 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)，基金份额净值 1.016 元，基金份额总额 1,216,702,748.19 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		32,121,716.42	26,071,333.87
1.利息收入		3,127,407.67	7,231,896.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	728,981.26	5,324,058.82
债券利息收入		168,142.47	502,124.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,230,283.94	1,405,713.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,938,177.60	7,808,751.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,950,321.68	7,725,875.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	83,920.00	82,875.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,279,340.00	-
股利收益	7.4.7.16	4,183,275.92	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	56,131.15	11,030,686.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		24,569,004.70	13,822,315.96

1．管理人报酬		16,867,175.69	11,073,019.31
2．托管费		2,811,195.87	1,845,503.24
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	4,439,081.62	434,696.35
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	7.4.7.20	451,551.52	469,097.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,552,711.72	12,249,017.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,552,711.72	12,249,017.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日

单位：人民币元

项目	**本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 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）	1,216,702,748.19	12,249,017.91	1,228,951,766.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,552,711.72	7,552,711.72
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	1,216,702,748.19	12,249,017.91	1,236,504,477.82
项目	**上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 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）	1,216,702,748.19	-	1,216,702,748.19
二、本期经营活动产生的	-	12,249,017.91	12,249,017.91

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	1,216,702,748.19	12,249,017.91	1,228,951,766.10

报表附注为财务报表的组成部分。

7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

吕涛	陈逸辛	刘卓
基金管理负责人	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

信诚鼎利定增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] 751 号《关于准予信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,216,348,748.86 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(2016)第 490 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,216,702,748.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 353,999.33 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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,本基金的封闭期是指基金合同生效之日起至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日的期间。本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)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 573 号文审核同意,本基金 408,791,677.00 份基金份额于 2016 年 8 月 31 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据根据《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,截至 2017 年 11 月 24 日,本基金 18 个月封闭期届满。自 2017 年 11 月 25 日起,本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF),《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》自 2017 年 11 月 25 日起生效,原《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚鼎利定增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、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)。本基金的投资组合比例为封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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 2018 年 3 月 27 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚鼎利定增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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日) 止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日) 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。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)止期间。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

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(主要为股指期货投资、权证投资)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。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公允价值变动计入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(主要为股指期货投资、权证投资)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。每份基金份额面值为 1.00 元。

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和托管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

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,其中场外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,场内基金份额持有人只能选择现金分红。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和债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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 11 月 14 日前对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 11 月 14 日起,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)》,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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外),按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立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

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)》,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,本基金自 2017 年 11 月 14 日起改为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。该估值技术变更使本基金 2017 年 12 月 24 日(基金转型前一日)的基金资产净值及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日(基金转型前一日) 止期间的净损益减少,相关影响非重大。

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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 。

(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。

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 2017 年 11 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	753,616,829.34	102,998,999.62
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 11 月 24 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	319,176,194.35	330,263,011.92	11,086,817.57

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券交易所市场	-	-	-
债券银行间市场	-	-	-
债券合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	319,176,194.35	330,263,011.92	11,086,817.57

项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,076,298,240.68	1,087,285,007.10	10,986,766.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券交易所市场	-	-	-
债券银行间市场	39,916,080.00	39,960,000.00	43,920.00
债券合计	39,916,080.00	39,960,000.00	43,920.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,116,214,320.68	1,127,245,007.10	11,030,686.42

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

注：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

注：本基金于本报告期末及上年度末未持有任何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 2017 年 11 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	154,601.97	20,604.29
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	48,716.97	138.90
应收债券利息	-	747,857.53

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	482.20	20.60
合计	203,801.14	768,621.32

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 2017 年 11 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,409,822.69	153,312.79
银行间市场应付交易费用	976.90	827.62
合计	1,410,799.59	154,140.41

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 11 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提审计费	89,862.16	100,000.00
预提信息披露费	569,586.48	300,000.00
基金上市费	53,916.64	-
其他	35,343.17	35,343.17
合计	748,708.45	435,343.17

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,216,702,748.19	1,216,702,748.19

注:

1. 根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金于 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)止期间暂不向投资人开放基金交易。

2. 截至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)止,本基金于深交所上市的基金份额为 436,783,530.00 份,托管在场外未上市交易的基金份额为 779,919,218.19 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

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	1,218,331.49	11,030,686.42	19,801,729.63
本期利润	7,496,580.57	56,131.15	7,552,711.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,714,912.06	11,086,817.57	19,801,729.63

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	634,100.28	1,319,978.98
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	3,992,055.55
结算备付金利息收入	30,266.32	11,854.07
其他	64,614.66	170.22
合计	728,981.26	5,324,058.82

注:其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款的利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,732,510,297.72	103,305,126.56
减：卖出股票成本总额	1,706,559,976.04	95,579,250.83
买卖股票差价收入	25,950,321.68	7,725,875.73

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 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	83,920.00	82,875.57
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	83,920.00	82,875.57

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,916,000.00	20,515,793.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,916,080.00	20,257,040.00
减：应收利息总额	916,000.00	175,877.66
买卖债券差价收入	83,920.00	82,875.57

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 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 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益---买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,279,340.00	-
合计	-1,279,340.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,183,275.92	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,183,275.92	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	56,131.15	11,030,686.42
——股票投资	100,051.15	10,986,766.42
——债券投资	-43,920.00	43,920.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	56,131.15	11,030,686.42

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,439,081.62	434,196.35
银行间市场交易费用	-	500.00
合计	4,439,081.62	434,696.35

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	89,862.16	100,000.00
信息披露费	269,586.48	300,000.00
银行费用	1,086.24	7,697.06
债券账户维护费	36,000.00	6,000.00
CFCA 数字证书服务费	300.00	-
基金上市费	53,916.64	-
其他	800.00	55,400.00
合计	451,551.52	469,097.06

7.4.7.21 分部报告

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

原《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 25 日起失效,《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日起生效,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)。

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
中信保诚人寿保险有限公司(“中信保诚人寿”)	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

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交易。

7.4.10.1.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,867,175.69	11,073,019.31
其中：支付销售机构的客户维护费	4,549,367.46	2,883,270.04

注:支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,811,195.87	1,845,503.24

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日(基金合同生效日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,501,602.00	-
报告期间申购/买入总份额	1,431,436.00	6,501,602.00
报告期间因拆分变动的份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,675,990.00	-
报告期末持有的基金份额	1,257,048.00	6,501,602.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.10%	0.53%

注:本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金合同公布的费率执行。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 11 月 24 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中信保诚人寿	20,005,300.00	1.64%	20,005,300.00	1.64%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 11 月 24 日		上年度可比期间 2016 年 5 月 24 日至 2016 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
中国工商银行	753,616,829.34	634,100.28	102,998,999.62	1,319,978.98

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币5,623,832.73元。(2016年末:308,619.14元。)

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 其它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

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（报告期间结束日期）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：股票										
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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600200	江苏吴中	2016-10-17	2017-10-12	非公开定向增发	17.49	11.09	1	17.49	11.09	-
00274	仙	2016-09-	2017-09-	非	37.2	20.6	1	37.25	20.60	-

6	坛股份	21	20	公开定向增发	5	0				
600531	豫光金铅	2016-12-20	2017-12-17	非公开定向增发	7.50	6.61	2,660,402	19,953,015.00	17,571,955.21	-
002226	江南化工	2016-10-19	2017-10-19	非公开定向增发	8.14	5.62	200,000	1,628,000.00	1,124,000.00	-
002099	海翔药业	2016-09-19	2017-09-18	非公开定向增发	10.28	5.98	2,153,113	22,134,001.64	12,875,615.74	-
300259	新天科技	2016-09-27	2017-09-26	非公开定向增发	11.00	8.62	705,522	7,760,742.00	6,081,599.64	-
601137	博威合金	2016-08-18	2017-08-18	非公开定向增发	11.20	11.92	1,606,439	17,992,116.80	19,148,752.88	-
000807	云铝股	2016-11-18	2017-11-20	非公开	5.20	8.01	1,292,308	6,720,001.60	10,351,387.08	-

	份			定向增发						
600075	新疆天业	2016-08-23	2017-08-18	非公开定向增发	8.24	7.31	503,782	4,152,603.20	3,682,646.42	-
300296	利亚德	2016-09-05	2017-08-28	非公开定向增发	14.20	20.37	3,703	52,582.60	75,430.11	-
002503	搜于特	2016-11-11	2017-11-13	非公开定向增发	6.30	5.73	4,998,413	31,490,001.90	28,640,906.49	-
603685	晨丰科技	2017-11-17	2017-11-27	网下新股申购未上市	21.04	21.04	932	19,609.28	19,609.28	-
603711	香飘飘	2017-11-23	2017-11-30	网下新股申购未上市	14.18	14.18	1,318	18,689.24	18,689.24	-
60380	豪	2017-11-	2017-11-	网	22.3	22.3	900	20,151.00	20,151.00	-

9	能股份	20	28	下新股申购未上市	9	9				
603848	好太太	2017-11-23	2017-12-01	网下新股申购未上市	7.89	7.89	1,377	10,864.53	10,864.53	-
603917	合力科技	2017-11-24	2017-12-04	网下新股申购未上市	14.22	14.22	1,022	14,532.84	14,532.84	-
002913	奥士康	2017-11-24	2017-12-01	网下新股申购未上市	30.38	30.38	1,442	43,807.96	43,807.96	-
300727	润禾材料	2017-11-17	2017-11-27	网下新股申购未上市	8.34	8.34	870	7,255.80	7,255.80	-

300729	乐歌股份	2017-11-24	2017-12-01	网下新股申购未上市	16.06	16.06	941	15,112.46	15,112.46	-

7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券类别	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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:

1、基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,本基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起 12 个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%;采取大宗交易方式的,在任意连续 90 日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外,本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份,在受让后 6 个月内,不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600227	赤天化	2017-10-27	重大资产重组	6.68	2018-02-01	6.38	295,428	1,775,522.28	1,973,459.04	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-02-09	8.24	811,493	6,504,888.86	7,425,160.95	-
603986	兆易创新	2017-11-01	重大资产	163.12	2018-03-02	150.00	50,000	6,603,096.00	8,156,000.00	-

			重组							
300285	国瓷材料	2017-09-20	重大资产重组	23.03	2017-12-19	21.33	464,000	10,061,865.00	10,685,920.00	-

注:本基金截至 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日)止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。本基金主要投资于消费服务行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳定增值。

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;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,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与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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、拒绝支付到期本息等情况,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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日),本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2016 年 12 月 31 日:同)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本年度末及上年度末均未持有长期信用债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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,另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。

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。

于 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日),本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,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 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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%(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该比例限制),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%。

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情

况良好。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 11 月 24 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	753,616,829.34	-	-	-	-	-	-	753,616,829.34
结算备付金	6,370,024.30	-	-	-	-	-	-	6,370,024.30
存出保证金	240,001.90	-	-	-	-	-	-	240,001.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	330,263,011.92	330,263,011.92
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	149,439,590.64	149,439,590.64
应收利息	-	-	-	-	-	-	203,801.14	203,801.14
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	760,226,855.54	-	-	-	-	-	479,906,403.70	1,240,133,259.24
负债								
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	1,259,377.19	1,259,377.19
应付托管费	-	-	-	-	-	-	209,896.19	209,896.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	1,410,799.59	1,410,799.59
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	748,708.45	748,708.45
负债总计	-	-	-	-	-	-	3,628,781.42	3,628,781.42
利率敏感度缺口	760,226,855.54	-	-	-	-	-	476,277,622.28	1,236,504,477.82

上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产				-		-		
银行存款	102,998,999.62	-	-	-	-	-	-	
结算备付金	308,619.14	-	-	-	-	-	-	
存出保证金	45,884.68	-	-	-	-	-	-	
交易性金融资产	-	39,960,000.00	-	-	-	-	1,087,285,007.10	
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	
应收利息	-	-	-	-	-	-	768,621.32	
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	上年同期科目金额
资产总计	103,353,503.44	39,960,000.00	-	-	-	-	1,088,053,628.42	1,231,367,131.86
负债								
卖出回购金融资产款	-	-	-		-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-		-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-		-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-		-	-	1,565,041.88	1,565,041.88
应付托管费	-	-	-		-	-	260,840.30	260,840.30
应付销售服务费	-	-	-		-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-		-	-	154,140.41	154,140.41
应交税费	-	-	-		-	-	-	-
应付利息	-	-	-		-	-	-	-
应付利润	-	-	-		-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-		-	-	-	-
其他负债	-	-	-		-	-	435,343.17	435,343.17
负债总计	-	-	-	-	-	-	2,415,365.76	2,415,365.76
利率敏感度缺口	103,353,503.44	39,960,000.00	-	-	-	-	1,085,638,262.66	1,228,951,766.10

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交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的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(2017 年 11 月 24 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)

	市场利率下降 25 个基点	-	18,520.05
	市场利率上升 25 个基点	-	-18,502.89

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,并通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。封闭期内本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-100%,非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 11 月 24 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	330,263,011.92	26.71	1,087,285,007.10	88.47
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	330,263,011.92	26.71	1,087,285,007.10	88.47

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	假设
	除业绩比较基准中的股票指数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(2017 年 11 月 24 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	18,438,490.41	5,950,351.97
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-18,438,490.41	-5,950,351.97

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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 2017 年 11 月 24 日,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一层次的余额为 202,320,123.56 元,属于第二层次的余额为 127,942,888.36 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第一层次 122,956,663.64 元,第二层次 1,004,288,343.46 元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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股票和债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,确定相关股票和债券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 2017 年 11 月 24 日(基金转型前一日),本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日: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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外,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

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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	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	其他各项资产	2,240,245.17	0.32
8	合计	694,408,100.97	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期内未进行港股通投资。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	600584	长电科技	852,058	18,174,397.14	2.66
12	300296	利亚德	863,703	16,833,571.47	2.46
13	600048	保利地产	1,060,000	14,999,000.00	2.19
14	002099	海翔药业	2,656,226	14,771,645.77	2.16
15	601137	博威合金	1,306,439	14,222,016.51	2.08
16	601318	中国平安	192,800	13,492,144.00	1.97
17	000063	中兴通讯	290,000	10,544,400.00	1.54
18	002415	海康威视	250,000	9,750,000.00	1.42
19	000002	万科 A	300,000	9,318,000.00	1.36
20	600531	豫光金铅	1,380,559	8,387,337.90	1.23
21	603986	兆易创新	50,000	7,686,500.00	1.12
22	002470	金正大	811,493	7,425,160.95	1.08
23	002217	合力泰	699,972	6,999,720.00	1.02
24	601100	恒立液压	250,000	6,860,000.00	1.00
25	300259	新天科技	705,522	6,737,735.10	0.98
26	600276	恒瑞医药	80,077	5,523,711.46	0.81
27	601766	中国中车	429,985	5,207,118.35	0.76
28	000661	长春高新	25,000	4,575,000.00	0.67
29	600009	上海机场	100,000	4,501,000.00	0.66
30	603806	福斯特	106,800	3,641,880.00	0.53
31	000333	美的集团	50,000	2,771,500.00	0.40
32	601607	上海医药	110,000	2,660,900.00	0.39
33	300003	乐普医疗	99,936	2,414,453.76	0.35
34	000651	格力电器	50,000	2,185,000.00	0.32
35	600227	赤天化	295,428	2,094,584.52	0.31
36	600383	金地集团	100,000	1,263,000.00	0.18
37	600872	中炬高新	50,000	1,238,000.00	0.18
38	002169	智光电气	178,668	938,007.00	0.14
39	600025	华能水电	94,713	501,978.90	0.07
40	600318	新力金融	31,800	403,860.00	0.06
41	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.04

42	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.03
43	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
44	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
45	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
46	002917	金奥博	1,090	35,643.00	0.01
47	300730	科创信息	821	34,112.55	-
48	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	-
49	002919	名臣健康	821	28,948.46	-
50	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	-
51	603161	科华控股	1,239	20,753.25	-
52	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	-
53	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	-
54	002923	润都股份	954	16,227.54	-
55	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	-
56	300684	中石科技	827	11,528.38	-
57	603655	朗博科技	881	8,193.30	-
58	002746	仙坛股份	1	23.46	-
59	600200	江苏吴中	1	11.55	-

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	26,744,161.86	2.16
2	601688	华泰证券	22,421,157.46	1.81
3	600436	片仔癀	20,057,866.29	1.62
4	600036	招商银行	19,876,863.64	1.61
5	601288	农业银行	19,095,381.00	1.54
6	300296	利亚德	17,573,633.00	1.42
7	600887	伊利股份	16,283,067.32	1.32
8	002573	清新环境	15,905,371.86	1.29
9	000063	中兴通讯	13,944,251.00	1.13
10	600048	保利地产	13,503,837.00	1.09
11	300285	国瓷材料	10,979,351.00	0.89
12	000933	神火股份	10,078,056.00	0.82
13	002415	海康威视	9,379,126.00	0.76
14	000002	万　科Ａ	8,953,257.00	0.72
15	600584	长电科技	8,603,362.49	0.70
16	601100	恒立液压	7,879,712.00	0.64
17	002217	合力泰	7,205,393.81	0.58
18	000661	长春高新	6,888,287.00	0.56

19	600872	中炬高新	6,527,902.00	0.53
20	600276	恒瑞医药	5,670,424.72	0.46

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000807	云铝股份	28,758,956.50	2.33
2	002503	搜于特	23,968,058.78	1.94
3	601318	中国平安	13,886,301.51	1.12
4	000933	神火股份	9,465,421.00	0.77
5	600887	伊利股份	8,973,827.00	0.73
6	600036	招商银行	8,661,151.08	0.70
7	600531	豫光金铅	8,185,047.21	0.66
8	603806	福斯特	7,944,782.99	0.64
9	300003	乐普医疗	7,311,529.96	0.59
10	601607	上海医药	7,300,789.20	0.59
11	600872	中炬高新	5,973,203.00	0.48
12	002341	新纶科技	5,388,171.57	0.44
13	002677	浙江美大	5,117,366.94	0.41
14	603799	华友钴业	4,685,002.20	0.38
15	600075	新疆天业	3,999,067.94	0.32
16	000063	中兴通讯	3,689,396.00	0.30
17	000546	金圆股份	3,604,644.73	0.29
18	002466	天齐锂业	3,592,184.00	0.29
19	601137	博威合金	3,577,532.00	0.29
20	000568	泸州老窖	3,143,613.00	0.25

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	298,995,388.93
卖出股票收入（成交）总额	185,346,780.46

注:买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	-	-
	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

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	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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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。

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出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	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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

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

原信诚鼎利定增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	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	其他各项资产	149,883,393.68	12.09
8	合计	1,240,133,259.24	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期内未进行港股通投资。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	300285	国瓷材料	464,000	10,685,920.00	0.86
12	601607	上海医药	410,000	10,237,700.00	0.83
13	300003	乐普医疗	399,936	8,842,584.96	0.72
14	603986	兆易创新	50,000	8,156,000.00	0.66
15	002470	金正大	811,493	7,425,160.95	0.60
16	002573	清新环境	330,000	6,893,700.00	0.56
17	300259	新天科技	705,522	6,081,599.64	0.49
18	603799	华友钴业	59,958	5,201,356.50	0.42
19	002677	浙江美大	300,000	4,809,000.00	0.39
20	002466	天齐锂业	59,000	3,954,180.00	0.32
21	600075	新疆天业	503,782	3,682,646.42	0.30
22	600227	赤天化	295,428	1,973,459.04	0.16
23	002169	智光电气	294,872	1,618,847.28	0.13
24	002226	江南化工	200,000	1,124,000.00	0.09
25	600318	新力金融	31,800	353,934.00	0.03
26	300296	利亚德	3,703	75,430.11	0.01
27	300723	一品红	1,561	67,919.11	0.01
28	002911	佛燃股份	2,195	53,316.55	-
29	603083	剑桥科技	877	49,278.63	-
30	002913	奥士康	1,442	43,807.96	-
31	600903	贵州燃气	3,928	43,168.72	-

32	601939	建设银行	5,800	42,340.00	-
33	600309	万华化学	1,000	37,680.00	-
34	300726	宏达电子	1,548	33,127.20	-
35	603809	豪能股份	900	20,151.00	-
36	002864	盘龙药业	781	19,977.98	-
37	603685	晨丰科技	932	19,609.28	-
38	603711	香飘飘	1,318	18,689.24	-
39	300729	乐歌股份	941	15,112.46	-
40	603917	合力科技	1,022	14,532.84	-
41	603848	好太太	1,377	10,864.53	-
42	300727	润禾材料	870	7,255.80	-
43	002746	仙坛股份	1	20.60	-
44	600200	江苏吴中	1	11.09	-

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	60,565,907.00	4.93
2	601939	建设银行	55,664,604.53	4.53
3	600036	招商银行	52,243,933.79	4.25
4	600887	伊利股份	45,504,715.74	3.70
5	600872	中炬高新	36,185,643.57	2.94
6	002217	合力泰	31,539,652.24	2.57
7	601336	新华保险	30,635,306.72	2.49
8	600584	长电科技	30,135,620.07	2.45
9	002202	金风科技	25,284,956.21	2.06
10	000426	兴业矿业	24,816,781.63	2.02
11	000066	中国长城	24,432,297.63	1.99
12	601318	中国平安	23,437,737.00	1.91
13	000568	泸州老窖	23,063,157.70	1.88
14	000423	东阿阿胶	22,675,067.00	1.85
15	002099	海翔药业	20,967,136.90	1.71
16	300316	晶盛机电	20,464,090.00	1.67
17	002573	清新环境	20,410,259.44	1.66
18	601607	上海医药	19,852,081.00	1.62
19	601233	桐昆股份	19,525,165.21	1.59
20	600667	太极实业	18,288,458.50	1.49

注:买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	60,989,111.00	4.96
2	300296	利亚德	58,926,744.36	4.79
3	601939	建设银行	56,250,536.02	4.58
4	600075	新疆天业	50,975,739.97	4.15
5	002099	海翔药业	49,533,651.78	4.03
6	601137	博威合金	47,385,086.48	3.86
7	600036	招商银行	45,385,597.45	3.69
8	002484	江海股份	42,922,917.67	3.49
9	600227	赤天化	38,962,488.00	3.17
10	600872	中炬高新	37,840,596.85	3.08
11	300316	晶盛机电	33,765,072.92	2.75
12	002217	合力泰	32,800,461.29	2.67
13	601336	新华保险	31,659,838.89	2.58
14	000807	云铝股份	30,476,766.00	2.48
15	600887	伊利股份	26,821,955.59	2.18
16	002202	金风科技	25,597,722.69	2.08
17	600584	长电科技	25,470,435.02	2.07
18	000568	泸州老窖	24,119,655.00	1.96
19	000426	兴业矿业	24,056,649.46	1.96
20	000423	东阿阿胶	22,915,258.41	1.86

注:卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	949,437,929.71
卖出股票收入（成交）总额	1,732,510,297.72

注:买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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。

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

注：本基金本报告期内未进行债券投资。

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

8.8 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。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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。

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2

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	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	-
	其他	-
	合计	149,883,393.68

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

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

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位： 份

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
8,386	80,684.68	177,448,281.95	26.23%	499,173,475.84	73.77%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广东粤财信托有限公司粤银 1 号	100,017,000.00	14.78%
2	新华人寿保险股份有限公司分红产品	20,003,500.00	2.96%
3	通用技术集团投资管理有限公司	15,000,000.00	2.22%
4	申能集团财务有限公司	10,000,800.00	1.48%
5	陈志英	9,910,404.00	1.46%

6	梁小鹏	6,000,174.00	0.89%
7	国信证券股份有限公司	5,076,496.00	0.75%
8	中国通用技术（集团）控股有限责任公司	5,000,000.00	0.74%
9	上海申能物业管理有限公司	4,999,900.00	0.74%
10	李江	4,999,900.00	0.74%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,650,923.17	0.39%

9.4 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的情况

项目	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	〉100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§9 基金份额持有人信息

原信诚鼎利定增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

持有人户	户均持有的	持有人结构

数(户)	基金份额	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
12,243	99,379.46	291,369,714.81	23.95%	925,333,033.38	76.05%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广东粤财信托有限公司粤银 1 号	100,017,000.00	8.22%
2	信诚人寿保险有限公司	20,005,300.00	1.64%
3	新华人寿保险股份有限公司分红产品	20,003,500.00	1.64%
4	上海铂绅投资中心（有限合伙）－铂绅二号证券投资基金（私募）	15,101,059.00	1.24%
5	蔡云崽	15,006,750.45	1.23%
6	通用技术集团投资管理有限公司	15,000,000.00	1.23%
7	瑞泰人寿保险有限公司(万能险)	10,000,800.00	0.82%
8	申能集团财务有限公司	10,000,800.00	0.82%
9	中国通用技术（集团）控股有限责任公司	10,000,000.00	0.82%
10	陈志英	9,910,404.00	0.81%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,937,988.19	0.24%

9.4 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的情况

项目	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	〉100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§10 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

基金合同生效日(2016 年 5 月 24 日)基金份额总额	1,216,702,748.19
本报告期基金总申购份额	109,761.08
减：本报告期基金总赎回份额	540,190,751.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	676,621,757.79

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,转处和份额强减。

§10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

基金合同生效日(基金合同生效日)基金份额总额	1,216,702,748.19
本报告期期初基金份额总额	1,216,702,748.19
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,216,702,748.19

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,转处和份额强减。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、报告期内基金管理人的重大人事变动:

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

根据本基金基金合同约定,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)。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,投资策略相应调整为:

1、资产配置策略

本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

2、股票投资策略

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,严选安全边际较高的个股。

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。

3、固定收益投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。

4、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

5、权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。

6、资产支持证券投资策略

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,采用数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。

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的报酬为人民币 100,000 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

报告期内管理人、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。

信诚鼎利(LOF)

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

		股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元数量	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	备注
中信证券	2	272,514,909.59	56.34%	250,899.48	61.95%	-
中信建投	2	211,164,171.54	43.66%	154,129.18	38.05%	本期新增
太平洋证券	1	-	-	-	-	本期新增

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	
	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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	60,000,000.00	100.00%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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。

原信诚鼎利定增

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

		股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元数量	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	备注
中信证券	2	2,678,351,549.52	100.00%	2,473,315.46	100.00%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	本期新增

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	
	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
中信证券	-	-	3,940,400,000.00	100.00%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2017-01-03
2	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	同上	2017-01-07
3	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要	同上	2017-01-07
4	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第四季度报告	同上	2017-01-20
5	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	同上	2017-03-31
6	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	同上	2017-03-31
7	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-01
8	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-07
9	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告	同上	2017-04-21
10	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2017 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	同上	2017-07-01
11	信诚基金管理有限公司关于调整旗下基金风险等级划分和投资者类型匹配的提示性公告 20170703	同上	2017-07-03
12	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2017-07-06
13	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券	同上	2017-07-07

	投资基金招募说明书（2017 年第 2 次更新）		
14	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要（2017 年第 2 次更新）	同上	2017-07-07
15	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第二季度报告	同上	2017-07-21
16	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	同上	2017-08-29
17	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	同上	2017-08-29
18	信诚基金管理有限公司关于调整旗下深圳证券交易所上市开放式基金场内份额持有期规则的公告	同上	2017-09-30
19	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第三季度报告	同上	2017-10-26
20	信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2017-11-02
21	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）的提示公告	同上	2017-11-04
22	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）的提示公告	同上	2017-11-11
23	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）的提示公告	同上	2017-11-18
24	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	同上	2017-11-22
25	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	同上	2017-11-24
26	中信保诚基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告	同上	2017-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.7 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
-

12.8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》。

§13 备查文件目录

13.7 备查文件名称

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
2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、(原)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)基金合同
5、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

13.8 备查文件存放地点

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

13.9 备查文件查阅方式

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
2018 年 3 月 30 日