

信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金转型)2017 年年度报告摘要

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

自 2017 年 11 月 8 日起,本基金的基金名称由“信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金”变更为“信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”,运作方式由原封闭 18 个月后转开放式变更为普通开放式。自 2017 年 11 月 8 日起《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》生效,原《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》将自同一起失效。原信诚多策略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 8 日止,信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)本报告期自 2017 年 11 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

信诚多策略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	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	信诚策略混合(LOF)
场内简称	信诚策略
基金主代码	165531
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 8 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	85,896,449.12 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)	-
上市日期(若有)	-

2.2 基金产品说明

<p>投资目标</p>	<p>本基金将灵活运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。</p>
<p>投资策略</p>	<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>(1)二级市场定增策略</p> <p>本基金将充分关注已完成定增但定增股份未解禁的股票,当其市价低于定增价格时,本基金在择时和优选个股的前提下,在二级市场买入个股;在上市公司定增预案后,可筛选优质定增标的,先在二级市场建仓,充分把握定增预案后上市公司的涨幅。</p> <p>(2)价值策略</p> <p>本基金将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据对行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2)定量分析:主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标,选取具备成长性好,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)成长策略</p> <p>本基金将挖掘内生增长型公司和外延增长型公司。</p> <p>内生增长型公司通常资产盈利能力较强,表现出良好的成长性,具备内生增长特质。本基金将深入研究符合内生增长量化指标评估的上市公司,考察其所处行业的竞争格局、业务模式、盈利能力、持续增长能力、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平,从而做出投资判断和决定。</p> <p>外延增长型公司主要指通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究,综合评估并购重组企业的行业增长前景;以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应,包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等,从而做出投资判断和决定。</p> <p>(4)主题投资策略</p> <p>随着中国经济发展和经济结构的转型,在技术经济效益、人口年龄结构变化以及国家政策导向等因素的影响下,将不断涌现出的有影响力的投资主题。本基金将通过系统、细致、前瞻性的宏观经济和国家政策等因素研究,发掘具备成长性、具</p>

	<p>有投资价值的主题行业。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。</p> <p>9、股票期权投资策略</p> <p>本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择</p>
--	---

	<p>流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>10、融资投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的,本基金将从其最新规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	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%。
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。

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
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	95588
传真	021-50120888	(010) 66105798

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 基金简介

原信诚多策略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	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信诚策略混合
场内简称	信诚策略
基金主代码	165531

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,本基金转换为信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。
基金合同生效日	2017年6月16日
基金管理人	-
基金托管人	-
报告期末基金份额总额	54,419,846.54
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	-
上市日期(若有)	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一)本基金在基金合同生效后 18 个月内,将灵活运用以定向增发股票投资策略为主的多种策略。</p> <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>(1)定向增发投资策略</p> <p>定向增发是指上市公司向特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人等)非公开发行股票的融资方式。本基金将综合研究定增条款和实施定增公司的基本面,构建量化模型,根据模型得到能够在二级市场取得超额收益的股票作为备选池。定增条款主要是从定增类别、定增规模、大股东参与方式及锁定期方面考虑,同时结合公司盈利、资产质量、运营能力等基本面因素,确定初选股票池。兼顾实施定增公司的行业前景及定增项目投向,以及定增上市公司治理情况等,排除可能的潜在风险。结合市场未来走势进行判断,评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平,积极参与风险较低的定向增发项目。同时考虑行业偏离及行业风险,用量化方法进行组合配置,规避非系统风险。在定向增发股票锁定期结束后,本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。</p> <p>(2)价值策略</p> <p>本基金将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:根据对行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济</p>

	<p>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)成长策略</p> <p>本基金将挖掘内生增长型公司和外延增长型公司。</p> <p>内生增长型公司通常资产盈利能力较强,表现出良好的成长性,具备内生增长特质。本基金将深入研究符合内生增长量化指标评估的上市公司,考察其所处行业的竞争格局、业务模式、盈利能力、持续增长能力、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平,从而做出投资判断和决定。</p> <p>外延增长型公司主要指通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究,综合评估并购重组企业的行业增长前景;以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应,包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等,从而做出投资判断和决定。</p> <p>(4)主题投资策略</p> <p>随着中国经济发展和经济结构的转型,在技术经济效益、人口年龄结构变化以及国家政策导向等因素的影响下,将不断涌现出的有影响力的投资主题。本基金将通过系统、细致、前瞻性的宏观经济和国家政策等因素研究,发掘具备成长性、具有投资价值的主题行业。</p> <p>3、固定收益投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>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>5、资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、</p>
--	--

	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。 6、融资投资策略 本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的,本基金将从其最新规定。
业绩比较基准	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%。
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

信诚多策略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9日至2017年12月31日)
本期已实现收益	-75,741.80
本期利润	152,483.15
加权平均基金份额本期利润	0.0099
本期加权平均净值利润率	0.98%
本期基金份额净值增长率	0.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年12月31日)
期末可供分配基金份额利润	0.0083
期末基金资产净值	86,079,339.65
期末基金份额净值	1.0021

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。

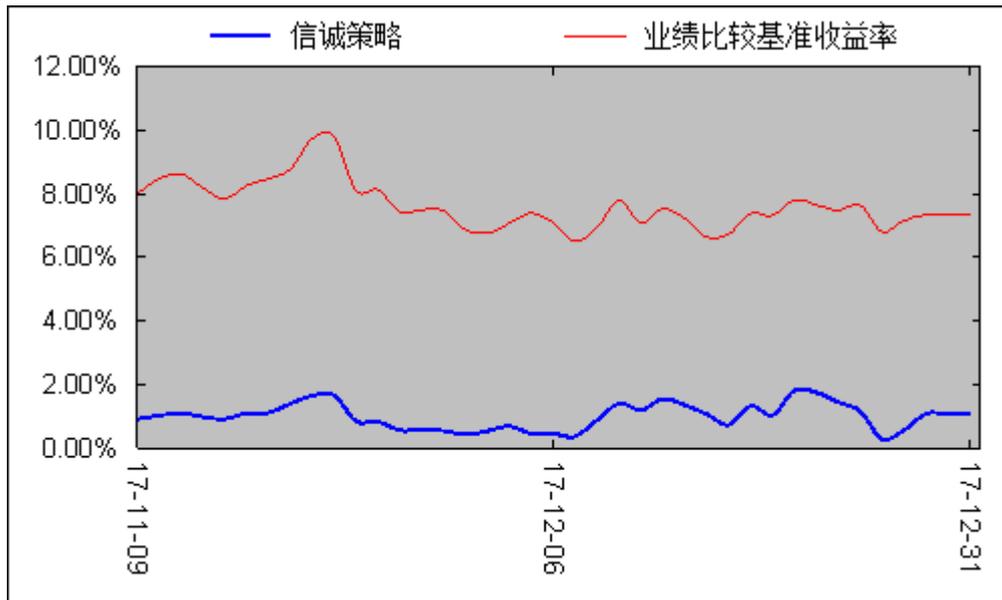
3.2 基金净值表现

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

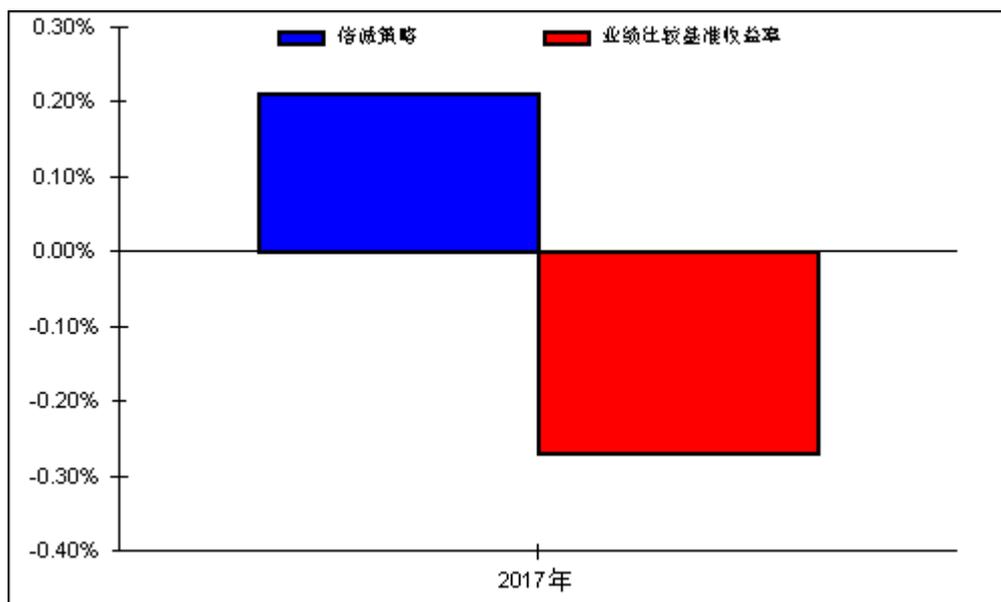
过去三个月	0.21%	0.34%	-0.27%	0.48%	0.48%	-0.14%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.21%	0.34%	-0.27%	0.48%	0.48%	-0.14%

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：本基金建仓期自 2017 年 6 月 16 日至 2017 年 12 月 16 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

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

原信诚多策略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6月16日至2017年11月8日）
本期已实现收益	2,477,793.99
本期利润	2,433,197.99
加权平均基金份额本期利润	0.0099
本期加权平均净值利润率	0.98%
本期基金份额净值增长率	0.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年11月8日）
期末可供分配基金份额利润	0.0085
期末基金资产净值	54,419,846.85
期末基金份额净值	1.0000

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。

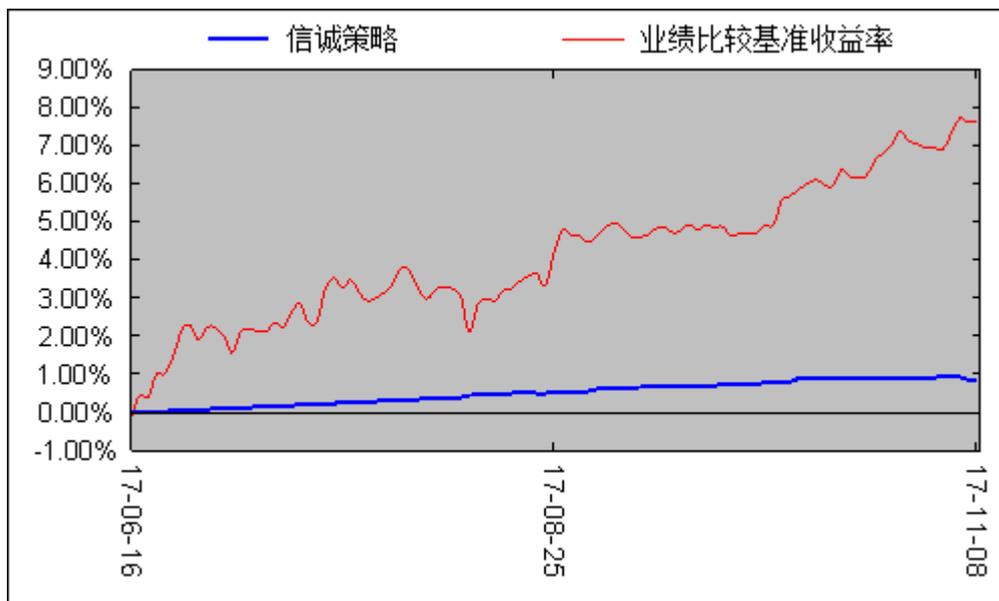
3.2 基金净值表现

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	0.05%	0.03%	2.59%	0.22%	-2.54%	-0.19%
过去六个月	0.73%	0.02%	5.30%	0.28%	-4.57%	-0.26%

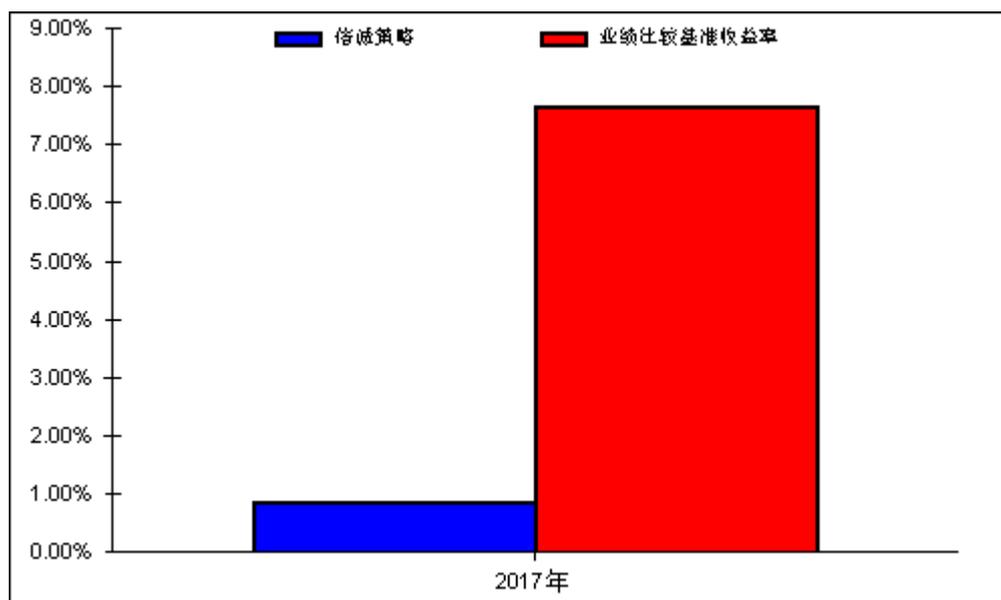
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.85%	0.02%	7.64%	0.29%	-6.79%	-0.27%

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:本基金建仓期自 2017 年 6 月 16 日至 2017 年 12 月 16 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

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
-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 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型证券投资基金、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、信诚中证建筑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)、信诚智惠货币基金市场基金、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、信诚鼎利定增灵活配置混合基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合基金的基金经理	2017年6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、信诚鼎泰多策略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《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚多策略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。

本产品于 2017 年 11 月 6 日从封闭式基金转换为开放式基金,之前主要以固定收益类资产为主,之后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。

本产品配置方向主要集中于消费升级,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,原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(2017/6/16 至 2017/11/8)份额净值增长

率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 7.64%，基金落后业绩比较基准 6.79%。信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（2017/11/9 至 2017/12/31）份额净值增长率为 0.21%，同期业绩比较基准收益率为-0.27%，基金超越业绩比较基准 0.48%。

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

1. 根据基金合同的约定至2017年11月8日,本基金未进行收益分配。

2. 2017年11月8日转型为信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后,本基金的收益分配原则如下:

1、《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。登记在登记结算系统的基金份额,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红;

3、同一类别每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

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多策略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,信诚多策略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多策略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、基金份额申购赎回价格计算、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。本报告期内,信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

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多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)未 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

信诚多策略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 20928 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	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原信诚多策略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	我们审计了信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金)(以下简称“信诚多策略混合基金(LOF)”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 11 月 9 日(转型后首日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国

	<p>证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了信诚多策略混合基金(LOF)2017年12月31日的财务状况以及2017年11月9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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于信诚多策略混合基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>信诚多策略混合基金(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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚多策略混合基金(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多策略混合基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督信诚多策略混合基金(LOF)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保</p>

	<p>证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对信诚多策略混合基金(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多策略混合基金(LOF)不能持续经营。</p>
--	--

	<p>(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。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
--	---

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 27 日

注：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 11 月 9 日(转型后首日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注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

原信诚多策略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 21856 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	信诚多策略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	我们审计了信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信诚多策略混合基金”)的财务报表,包括 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)的资产负债表,2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报

	<p>表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了信诚多策略混合基金 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于信诚多策略混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>信诚多策略混合基金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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚多策略混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算信诚多策略混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	<p>基金管理人治理层负责监督信诚多策略混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对信诚多策略混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我</p>

	<p>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多策略混合基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
--	---

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 27 日

注:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)的资产负债表,2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注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

信诚多策略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:信诚多策略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	32,920,555.18
结算备付金		1,151,555.27
存出保证金		8,687.41
交易性金融资产	7.4.7.2	53,546,519.08
其中:股票投资		53,546,519.08

基金投资		-
债券投资		-
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	25,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	20,522.61
应收股利		-
应收申购款		985.22
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		112,648,824.77
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		26,066,358.30
应付赎回款		9,892.06
应付管理人报酬		112,077.47
应付托管费		18,679.59
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	90,931.34
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	271,546.36
负债合计		26,569,485.12
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	85,167,663.37
未分配利润	7.4.7.10	911,676.28
所有者权益合计		86,079,339.65
负债和所有者权益总计		112,648,824.77

注:1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0021 元,基金份额总额 85,896,449.12 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 11 月 9 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: 信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年11月9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9日至2017年12月31日
一、收入		569,874.20
1. 利息收入		221,332.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	45,590.14
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		175,742.33
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		109,678.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	109,678.38
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“-”号填列）	7.4.7.17	228,224.95
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	10,638.40
减：二、费用		417,391.05
1. 管理人报酬		186,898.30
2. 托管费		31,149.71
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	127,394.38
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	71,948.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		152,483.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		152,483.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年11月9日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017年11月9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）	53,959,118.45	460,728.40	54,419,846.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	152,483.15	152,483.15
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）	31,208,544.92	298,464.73	31,507,009.65
其中：1. 基金申购款	39,613,407.52	404,067.08	40,017,474.60
2. 基金赎回款	-8,404,862.60	-105,602.35	-8,510,464.95
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）	85,167,663.37	911,676.28	86,079,339.65

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

信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为“信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金”，以下简称“本基金”)是根据信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会 2017 年 10 月 9 日决议通过的《关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，并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] 2636 号《关于准予信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金转型而来。原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金为契约型封闭式基金，自 2017 年 11 月 8 日起，原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金更名为信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，原《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《信诚多策略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。原信诚多策略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 54,419,846.85 元，已于本基金的转型后首日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司(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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚多策略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、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期债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、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金所持有的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、国债期货、股票期权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 \times 50%+中证综合债指数收益率 \times 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》、《信诚多策略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 9 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 9 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

7.4.5 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的转让收入免征增值税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票差价收入,股票的股息、红利收入,暂不征收企业所得税。
- (3) 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 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(“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	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
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。

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年11月9日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	186,898.30
其中:支付销售机构的客户维护费	66,018.98

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人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率每日计提,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×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年11月9日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,149.71

注:支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提,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。

7.4.8.2.3 销售服务费

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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9日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	32,920,555.18	39,870.54

注:1.本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管,按银行同业利率计息。

2.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1,151,555.27元。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.9.1.2 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

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 金融工具风险及管理

(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 53,546,519.08 元，无属于第二层次以及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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 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 and 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

原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金

7.1 资产负债表

会计主体：信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 11 月 8 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 11 月 8 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	12,853,059.52
结算备付金		3,000,000.00
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,220,990.00
其中：股票投资		2,220,990.00
基金投资		-
债券投资		-
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		40,003,194.52
应收利息	7.4.7.5	61,285.49

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		58,138,529.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年11月8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		2,265,787.01
应付赎回款		1,198,593.11
应付管理人报酬		45,117.86
应付托管费		7,519.64
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	2,064.64
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	199,600.42
负债合计		3,718,682.68
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	53,959,118.45
未分配利润	7.4.7.10	460,728.40
所有者权益合计		54,419,846.85
负债和所有者权益总计		58,138,529.53

注:1. 截止本报告期末, 基金份额净值 1.0000 元, 基金份额总额 54,419,846.54 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 日(基金转型前一日)止期间。 本基金合同自 2017 年 6 月 16 日起生效, 无上年度可比期间。

7.2 利润表

会计主体: 信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 6 月 16 日至 2017 年 11 月 8 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2017年6月16日至2017年11月8日
一、收入		4,396,682.25
1. 利息收入		4,441,278.25
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	2,978,790.89
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		1,462,487.36
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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“-”号填列）	7.4.7.17	-44,596.00
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		1,963,484.26
1. 管理人报酬		1,479,169.10
2. 托管费		246,528.17
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,265.65
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	235,521.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,433,197.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,433,197.99

注：本基金合同自2017年6月16日起生效，无上年度可比期间。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年6月16日至2017年11月8日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017年6月16日至2017年11月8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）	268,195,345.62	-	268,195,345.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,433,197.99	2,433,197.99
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）	-214,236,227.17	-1,972,469.59	-216,208,696.76
其中：1. 基金申购款	-	-	-

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 \times 50%+中证综合债指数收益率 \times 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》、《信诚多策略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 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 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 8 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2017 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 11 月 8 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

7.4.5 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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票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,包括买卖股票的差价收入,股票的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 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 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(“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	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
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。

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年6月16日至2017年11月8日
当期发生的基金应支付的管理费	1,479,169.10
其中:支付销售机构的客户维护费	352,610.88

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人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率每日计提,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×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年6月16日至2017年11月8日
当期发生的基金应支付的托管费	246,528.17

注:支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提,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

7.4.8.2.3 销售服务费

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.2 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6月16日至2017年11月8日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	12,853,059.52	87,284.23

注:1. 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。

2. 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 3,000,000.00 元。(本基金于 2017 年 6 月 16 日成立,无上年度可比期间。)

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 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。

7.4.9 期末(2017年11月8日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.9.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 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8日(基金转型前一日),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2,220,990.00元,无属于第二层次以及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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2017年11月8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。

(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 11 月 8 日(基金转型前一日)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

信诚多策略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	53,546,519.08	47.53
	其中:股票	53,546,519.08	47.53
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	25,000,000.00	-
	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	34,072,110.45	30.25
7	其他各项资产	30,195.24	0.03
8	合计	112,648,824.77	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	42,077,058.00	48.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	1,877,200.00	2.18
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	4,508,524.00	5.24
K	房地产业	1,955,537.08	2.27
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	454,600.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,673,600.00	3.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,546,519.08	62.21

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	50,100	3,505,998.00	4.07
2	600276	恒瑞医药	46,600	3,214,468.00	3.73
3	000063	中兴通讯	70,000	2,545,200.00	2.96
4	002217	合力泰	230,000	2,300,000.00	2.67
5	000651	格力电器	50,000	2,185,000.00	2.54
6	600703	三安光电	80,000	2,031,200.00	2.36
7	600196	复星医药	45,000	2,002,500.00	2.33
8	000568	泸州老窖	30,000	1,980,000.00	2.30
9	600067	冠城大通	299,929	1,955,537.08	2.27
10	002415	海康威视	50,000	1,950,000.00	2.27
11	002035	华帝股份	60,000	1,808,400.00	2.10
12	002044	美年健康	80,000	1,749,600.00	2.03
13	000725	京东方 A	300,000	1,737,000.00	2.02
14	600498	烽火通信	60,000	1,729,800.00	2.01
15	600809	山西汾酒	30,000	1,709,700.00	1.99
16	300296	利亚德	83,000	1,617,670.00	1.88
17	600887	伊利股份	50,000	1,609,500.00	1.87
18	000546	金圆股份	90,000	1,606,500.00	1.87
19	000895	双汇发展	60,000	1,590,000.00	1.85

20	300009	安科生物	60,000	1,555,800.00	1.81
21	603806	福斯特	38,200	1,302,620.00	1.51
22	002185	华天科技	150,000	1,278,000.00	1.48
23	601233	桐昆股份	50,000	1,124,500.00	1.31
24	600522	中天科技	80,000	1,115,200.00	1.30
25	002583	海能达	60,000	1,110,600.00	1.29
26	300136	信维通信	20,000	1,014,000.00	1.18
27	601229	上海银行	70,700	1,002,526.00	1.16
28	600872	中炬高新	40,000	990,400.00	1.15
29	600884	杉杉股份	50,000	969,000.00	1.13
30	601607	上海医药	40,000	967,600.00	1.12
31	300015	爱尔眼科	30,000	924,000.00	1.07
32	603939	益丰药房	20,000	909,600.00	1.06
33	002573	清新环境	20,000	454,600.00	0.53

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	601318	中国平安	4,467,215.00	5.19
2	000568	泸州老窖	4,234,084.00	4.92
3	600276	恒瑞医药	3,273,741.00	3.80
4	002217	合力泰	2,563,835.00	2.98
5	300296	利亚德	2,443,693.35	2.84
6	000063	中兴通讯	2,409,037.00	2.80
7	002415	海康威视	2,389,351.00	2.78
8	000651	格力电器	2,168,261.00	2.52
9	603806	福斯特	2,144,838.00	2.49
10	600887	伊利股份	2,140,200.00	2.49
11	002142	宁波银行	2,105,702.00	2.45
12	600703	三安光电	2,092,100.00	2.43
13	000546	金圆股份	1,908,690.00	2.22
14	600067	冠城大通	1,901,792.28	2.21
15	600498	烽火通信	1,818,299.00	2.11
16	601688	华泰证券	1,816,479.00	2.11
17	002236	大华股份	1,788,693.15	2.08
18	002035	华帝股份	1,784,691.00	2.07
19	600196	复星医药	1,783,396.00	2.07
20	600809	山西汾酒	1,750,122.00	2.03
21	000725	京东方 A	1,740,000.00	2.02
22	002044	美年健康	1,736,124.00	2.02

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	000568	泸州老窖	2,272,645.00	2.64
2	002142	宁波银行	2,241,212.90	2.60
3	600036	招商银行	1,754,100.00	2.04
4	601688	华泰证券	1,745,899.00	2.03
5	002236	大华股份	1,678,389.60	1.95
6	300003	乐普医疗	1,635,933.33	1.90
7	000933	神火股份	1,505,250.00	1.75
8	601939	建设银行	1,443,150.00	1.68
9	000661	长春高新	1,328,530.00	1.54
10	002074	国轩高科	1,294,516.90	1.50
11	002594	比亚迪	1,237,649.00	1.44
12	601100	恒立液压	945,703.00	1.10
13	601318	中国平安	861,840.00	1.00
14	600183	生益科技	764,900.00	0.89
15	000002	万科A	758,730.00	0.88
16	603806	福斯特	702,238.00	0.82
17	300296	利亚德	686,628.00	0.80
18	600436	片仔癀	634,211.00	0.74
19	600887	伊利股份	601,535.00	0.70
20	600309	万华化学	543,620.00	0.63

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	79,868,487.48
卖出股票收入(成交)总额	28,880,861.73

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金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 中兴通讯股份有限公司(以下简称“中兴通讯”)就美国商务部工业与安全局对该公司实施出口限制措施的决定的相关事项及其进展情况分别于 2016 年 3 月 9 日、2016 年 3 月 23 日、2016 年 3 月 29 日、2016 年 4 月 7 日、2016 年 6 月 28 日、2016 年 8 月 19 日、2016 年 11 月 18 日、2017 年 2 月 14 日、2017 年 2 月 24 日及 2017 年 3 月 8 日进行了公告。鉴于中兴通讯违反了美国出口管制法律,并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规,中兴通讯已同意认罪并支付合计 892,360,064 美元罚款。

8.12.2 对中兴通讯的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,该处罚事项未对中兴通讯的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

8.12.3 除此之外,其余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。

8.12.4 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。

8.12.5 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	8,687.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,522.61
5	应收申购款	985.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,195.24

8.12.6 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

8.12.7 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.8 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

原信诚多策略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	2,220,990.00	3.82
	其中：股票	2,220,990.00	3.82
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	15,853,059.52	27.27
7	其他各项资产	40,064,480.01	68.91
8	合计	58,138,529.53	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,220,990.00	4.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-

0	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	-	-
	合计	2,220,990.00	4.08

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	-	-

本基金本报告期末持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300003	乐普医疗	70,000	1,635,900.00	3.01
2	000568	泸州老窖	9,000	585,090.00	1.08

注：本基金本报告期末仅持有上述股票投资。

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	300003	乐普医疗	1,661,756.00	3.01
2	000568	泸州老窖	603,830.00	1.08

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

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。

本基金本报告期间未进行股票卖出。

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	2,265,586.00
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期间未进行股票卖出。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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)	-

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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	-
2	应收证券清算款	40,003,194.52
3	应收股利	-
4	应收利息	61,285.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
	其他	-

合计	40,064,480.01
----	---------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-

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
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

信诚多策略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
640	134,213.20	39,935,103.83	46.49%	45,961,345.29	53.51%

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	长江财产保险股份有限公司	39,935,103.83	46.49%
2	白雪松	2,911,711.08	3.39%
3	何莎	1,001,139.84	1.17%
4	孙皓	1,001,049.07	1.17%
5	陈黎明	1,000,822.15	1.17%
6	杨云峰	998,812.43	1.16%
7	刘惠平	996,630.00	1.16%
8	魏璇	898,065.24	1.05%
9	夏有德	698,558.73	0.81%
10	赵蕊	554,106.20	0.65%

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	2,091,288.94	2.43%

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	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。

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

原信诚多策略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 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
765	70,534.80	-	-	53,959,118.45	100.00%

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
-	-	-	-

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	3,740,697.85	6.87%

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	50~100
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

信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

单位：份

基金合同生效日(2017年11月8日)基金份额总额	54,419,846.54
本报告期基金总申购份额	39,953,473.45
减：本报告期基金总赎回份额	8,476,870.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	85,896,449.12

注：根据《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金名称变更及实施转型的提示性公告》及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金于2017年11月8日(份额转换基准日)实施转型，2017年11月8日日终，信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金份额将统一结转

为信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金份额,详情见信诚基金官网2017年11月13日发布的《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同生效公告》。

§ 10 开放式基金份额变动

原信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金

单位:份

基金合同生效日(2017年6月16日)基金份额总额	268,195,345.62
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	214,236,227.17
本报告期基金拆分变动份额	460,728.09
本报告期末基金份额总额	54,419,846.54

注:根据《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金名称变更及实施转型的提示性公告》及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金于2017年11月8日(份额转换基准日)实施转型,2017年11月8日日终,信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金份额将统一结转为信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金份额,详情见信诚基金官网2017年11月13日发布的《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同生效公告》。

§ 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. 本报告期内,基金管理人无重大人事变动

2. 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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

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毕马威华振会计师事务所的报酬为人民币60,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

信诚策略混合(LOF)

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

交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
-----	------	-----------	----

券商名称	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	
中信建投	2	59,513,413.01	54.73%	43,475.85	48.92%	-
中信证券	2	49,235,936.20	45.27%	45,390.85	51.08%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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
中信建投	-	-	52,000,000.00	24.19%	-	-
中信证券	-	-	163,000,000.00	75.81%	-	-
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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

原信诚策略混合

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	2,265,586.00	100.00%	2,064.64	100.00%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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	-	-	1,458,300,000.00	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	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn)	2017-06-17
2	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 6 月 16 日净值	同上	2017-06-17
3	关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金增加华泰证券为销售机构的公告	同上	2017-06-23
4	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170623	同上	2017-06-24
5	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170630	同上	2017-07-01
6	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
7	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
8	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 7 月 7 日净值	同上	2017-07-08
9	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 7 月 14 日净值	同上	2017-07-15
10	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170721	同上	2017-07-22
11	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170728	同上	2017-07-29
12	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170804	同上	2017-08-05
13	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170811	同上	2017-08-12
14	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170818	同上	2017-08-19
15	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170825	同上	2017-08-26
16	信诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大	同上	2017-08-30

	会的公告		
17	信诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2017-08-31
18	信诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	同上	2017-09-01
19	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170901	同上	2017-09-02
20	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170908	同上	2017-09-09
21	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170915	同上	2017-09-16
22	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170922	同上	2017-09-23
23	信诚多策略灵活配置混合证券投资基金基金净值 20170929	同上	2017-09-30
24	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
25	信诚基金管理有限公司关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	同上	2017-10-10
26	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金集中赎回选择期及开放赎回业务的公告	同上	2017-10-10
27	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金暂停赎回业务并继续暂停申购业务公告	同上	2017-11-03
28	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金名称变更及实施转型的提示性公告	同上	2017-11-06
29	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	同上	2017-11-08
30	关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)转换基准日场内转换份额补充处理的公告	同上	2017-11-10
31	信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚多	同上	2017-11-13

	策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同生效公告		
32	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-11-20
33	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

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	20171113 至 20171231		39,935,103.83		39,935,103.83	46.49%
机构	2	20170612 至 20171106		90,011,150.00	90,011,150.00		
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2017 年 10 月 10 日发布了《信诚基金管理有限公司关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金集

中赎回选择期及开放赎回业务的公告》。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为自 2017 年 9 月 1 日起,至 2017 年 9 月 29 日 17:00 止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次表决于 2017 年 10 月 9 日表决通过了《关于信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,基金份额持有人大会的决议自该日起生效。基金管理人将于表决通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权,以 2017 年 11 月 8 日为本基金的份额结转基准日,2017 年 11 月 8 日正式实施基金转型。

自 2017 年 11 月 8 日起,本基金的基金名称由“信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金”变更为“信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。自 2017 年 11 月 8 日起《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》生效,原《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》将自同一日起失效。

中信保诚基金管理有限公司
2018 年 3 月 30 日