

信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 2020 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	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	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	12
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	15
§ 7	投资组合报告	30
7.1	期末基金资产组合情况	30
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3	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	31
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6	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	34
7.7	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	35
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	35
7.9	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	35
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	35
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.12	投资组合报告附注	35

§ 8	基金份额持有人信息	36
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	36
8.2	期末上市基金前十名持有人	36
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36
8.4	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情况	36
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	37
§ 9	开放式基金份额变动	37
§ 10	重大事件揭示	37
10.1	基金份额持有人大会决议	37
10.2	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	37
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4	基金投资策略的改变	37
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	37
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	37
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8	其他重大事件	38
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	40
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	40
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	40
§ 12	备查文件目录	40
12.1	备查文件目录	40
12.2	存放地点	40
12.3	查阅方式	40

§ 2 基金简介

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05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	115,775,836.81份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016年08月31日

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	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的成长前景、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。</p> <p>本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据对行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个</p>

	<p>方面对上市公司进行分析。2) 定量分析: 主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标, 选取具备选成长性好, 估值合理的股票, 主要采用的指标包括但不限于: 公司收入、未来公司利润增长率等; ROE、ROIC、毛利率、净利率等; PE、PEG、PB、PS 等。</p> <p>3、固定收益投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境, 运用基于债券研究的各种投资分析技术, 进行个券精选。</p> <p>4、股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货, 以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货的投资, 以管理投资组合的系统性风险, 改善组合的风险收益特性。此外, 本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>5、权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易, 控制基金组合风险, 获取超额收益。本基金进行权证投资时, 将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上, 结合股价波动率等参数, 运用数量化定价模型, 确定其合理内在价值, 构建交易组合。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 对于资产支持证券, 本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素, 研究资产支持证券的收益和风险匹配情况, 采用量化的定价模型跟踪债券的价格走势, 在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金, 低于股票型基金, 属于较高风险、较高预期收益的品种。

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	陈四清

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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	4,363,926.14
本期利润	16,506,904.10
加权平均基金份额本期利润	0.1106
本期加权平均净值利润率	11.49%
本期基金份额净值增长率	12.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	-8,432,758.79
期末可供分配基金份额利润	-0.0728
期末基金资产净值	123,630,806.33
期末基金份额净值	1.068
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	6.80%

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
过去一个月	10.90%	0.78%	3.41%	0.44%	7.49%	0.34%
过去三个月	17.23%	0.88%	6.21%	0.45%	11.02%	0.43%
过去六个月	12.78%	1.06%	2.35%	0.74%	10.43%	0.32%
过去一年	24.19%	0.84%	7.42%	0.60%	16.77%	0.24%
过去三年	8.98%	0.97%	16.49%	0.62%	-7.51%	0.35%
自基金合同生效起至今	6.80%	0.86%	28.02%	0.56%	-21.22%	0.30%

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



§ 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2020年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为71只,分别为:信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、

信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚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、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷孝东	本基金的基金经理，兼任投行部董事总经理。	2016 年 12 月 16 日	2020 年 05 月 06 日	17	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，兼任基金经

					理。
郑伟	本基金的基金经理，兼任信诚中小盘混合型证券投资基金的基金经理。	2020 年 03 月 30 日	-	14	经济学硕士。曾任职于华泰资产管理有限公司，担任研究员。2009 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理。现任信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

2020 年上半年市场在不同阶段呈现不同的特点，一季度市场大幅波动，尤其是 3 月份海外疫情爆发之后，市场大幅回调。二季度市场出现持续上涨，其中上证指数上涨 8.5%，创业板上涨 30%。

今年春节之后国内疫情迅速控制，海外疫情在 3 月份之后不断蔓延。全球经济面临非常大的不确定性风险，全球央行为金融市场注入巨量的流动性。国内政策也趋于宽松，货币和信贷政策有利支撑了复工复产。以创业板为代表的成长性资产表现较好，尤其是医药和消费类板块表现优异，同时科技、新能源及新能源汽车板块也表现比较好。

上半年我们通过加强行业研究，积极优化调整投资组合，重点配置了医药、大消费、科技等板块，取得了一定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 12.78%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年来看，全球范围内的疫情发展仍有可能反复，预计全球央行仍保持较为宽松的货币政策，欧美主要国家也将继续推出财政救援措施。国内来看，疫情总体受到严格的控制，复工复产的环境较为有利，预计经济恢复的情况总体有望超出预期。同时有利于实体经济的金融政策和金融环境有望在较长时间内持续发挥作用。我们对市场保持谨慎乐观的态度。

同时，国内产业结构调整优化升级的趋势在强化，资本市场改革的政策取向也有助于营造新经济发展的支撑环境。展望下半年到明年，随着国内经济的恢复，内需将成为经济增长中重要的亮点。其中大消费、传媒娱乐、新能源及新能源汽车等需求有望持续好转。此外，从 5G 周期看，明年消费电子换机和智能终端的应用将逐步加快，云计算、工业互联网等新兴的商业模式和创新将不断出现。

我们看好大消费及医疗健康、TMT、高端制造、新能源及新能源汽车等板块的投资机会。我们将从估值和业绩角度优选投资标的，力争为持有人创造收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导（委员会主席）、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管（委员会秘书）。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

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

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

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

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗，所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

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

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离，基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注，在认为基金估值所采用的估值价格不够公允时，可申请召开估值决策委员会临时会议，通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元（基金份额持有人数量不满二百人）的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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)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合规守信、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)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。

本基金于本报告期内未进行过利润分配。

5.3 托管人对中期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)2020 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,068,165.70	2,782,682.54
结算备付金	-	228,384.66	20,661,124.21
存出保证金	-	73,107.12	71,503.26
交易性金融资产	6.4.7.2	114,146,478.59	148,858,755.17
其中：股票投资	-	102,461,761.79	92,985,755.17
债券投资	-	11,684,716.80	55,873,000.00
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款	-	1,333,136.26	3,287,072.11
应收利息	6.4.7.5	366,523.09	980,629.66
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	6,190.71	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	128,221,986.13	176,641,766.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	1,468,681.18	2,793,512.88
应付赎回款	-	2,618,663.99	127,957.55
应付管理人报酬	-	159,410.23	223,751.81
应付托管费	-	26,568.36	37,291.97
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	157,474.91	189,836.55
应交税费	-	0.37	0.78
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	160,380.76	289,000.35
负债合计	-	4,591,179.80	3,661,351.89
所有者权益：	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	115,775,836.81	182,706,666.38
未分配利润	6.4.7.10	7,854,969.52	-9,726,251.32
所有者权益合计	-	123,630,806.33	172,980,415.06
负债和所有者权益总计	-	128,221,986.13	176,641,766.95

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.068 元，基金份额总额 115,775,836.81 份。

6.2 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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
一、收入	-	18,571,755.40	22,098,774.27
1. 利息收入	-	499,252.35	584,803.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	137,801.87	259,255.38
债券利息收入	-	361,450.48	288,614.94
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	36,933.34
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	5,890,668.73	20,421,116.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,268,128.86	20,146,600.25
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	175,122.66	-20,612.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	447,417.21	295,128.12

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	12,142,977.96	1,075,728.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	38,856.36	17,125.91
减：二、费用	-	2,064,851.30	2,637,013.35
1. 管理人报酬	-	1,079,564.07	1,536,704.56
2. 托管费	-	179,927.36	256,117.43
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	667,023.96	691,754.11
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 税金及附加	-	0.05	-
7. 其他费用	6.4.7.19	138,335.86	152,437.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	16,506,904.10	19,461,760.92
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	16,506,904.10	19,461,760.92

6.3 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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	182,706,666.38	-9,726,251.32	172,980,415.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,506,904.10	16,506,904.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-66,930,829.57	1,074,316.74	-65,856,512.83
其中：1. 基金申购款	2,222,913.00	-87,624.53	2,135,288.47
2. 基金赎回款	-69,153,742.57	1,161,941.27	-67,991,801.30
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）	115,775,836.81	7,854,969.52	123,630,806.33
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	274,457,433.92	-57,550,885.91	216,906,548.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,461,760.92	19,461,760.92
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）	-53,036,637.95	7,153,270.71	-45,883,367.24
其中：1. 基金申购款	395,165.04	-62,866.91	332,298.13

2. 基金赎回款	-53,431,802.99	7,216,137.62	-46,215,665.37
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)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	221,420,795.97	-30,935,854.28	190,484,941.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

唐世春

陈逸辛

刘卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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(基金合同生效日)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 27 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)。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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期

间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	12,068,165.70

定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	12,068,165.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	85,599,858.61	102,461,761.79	16,861,903.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,743,404.90	11,684,716.80
	银行间市场	-	-
	合计	11,743,404.90	11,684,716.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	97,343,263.51	114,146,478.59	16,803,215.08

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	1,047.07
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	81.18
应收债券利息	365,365.23
应收资产支持证券利息	-
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	29.61
合计	366,523.09

注：其他包括应收结算保证金利息、应收中金所清算备付金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	157,474.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	157,474.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,037.90
应付审计费	59,835.26
应付信息披露费	59,672.34
应付账户维护费	9,000.00
应付基金上市费	29,835.26
合计	160,380.76

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	182,706,666.38	182,706,666.38
本期申购	2,222,913.00	2,222,913.00
本期赎回（以“-”号填列）	-69,153,742.57	-69,153,742.57
本期末	115,775,836.81	115,775,836.81

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

2、本基金本报告期末场内外基金份额如下：

		本报告期末	
基金代码	场内简称	场内	场外
165528	信诚鼎利	27,547,558.00	88,228,278.81

6.4.7.10 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	-17,880,671.27	8,154,419.95	-9,726,251.32
本期利润	4,363,926.14	12,142,977.96	16,506,904.10
本期基金份额交易产生的变动数	5,083,986.34	-4,009,669.60	1,074,316.74
其中：基金申购款	-164,474.00	76,849.47	-87,624.53
基金赎回款	5,248,460.34	-4,086,519.07	1,161,941.27

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,432,758.79	16,287,728.31	7,854,969.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
活期存款利息收入		73,469.55
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		2,749.75
其他		61,582.57
合计		137,801.87

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入、中金所清算备付金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
卖出股票成交总额		239,911,303.87
减：卖出股票成本总额		234,643,175.01
买卖股票差价收入		5,268,128.86

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30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		175,122.66
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		175,122.66

6.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		45,306,701.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		44,162,478.57
减：应收利息总额		969,100.23
买卖债券差价收入		175,122.66

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益—其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	447,417.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	447,417.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	12,142,977.96
--股票投资	12,293,382.59
--债券投资	-150,404.63
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	12,142,977.96

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	38,856.36
合计	38,856.36

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

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	667,023.96
银行间市场交易费用	-

合计	667,023.96
----	------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
银行费用	393.00
账户维护费	18,000.00
基金上市费	29,835.26
其他	600.00
合计	138,335.86

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,079,564.07	1,536,704.56
其中：支付销售机构的客户维护费	546,062.34	749,996.66

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	179,927.36	256,117.43

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30 日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	12,068,165.70	73,469.55	53,971,069.99	249,184.90

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

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 2020 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年06月30日	2020年07月08日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年06月23日	2020年07月02日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年06月24日	2020年07月03日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年06月22日	2020年07月01日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
601816	京沪高铁	2020年01月08日	2020年07月16日	锁定期股票	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688027	国盾量子	2020年06月30日	2020年07月09日	新发未上市	36.18	36.18	1,651	59,733.18	59,733.18	-
688277	天智航	2020年06月24日	2020年07月07日	新发未上市	12.04	12.04	6,715	80,848.60	80,848.60	-
688377	迪威尔	2020年06月29日	2020年07月08日	新发未上市	16.42	16.42	3,849	63,200.58	63,200.58	-
688528	秦川物联	2020年06月19日	2020年07月01日	新发未上市	11.33	11.33	5,992	67,889.36	67,889.36	-
688600	皖仪科技	2020年06月23日	2020年07月	新发未上市	15.50	15.50	3,828	59,334.00	59,334.00	-

		日	月 03							
			日							

6.4.12.1.2 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
113588	润达转债	2020年06月17日	2020年07月13日	新发未上市	100.00	100.00	440	44,000.00	44,000.00	-
128112	歌尔转2	2020年06月12日	2020年07月13日	新发未上市	100.00	100.00	806	80,600.00	80,600.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限（若有）内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	124,600.00	45,000.00
未评级	11,560,116.80	55,828,000.00
合计	11,684,716.80	55,873,000.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂

时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年06月 30日	1个月内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,068,165.70	-	-	-	-	-	12,068,165.70
结算备付金	228,384.66	-	-	-	-	-	228,384.66
存出保证金	73,107.12	-	-	-	-	-	73,107.12
交易性金融资产	-	10,016,000.00	-	1,544,116.80	124,600.00	102,461,761.79	114,146,478.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,333,136.26	1,333,136.26
应收利息	-	-	-	-	-	366,523.09	366,523.09
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	6,190.71	6,190.71

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,369,657.48	10,016,000.00	-	1,544,116.80	124,600.00	104,167,611.85	128,221,986.13
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,468,681.18	1,468,681.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,618,663.99	2,618,663.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	159,410.23	159,410.23
应付托管费	-	-	-	-	-	26,568.36	26,568.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	157,474.91	157,474.91
应交税费	-	-	-	-	-	0.37	0.37
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,380.76	160,380.76
负债总计	-	-	-	-	-	4,591,179.80	4,591,179.80
利率敏感度缺口	12,369,657.48	10,016,000.00	-	1,544,116.80	124,600.00	99,576,432.05	123,630,806.33
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,782,682.54	-	-	-	-	-	2,782,682.54
结算备付金	20,661,124.21	-	-	-	-	-	20,661,124.21
存出保证金	71,503.26	-	-	-	-	-	71,503.26
交易性金融资产	-	-	20,160,000.00	35,668,000.00	45,000.00	92,985,755.17	148,858,755.17

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	3,287,072.11	3,287,072.11	
应收利息	-	-	-	-	980,629.66	980,629.66	
应收股利	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	-	-	
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	
其他资产	-	-	-	-	-	-	
资产总计	23,515,310.01	20,160,000.00	35,668,000.00	45,000.00	97,253,456.94	176,641,766.95	
负债	-	-	-	-	-	-	
短期借款	-	-	-	-	-	-	
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	
应付证券清算款	-	-	-	-	2,793,512.88	2,793,512.88	
应付赎回款	-	-	-	-	127,957.55	127,957.55	
应付管理人报酬	-	-	-	-	223,751.81	223,751.81	
应付托管费	-	-	-	-	37,291.97	37,291.97	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	
应付交易费用	-	-	-	-	189,836.55	189,836.55	
应交税费	-	-	-	-	0.78	0.78	
应付利息	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	289,000.35	289,000.35	
负债总计	-	-	-	-	3,661,351.89	3,661,351.89	
利率敏感度缺口	23,515,310.01	20,160,000.00	35,668,000.00	45,000.00	93,592,105.05	172,980,415.06	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	-	190,741.72
市场利率上升 25 个基点	-	-189,504.91	

注：于本报告期末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金持有有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	102,461,761.79	82.88	92,985,755.17	53.76
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	102,461,761.79	82.88	92,985,755.17	53.76

6.4.13.4.3.2 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（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	3,816,552.35	3,952,952.92

业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-3, 816, 552. 35	-3, 952, 952. 92
-------------------	------------------	------------------

6.4.14 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。

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 96,510,774.97 元，属于第二层次的余额为 17,635,703.62 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 86,392,824.48 元，第二层次 62,465,930.69 元，无第三层次）

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	102,461,761.79	79.91
	其中：股票	102,461,761.79	79.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,684,716.80	9.11
	其中：债券	11,684,716.80	9.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,296,550.36	9.59
8	其他各项资产	1,778,957.18	1.39
9	合计	128,221,986.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,429,521.26	56.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,946,031.20	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,327.12	4.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,029,524.89	11.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,213,041.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	7,694,940.00	6.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,542,610.00	1.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	102,461,761.79	82.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	4.52
2	688111	金山办公	14,659	5,007,221.22	4.05
3	603259	药明康德	43,700	4,221,420.00	3.41
4	600276	恒瑞医药	42,400	3,913,520.00	3.17
5	600745	闻泰科技	30,500	3,841,475.00	3.11
6	600690	海尔智家	209,200	3,702,840.00	3.00
7	600519	贵州茅台	2,400	3,510,912.00	2.84

8	300759	康龙化成	35,300	3,473,520.00	2.81
9	300832	新产业	19,300	3,323,267.00	2.69
10	002242	九阳股份	87,300	3,253,671.00	2.63
11	300316	晶盛机电	126,700	3,134,558.00	2.54
12	300395	菲利华	95,050	3,124,293.50	2.53
13	002709	天赐材料	82,320	2,781,592.80	2.25
14	300142	沃森生物	50,200	2,628,472.00	2.13
15	300760	迈瑞医疗	8,400	2,567,880.00	2.08
16	600584	长电科技	80,000	2,501,600.00	2.02
17	600309	万华化学	50,000	2,499,500.00	2.02
18	600372	中航电子	184,400	2,456,208.00	1.99
19	600588	用友网络	54,470	2,402,127.00	1.94
20	600872	中炬高新	40,000	2,341,200.00	1.89
21	603986	兆易创新	9,800	2,311,918.00	1.87
22	601012	隆基股份	52,000	2,117,960.00	1.71
23	688066	航天宏图	41,154	2,105,027.10	1.70
24	002624	完美世界	35,800	2,063,512.00	1.67
25	600887	伊利股份	64,500	2,007,885.00	1.62
26	603233	大参林	23,960	1,946,031.20	1.57
27	300118	东方日升	129,500	1,942,500.00	1.57
28	002241	歌尔股份	63,900	1,876,104.00	1.52
29	300244	迪安诊断	43,700	1,542,610.00	1.25
30	600760	中航沈飞	46,900	1,539,258.00	1.25
31	601877	正泰电器	55,600	1,465,060.00	1.19
32	600570	恒生电子	13,600	1,464,720.00	1.18
33	002605	姚记科技	36,700	1,394,600.00	1.13
34	688006	杭可科技	30,444	1,368,153.36	1.11
35	603906	龙蟠科技	86,900	1,355,640.00	1.10
36	002475	立讯精密	25,999	1,335,048.65	1.08
37	600038	中直股份	32,000	1,314,240.00	1.06
38	600893	航发动力	52,600	1,235,048.00	1.00
39	002127	南极电商	57,300	1,213,041.00	0.98
40	600845	宝信软件	16,500	974,820.00	0.79
41	300750	宁德时代	5,000	871,800.00	0.71
42	300655	晶瑞股份	20,400	839,460.00	0.68
43	600161	天坛生物	18,100	820,473.00	0.66
44	688399	硕世生物	2,290	636,620.00	0.51
45	688277	天智航	6,715	80,848.60	0.07
46	688528	秦川物联	5,992	67,889.36	0.05
47	688377	迪威尔	3,849	63,200.58	0.05
48	688027	国盾量子	1,651	59,733.18	0.05

49	688600	皖仪科技	3,828	59,334.00	0.05
50	603087	甘李药业	408	40,922.40	0.03
51	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
52	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
53	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
54	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
55	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
56	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
57	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601816	京沪高铁	6,319,848.88	3.65
2	600276	恒瑞医药	5,568,395.70	3.22
3	002230	科大讯飞	5,307,552.00	3.07
4	603259	药明康德	4,817,855.00	2.79
5	002507	涪陵榨菜	4,306,011.00	2.49
6	002396	星网锐捷	4,157,846.00	2.40
7	002174	游族网络	4,089,417.00	2.36
8	300316	晶盛机电	4,078,905.00	2.36
9	600547	山东黄金	4,027,013.35	2.33
10	000651	格力电器	4,026,800.00	2.33
11	000568	泸州老窖	3,822,080.00	2.21
12	603986	兆易创新	3,665,138.50	2.12
13	600690	海尔智家	3,533,196.54	2.04
14	600031	三一重工	3,527,863.00	2.04
15	300760	迈瑞医疗	3,486,378.00	2.02
16	600745	闻泰科技	3,312,302.00	1.91
17	601318	中国平安	3,303,000.00	1.91
18	002242	九阳股份	3,228,741.00	1.87
19	300395	菲利华	3,224,919.00	1.86
20	300759	康龙化成	3,173,423.00	1.83

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。

7.4.2 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	601318	中国平安	7,178,752.00	4.15
2	603939	益丰药房	5,792,743.00	3.35
3	000651	格力电器	5,378,567.00	3.11
4	601939	建设银行	5,359,882.00	3.10

5	601288	农业银行	5,190,346.00	3.00
6	002230	科大讯飞	5,133,498.00	2.97
7	300223	北京君正	4,632,750.00	2.68
8	600031	三一重工	4,268,280.00	2.47
9	002507	涪陵榨菜	4,255,650.92	2.46
10	002396	星网锐捷	4,097,510.36	2.37
11	600036	招商银行	3,994,068.71	2.31
12	600276	恒瑞医药	3,913,151.48	2.26
13	600547	山东黄金	3,869,305.45	2.24
14	600809	山西汾酒	3,679,846.73	2.13
15	601628	中国人寿	3,674,572.00	2.12
16	603043	广州酒家	3,652,939.00	2.11
17	000568	泸州老窖	3,605,249.50	2.08
18	600588	用友网络	3,541,750.43	2.05
19	002174	游族网络	3,521,103.00	2.04
20	002475	立讯精密	3,416,821.00	1.98

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。

7.4.3 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	231,825,799.04
卖出股票收入（成交）总额	239,911,303.87

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。

7.5 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	11,560,116.80	9.35
	其中：政策性金融债	11,560,116.80	9.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	124,600.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,684,716.80	9.45

7.6 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	018007	国开 1801	100,000	10,016,000.00	8.10

2	108604	国开 1805	15,240	1,544,116.80	1.25
3	128112	歌尔转 2	806	80,600.00	0.07
4	113588	润达转债	440	44,000.00	0.04

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金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。

7.12.3 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	73,107.12
2	应收证券清算款	1,333,136.26
3	应收股利	-
4	应收利息	366,523.09
5	应收申购款	6,190.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,778,957.18

7.12.4 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。

7.12.5 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	601816	京沪高铁	5,593,327.12	4.52	锁定期股票

7.12.6 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 基金份额持有人信息

8.1 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
2,659	43,541.12	3,088,905.81	2.67%	112,686,931.00	97.33%

8.2 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	梁小鹏	6,000,174.00	5.18%
2	张明惠	3,977,223.14	3.44%
3	上海康利工贸有限公司	2,982,917.36	2.58%
4	黄学丽	1,485,498.51	1.28%
5	杨文豪	1,001,136.00	0.86%
6	李惠满	1,001,090.80	0.86%
7	刘媛凤	1,000,087.00	0.86%
8	金小庆	1,000,038.00	0.86%
9	彭德英	990,954.01	0.86%
10	金保丽	990,864.01	0.86%

8.3 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	746,183.78	0.64%

8.4 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	50~100
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。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 05 月 24 日）基金份额总额	1, 216, 702, 748. 19
本报告期期初基金份额总额	182, 706, 666. 38
本报告期基金总申购份额	2, 222, 913. 00
减：本报告期基金总赎回份额	69, 153, 742. 57
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	115, 775, 836. 81

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	174, 193, 161. 38	37. 58%	123, 904. 20	32. 54%	-
太平洋证券	2	62, 376, 425. 32	13. 46%	45, 615. 98	11. 98%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

新时代证 券	1	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
中信证券	2	226,901,829.80	48.96%	211,313.14	55.49%

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	10,131,000.00	22.79%	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	8,704,852.00	19.58%	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	25,626,358.30	57.64%	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年01月01日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	同上	2020年01月17日
3	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第四季度报告	同上	2020年01月17日
4	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告	同上	2020年01月30日
5	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书	同上	2020年02月14日
6	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金	同上	2020年02月14日

	(LOF) 更新招募说明书摘要		
7	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2020年02月14日
8	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同修订前后对照表	同上	2020年02月14日
9	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2020年02月14日
10	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	同上	2020年02月14日
11	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加济安财富基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020年03月12日
12	中信保诚基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	同上	2020年03月21日
13	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	同上	2020年03月31日
14	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2020年04月01日
15	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要	同上	2020年04月01日
16	中信保诚基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	同上	2020年04月14日
17	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020年04月21日
18	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	同上	2020年04月22日
19	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2020 年第一季度报告	同上	2020年04月22日
20	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	同上	2020年04月25日
21	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2019 年年度报告	同上	2020年04月25日
22	中信保诚基金管理有限公司基金经理变更公告	同上	2020年05月07日
23	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2020年05月08日
24	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要	同上	2020年05月08日
25	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2020 年 5	同上	2020年05月29日

	月)		
26	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2020 年 5 月）	同上	2020年05月29日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、（原）信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同
- 4、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 08 月 28 日