

中信保诚精萃成长混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚精萃成长混合型证券投资基金
基金简称	中信保诚精萃成长混合
基金主代码	550002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 27 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,896,502,752.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平,挖掘具备长期稳定成长潜力的上市公司,以实现基金资产的长期增值和风险调整后的超额收益。
投资策略	本基金定位为混合型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。在实际投资过程中,本基金将根据满足本基金选股标准的股票的数量、估值水平、股票资产相对于无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产,调整本基金股票的投资比重。
业绩比较基准	中信标普 300 指数收益率*80%+中证国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,本基金的资产配置确立了本基金较高回报、较高风险的产品特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	田青
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张翔燕	田国立

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

§ 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-188,754,995.40	240,432,215.35	-152,983,551.19
本期利润	-773,286,811.85	423,500,980.87	-262,175,640.44
加权平均基金份额本期利润	-0.2117	0.1765	-0.1487
本期加权平均净值利润率	-32.79%	22.65%	-18.56%
本期基金份额净值增长率	-27.34%	23.07%	-18.26%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	55,430,789.25	1,080,989,904.63	558,331,808.82
期末可供分配基金份额利润	0.0142	0.3044	0.3567
期末基金资产净值	1,818,387,591.61	2,687,749,798.07	1,266,517,400.73
期末基金份额净值	0.4667	0.7568	0.8091
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	208.70%	324.84%	245.21%

1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

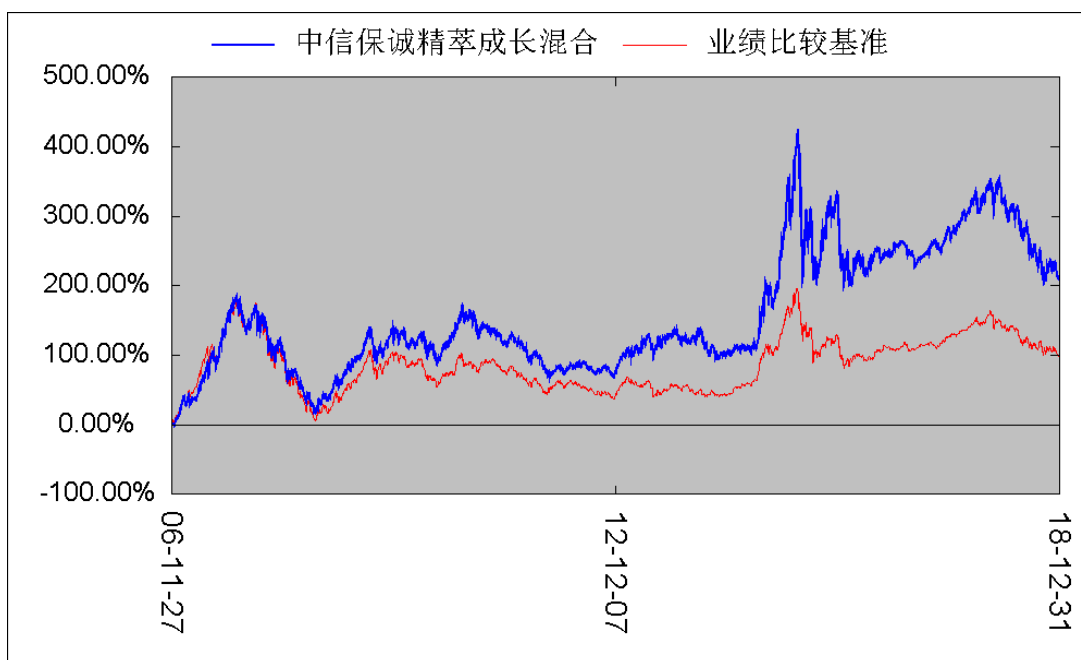
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.32%	1.60%	-9.77%	1.29%	-1.55%	0.31%
过去六个月	-20.41%	1.50%	-10.57%	1.18%	-9.84%	0.32%
过去一年	-27.34%	1.41%	-19.49%	1.06%	-7.85%	0.35%
过去三年	-26.90%	1.36%	-11.09%	0.92%	-15.81%	0.44%
过去五年	37.53%	1.78%	31.91%	1.20%	5.62%	0.58%
自基金合同生效起至今	208.70%	1.69%	98.96%	1.42%	109.74%	0.27%

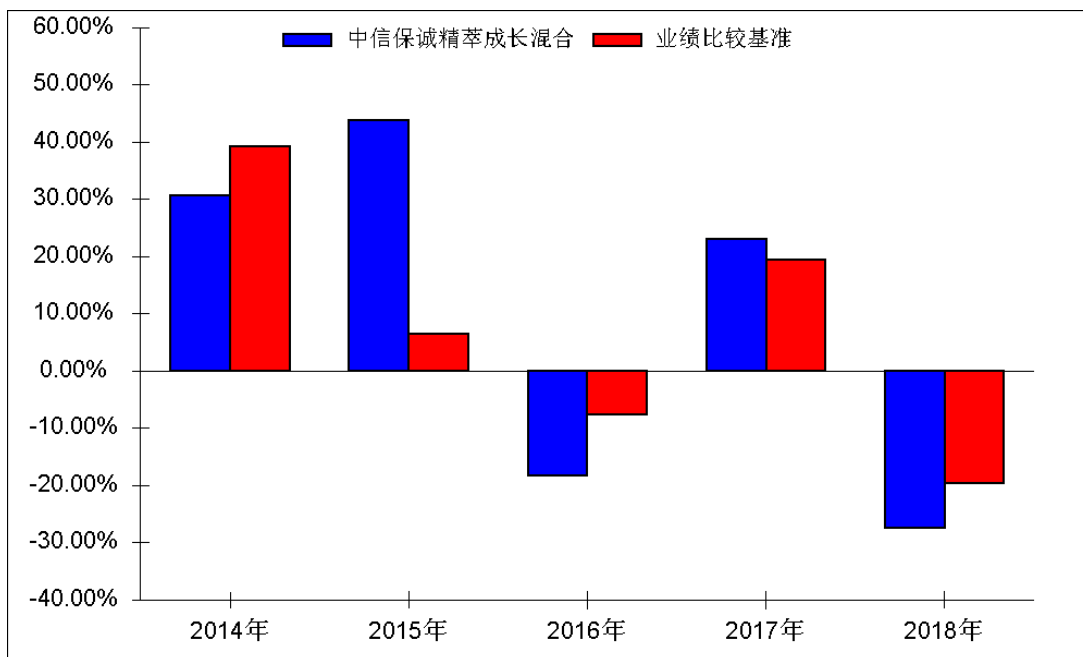
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金建仓期自 2006 年 11 月 27 日至 2007 年 5 月 26 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率*80%+中信国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”变更为“中信标普 300 指数收益率*80%+中证国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”。

3.2.3 过去五年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 过去三年基金的利润分配情况

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
2018 年	0.913	280,873,408.26	92,149,004.85	373,022,413.11	本基金本期分红三次。
2017 年	2.180	1,675,970,051.88	122,735,419.85	1,798,705,471.73	本基金本期分红一次。
2016 年	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	3.093	1,956,843,460.14	214,884,424.70	2,171,727,884.84	本基金最近三年共利润分配四次

§ 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 2018 年 12 月 31 日,本基金管理人管理的运作中基金为 65 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、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、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。

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		
王睿	本基金基金经理，兼任研究副总监职务，信诚优胜精选混合基金基金经理。	2015 年 05 月 29 日	-	9	经济学硕士。曾任职于上海甫瀚咨询管理有限公司，担任咨询师；于美国国际集团 (AIG)，担任投资部研究员。2009 年 10 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。现任研究副总监，信诚优胜精选混合基金、中信保诚精萃成长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《中信保诚精萃成长混合型证券投资基金基金合同》、《中信保诚精萃成长混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责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

2018 年 A 股市场全年各大指数均出现了较大幅度的跌幅,上证指数和沪深 300 指数跌幅都在 25% 附近,创业板指数跌幅接近 30%,深成指和中证 500 跌幅接近 35%。开年市场在金融地产的带领下快速上涨,但此后受到美股下跌的影响市场出现较大跌幅;二季度中美贸易冲突加剧,美政府制裁中兴通讯,国内科技股逻辑受到较大破坏,出现较大幅度杀跌;三季度市场对经济预期变差,消费和家电等出现补跌,尽管季度末市场在政策预期下出现反弹,但是十月份美国副总统的鹰派讲话又将反弹扑灭,加之连续下跌带来的股权质押风险暴露,市场四季度进一步寻底。全年市场仅出现过几次小规模反弹,人气和风险偏好极其低迷。全年来看,大金融板块有较为明显相对收益,其他板块均跌幅较大。本基金年初在 5G 为代表的科技领域布局较重,二季度受到中美贸易冲突影响较大,下跌明显,后虽适当调低了仓位

但仍然不能有效抵御市场系统性风险冲击。我们会进一步总结经验，争取在未来的投资中为持有人创造收益。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为-27.34%，同期业绩比较基准收益率为-19.49%，基金落后业绩比较基准 7.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年经济压力依然较大，棚改货币化和供给侧改革效果边际减弱，进出口受到中美贸易冲击影响亦无亮点，对应 18 年的基数效应，我们判断 A 股上市公司 19 年的业绩增速将是前低后高，上半年压力较大。但是从政策的角度看，货币宽松大势所趋，地产政策也有放松的预期，社会和资本市场的流动性将相对宽裕。监管层面上亦有所放松，对于整个 A 股风险偏好的提升有明显帮助。我们认为业绩的下行压力已经在估值体系里较为充分体现，而估值层面的变化可能推动 19 年的行情好于 18 年；但因为业绩见底仍然需要时间，市场在反弹的过程中或将出现反复。我们 2019 年看好先进制造，5G 应用端，云计算，大消费等领域的长期机会；同时我们持续关注竞争格局较好的周期行业龙头市占率提升的逻辑。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 年公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用，组织业务部门不断补充和完善公司的各项规章制度；开展对公司运作和基金业务的日常监察和内部审计；做好信息披露和对外文稿的合规审查；开展法律咨询和合规培训工作；及时向监管部门报送各项数据和材料。现将公司 2018 年度的监察稽核工作总结如下：

1、制度建设和完善

组织各业务部门对相关业务制度进行梳理，新增制度 3 项，修订制度 4 项，并协助相关部门对 9 项制度草案提出修改意见。上述制度主要包括投资、风控、财务、行政、产品、运营、监察稽核、子公司等业务范畴。

2、内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作

完成季度常规审计 4 次，内部合规检查 20 次，离任审查 1 人次；协助普华永道会计师事务所和毕马威会计师事务所开展基金和公司 2017 年度审计、2018 年度预审计和 IT 审计工作；配合监管机构完成多项自查工作；配合股东联合审计等。

3、合规监察工作

按时完成并向上海证监局和公司董事提交各项监察稽核定期项目报告；定期为新入司同事开展合规培训；在基金募集、投资过程中的进行合规检查与提示；对董事、高级管理人员、基金经理任免情况进行备案等。

4、信息披露及文档的合规检查

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。

5、合规培训和法务工作

组织员工法规培训、新员工培训及部门内部培训，针对监管新规及时编制《新规速递》进行点评，对基金与行政合同进行检查修订。

6、向监管部门的数据报送和日常联络，包括监管系统信息维护、材料数据报送及与监管机构的日常沟通。

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

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

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

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

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

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

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值。

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

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则: 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权; 2、本基金每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 25%; 3、本基金收益分配方式分为两种: 现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为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; 4、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。 本基金本报告期内的收益分配情况如下,该处理符合基金利润分配原则。

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分 配合计	备注
1	2018 年 08 月 22 日	2018 年 08 月 22 日	0.602	192,325,575.39	59,392,361.91	251,717,936.70	-
2	2018 年 11 月 26 日	2018 年 11 月 26 日	0.221	62,983,898.70	23,429,699.43	86,413,598.13	-
3	2018 年 12 月 26 日	2018 年 12 月 26 日	0.090	25,563,934.17	9,326,944.11	34,890,878.28	-
合计			0.913	280,873,408.26	92,149,004.85	373,022,413.11	-

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 373,022,413.11 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

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	毕马威华振审字第 1900183 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信保诚精萃成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的第 1 页至第 36 页的中信保诚精萃成长混合型证券投资基金(以下简称“中信保诚精萃成长基金”)财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了中信保诚精萃成长基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审

	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信保诚精萃成长基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>中信保诚精萃成长基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人“)对其他信息负责。其他信息包括中信保诚精萃成长基金 2018 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中信保诚精萃成长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,除非中信保诚精萃成长基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信保诚精萃成长基金的财务报告过程。</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>(1) 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>(2) 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>(3) 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>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对中信保诚精萃成长基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中信保诚精萃成长基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	黄小熠 叶凯韵
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
审计报告日期	2019年03月27日

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金2018年12月31日的资产负债表,2018年1月1日至2018年12月31日的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 中信保诚精萃成长混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
资产：			
银行存款	7.4.7.1	156,615,281.04	350,898,545.40
结算备付金		4,376,546.66	4,824,414.93
存出保证金		813,297.35	711,450.53
交易性金融资产	7.4.7.2	1,426,382,693.55	2,094,018,610.21
其中：股票投资		1,426,382,693.55	2,094,018,610.21
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	158,447,882.68	223,410,611.13
应收证券清算款		78,060,187.62	-
应收利息	7.4.7.5	269,624.30	197,650.18
应收股利		-	-
应收申购款		32,559.76	50,193,054.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,824,998,072.96	2,724,254,337.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (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		-	27,325,486.76
应付赎回款		103,328.49	1,130,904.09
应付管理人报酬		2,470,111.72	3,213,136.06
应付托管费		411,685.27	535,522.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,186,124.51	2,709,173.26
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	1,439,231.36	1,590,316.34
负债合计		6,610,481.35	36,504,539.18
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,762,956,802.36	1,606,759,893.44

未分配利润	7.4.7.10	55,430,789.25	1,080,989,904.63
所有者权益合计		1,818,387,591.61	2,687,749,798.07
负债和所有者权益总计		1,824,998,072.96	2,724,254,337.25

注：截止本报告期末，基金份额净值 0.4667 元，基金份额总额 3,896,502,752.92 份。

7.2 利润表

会计主体：中信保诚精萃成长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
一、收入		-715,557,958.83	473,859,091.96
1. 利息收入		4,227,138.82	4,577,912.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,472,165.33	3,313,056.16
债券利息收入		-	368,140.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		754,973.49	896,716.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-137,290,745.19	281,618,912.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-161,436,068.09	267,883,300.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	18,021.88
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	24,145,322.90	13,717,589.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-584,531,816.45	183,068,765.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,037,463.99	4,593,501.27
减：二、费用		57,728,853.02	50,358,111.09
1. 管理人报酬		35,418,655.20	27,784,444.76
2. 托管费		5,903,109.18	4,630,740.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	15,761,017.41	17,280,805.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	646,071.23	662,119.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-773,286,811.85	423,500,980.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-773,286,811.85	423,500,980.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚精萃成长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,606,759,893.44	1,080,989,904.63	2,687,749,798.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-773,286,811.85	-773,286,811.85
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）	156,196,908.92	120,750,109.58	276,947,018.50
其中：1. 基金申购款	1,375,273,219.65	739,466,358.36	2,114,739,578.01
2. 基金赎回款	-1,219,076,310.73	-618,716,248.78	-1,837,792,559.51
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）	-	-373,022,413.11	-373,022,413.11
五、期末所有者权益（基金净值）	1,762,956,802.36	55,430,789.25	1,818,387,591.61
项目	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 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）	708,185,591.91	558,331,808.82	1,266,517,400.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	423,500,980.87	423,500,980.87
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）	898,574,301.53	1,897,862,586.67	2,796,436,888.20
其中：1. 基金申购款	3,394,169,472.56	3,303,321,066.59	6,697,490,539.15
2. 基金赎回款	-2,495,595,171.03	-1,405,458,479.92	-3,901,053,650.95
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）	-	-1,798,705,471.73	-1,798,705,471.73
五、期末所有者权益（基金净值）	1,606,759,893.44	1,080,989,904.63	2,687,749,798.07

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：

张翔燕

基金管理人负责人

陈逸辛

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信保诚精萃成长混合型证券投资基金（原“信诚精萃成长混合型证券投资基金”）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准信诚精萃成长股票型证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2006]198号文）和《关于信诚精萃成长股票型证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2006]295号文）批准，由中信保诚基金管理有限公司（原信诚基金管理有限公

司) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2006 年 11 月 27 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集资金总额人民币 3, 269, 759, 359. 38 元。上述募集资金已由会计师事务所验证, 并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同》的约定, 经与基金托管人协商一致, 自 2015 年 8 月 3 日起, 本基金名称变更为“信诚精萃成长混合型证券投资基金”, 基金类别变更为“混合型”, 同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚精萃成长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》, 自本次持有人大会表决通过之日(即 2018 年 11 月 12 日)起, 本基金名称变更为“中信保诚精萃成长混合型证券投资基金”, 同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。

根据《信诚精萃成长股票型证券投资基金招募说明书》和《信诚精萃成长股票型证券投资基金开展基金份额拆分、持续销售活动及修改基金合同的公告》的有关规定, 基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2008 年 2 月 26 日(拆分基准日)对本基金进行了基金份额拆分, 拆分前基金份额总额为 1, 370, 265, 832. 00 份, 基金资产净值为 3, 028, 590, 231. 12 元, 基金份额净值为 2. 2102 元。根据基金份额拆分公式, 基金份额折算比例为 1:2. 210220937, 拆分后基金份额总额为 3, 028, 590, 231. 12 份, 折算后基金份额净值为 1. 0000 元。中信保诚基金管理有限公司已根据上述拆分比例, 对本基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分, 并于 2008 年 2 月 26 日完成了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚精萃成长混合型证券投资基金基金合同》和《中信保诚精萃成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为国内依法发行的股票、债券及其他中国证监会批准的投资工具。其中股票部分重点投资具有长期持续增长模式、治理结构完善、估值水平合理的上市公司; 债券部分包括国债、金融债、央行票据以及高信用等级企业债和可转债等债券。随着我国资本市场的不断发展和完善, 以衍生金融工具为代表的其它金融工具逐渐推向市场, 本基金在法律法规或监管机构允许的范围内, 在严格的风险控制前提下, 对此等金融工具可以进行以对冲投资风险或无风险套利为主要目的的投资。在正常市场情况下, 本基金投资组合的比例范围为: 股票资产 60%-95% (其中投资于内生增长型公司的股票不得低于股票资产的 80%); 债券资产 0%-35% (不包括到期日在一年以内的政府债券); 现金或者到期日在一年内的政府债券资产不低于 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 权证资产不超过 3%。本基金的业绩比较基准为: 中信标普 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×15%+金融同业存款利率×5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》, 本基金定期报告在公开披露的第二个工作日, 报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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 2019 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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〈年度报告和半年度报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 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 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
当期发生的基金应支付的管理费	35,418,655.20	27,784,444.76
其中：支付销售机构的客户维护费	2,489,164.30	3,210,490.01

注：支付基金管理人中信保诚基金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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年 12月31日)	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年12 月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	5,903,109.18	4,630,740.85

注:支付基金托管人建设银行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

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

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

7.4.8.4 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。本基金本报告期内及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 (2018年01月01日至2018年12月 31日)		上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年12月31 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	156,615,281.04	3,335,956.76	350,898,545.40	3,105,077.62

本基金通过“中国建设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2018年12月31日的相关余额为人民币4,376,546.66元。(2017年12月31日余额为4,824,414.93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

本基金在本报告期内与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年01月03日	网下新股申购未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.9.2 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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 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工具中属于第一层次的余额为人民币 1,426,332,547.75 元，第二层次的余额为人民币 50,145.80 元，无属于第三层次的余额（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工具中属于第一层次的余额为人民币 2,017,531,714.56 元，第二层次的余额为人民币 76,486,895.65 元，无属于第三层次的余额）。（a）第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2017 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 除以上事项外，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

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	1,426,382,693.55	78.16
	其中：股票	1,426,382,693.55	78.16
	基金投资	-	-
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	158,447,882.68	8.68

	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	160,991,827.70	8.82
7	其他各项资产	79,175,669.03	4.34
8	合计	1,824,998,072.96	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

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	818,352,206.76	45.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	37,920,000.00	2.09
F	批发和零售业	115,699,739.30	6.36
G	交通运输、仓储和邮政业	38,099,977.08	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,188,642.00	4.90
J	金融业	91,254,777.80	5.02
K	房地产业	156,465,097.01	8.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,110,000.00	2.21
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,292,253.60	2.16
S	综合	-	-
	合计	1,426,382,693.55	78.44

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股票投资明细

8.3.1 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	002050	三花智控	6,241,600	79,205,904.00	4.36
2	601155	新城控股	2,599,919	61,592,081.11	3.39
3	002236	大华股份	5,300,000	60,738,000.00	3.34
4	002024	苏宁易购	6,000,000	59,100,000.00	3.25
5	603589	口子窖	1,550,000	54,358,500.00	2.99
6	600885	宏发股份	2,200,000	49,632,000.00	2.73

7	300059	东方财富	3,900,000	47,190,000.00	2.60
8	601328	交通银行	8,000,800	46,324,632.00	2.55
9	002271	东方雨虹	3,500,000	45,325,000.00	2.49
10	601318	中国平安	800,000	44,880,000.00	2.47

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	601601	中国太保	238,501,336.65	8.87
2	601318	中国平安	173,065,711.39	6.44
3	300059	东方财富	165,316,290.35	6.15
4	601155	新城控股	161,960,856.87	6.03
5	002236	大华股份	154,002,141.66	5.73
6	600519	贵州茅台	151,895,723.55	5.65
7	002050	三花智控	141,568,776.61	5.27
8	002024	苏宁易购	137,094,461.04	5.10
9	601607	上海医药	125,039,621.11	4.65
10	600703	三安光电	115,881,867.36	4.31
11	600115	东方航空	111,893,099.53	4.16
12	002078	太阳纸业	105,330,885.16	3.92
13	001979	招商蛇口	104,974,490.95	3.91
14	600809	山西汾酒	103,183,744.67	3.84
15	002745	木林森	93,215,418.56	3.47
16	000002	万科 A	91,901,466.65	3.42
17	000830	鲁西化工	89,975,268.27	3.35
18	002456	欧菲科技	87,309,763.88	3.25
19	600340	华夏幸福	86,365,317.37	3.21
20	600068	葛洲坝	80,690,321.60	3.00
21	600522	中天科技	80,604,895.00	3.00
22	601988	中国银行	80,340,000.00	2.99
23	600282	南钢股份	78,354,184.08	2.92
24	000651	格力电器	74,282,052.37	2.76
25	600885	宏发股份	73,104,602.16	2.72
26	603589	口子窖	72,102,127.64	2.68
27	600563	法拉电子	71,820,626.68	2.67
28	000333	美的集团	71,735,995.02	2.67
29	002271	东方雨虹	67,508,606.73	2.51
30	002146	荣盛发展	65,283,115.98	2.43
31	002410	广联达	63,760,291.68	2.37

32	600740	山西焦化	58,310,075.04	2.17
33	000338	潍柴动力	56,413,093.61	2.10
34	002262	恩华药业	55,740,943.35	2.07
35	601689	拓普集团	55,547,146.16	2.07

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	601318	中国平安	234,365,478.26	8.72
2	601601	中国太保	207,389,496.15	7.72
3	000858	五 粮 液	191,161,928.57	7.11
4	601155	新城控股	166,993,371.93	6.21
5	002050	三花智控	142,453,414.07	5.30
6	600519	贵州茅台	130,160,380.19	4.84
7	600703	三安光电	126,375,422.44	4.70
8	002271	东方雨虹	120,372,711.02	4.48
9	002008	大族激光	115,607,797.27	4.30
10	300059	东方财富	115,479,266.75	4.30
11	000671	阳光城	111,569,077.36	4.15
12	600885	宏发股份	109,618,052.02	4.08
13	600809	山西汾酒	98,137,211.15	3.65
14	600183	生益科技	96,598,573.69	3.59
15	600340	华夏幸福	93,497,700.29	3.48
16	000333	美的集团	92,981,752.50	3.46
17	300408	三环集团	87,076,343.83	3.24
18	601988	中国银行	85,220,089.00	3.17
19	000651	格力电器	85,177,361.05	3.17
20	600282	南钢股份	83,719,903.62	3.11
21	002236	大华股份	83,346,374.49	3.10
22	002745	木林森	82,865,591.48	3.08
23	001979	招商蛇口	77,419,221.68	2.88
24	600048	保利地产	75,412,049.67	2.81
25	600740	山西焦化	74,457,084.92	2.77
26	600563	法拉电子	70,458,361.73	2.62
27	002410	广联达	69,682,170.36	2.59
28	002456	欧菲科技	69,651,374.03	2.59
29	600585	海螺水泥	69,321,134.65	2.58
30	600115	东方航空	66,485,192.10	2.47
31	601607	上海医药	65,866,375.70	2.45
32	300316	晶盛机电	63,613,056.90	2.37

33	000002	万 科 A	58,770,652.32	2.19
34	300323	华灿光电	55,578,239.37	2.07
35	603799	华友钴业	55,203,503.58	2.05

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	5,408,770,032.97
卖出股票收入(成交)总额	5,330,438,065.09

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期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投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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 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

中国银监会行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕12、13号)显示,中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日因交通银行股份有限公司不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权等违法违规事实及并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实分别对交通银行股份有限公司处以690万元和50万元罚款。

对“交通银行”投资决策程序说明:精萃成长在对交通银行进行投资时知悉其处罚情况。该处罚针对交行之前的相关不合规事宜,首先相关不合规事宜已经得到处罚,相关主体也已经做出整改;其次,该不合规事宜以及相关处罚对于接近2000亿收入及700亿利润体量的交通银行几乎没有影响,同时该事件也并不对公司的治理形成负面结论。我们看好交通银行的业务改善以及相对便宜的估值水平,做出买入决定。

除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有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。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	813,297.35
2	应收证券清算款	78,060,187.62
3	应收股利	-
4	应收利息	269,624.30
5	应收申购款	32,559.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,175,669.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.6 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

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
25966	150,061.73	2,592,352,203.04	66.53%	1,304,150,549.88	33.47%

9.2 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	760,856.50	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚精萃成长混合
基金合同生效日(2006年11月27日)基金份额总额	3,270,839,156.56
本报告期期初基金份额总额	3,551,268,175.31
本报告期基金总申购份额	3,039,611,509.66
减:本报告期基金总赎回份额	2,694,376,932.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,896,502,752.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于2018年10月8日发布《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯会议方式召开信诚精萃成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，以通讯方式召开本基金份额持有人大会，审议《关于信诚精萃成长混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，会议投票表决起止时间为自2018年10月10日起，至2018年11月8日17:00止（以表决票收件人收到表决票的时间为准）。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2018年11月12日表决通过了《关于信诚精萃成长混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，基金份额持有人大会的决议自该日起生效。基金管理人已于表决通过之日起5日内报中国证监会备案。根据《关于信诚精萃成长混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》、《信诚精萃成长混合型证券投资基金修改基金合同方案说明书》，基金管理人已将本基金的基金合同、托管协议修订完毕，自2018年11月12日起，本基金名称变更为“中信保诚精萃成长混合型证券投资基金”。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、报告期内基金管理人无重大人事变动。
- 2、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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 240,000.00 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

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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	
中银国际	1	-	-	-	-	本期减少一个交易单元
中信证券	1	-	-	-	-	本期减少一个交易单元
中信浙江	1	-	-	-	-	本期减少两个交易单元
中信山东	1	-	-	-	-	本期新增
中信金通	1	-	-	-	-	本期新增
中信建投	2	501,123,435.90	4.67%	456,673.63	4.82%	本期减少一个交易单元
中投证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	1,490,721,125.25	13.89%	1,388,310.81	14.65%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	410,086,908.13	3.82%	373,713.12	3.94%	本期减少一个交易单元
银河证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,327,853,877.68	12.37%	1,223,786.43	12.91%	-
信达证券	2	-	-	-	-	本期减少一个交易单元
西南证券	2	205,998,822.63	1.92%	191,845.32	2.02%	-
西藏东财	1	519,739,962.35	4.84%	380,087.86	4.01%	-
西部证券	2	432,932,586.45	4.03%	335,520.71	3.54%	-

天风证券	3	585,398,067.10	5.45%	490,479.16	5.17%	本期新增一个交易单元
申银万国	1	-	-	-	-	本期减少一个交易单元
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	539,221,417.83	5.02%	499,449.37	5.27%	本期减少一个交易单元-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	83,636,050.14	0.78%	76,217.59	0.80%	本期新增
华融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
宏源证券	3	314,644,483.13	2.93%	286,735.69	3.03%	本期新增
红塔证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本期减少三个交易单元
国信证券	2	146,986,066.08	1.37%	136,888.40	1.44%	本期减少一个交易单元
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	本期新增
国联证券	1	-	-	-	-	本期减少两个交易单元
国金证券	1	-	-	-	-	本期减少一个交易单元
广发证券	1	1,097,932,384.20	10.23%	1,022,508.35	10.79%	-
高华证券	1	-	-	-	-	本期新增
方正证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	418,367,439.62	3.90%	384,411.35	4.06%	-
东方证券	1	48,888,045.91	0.46%	45,529.04	0.48%	-
东北证券	2	156,039,790.61	1.45%	142,198.46	1.50%	本期新增一个交易单元
大通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	650,283,328.04	6.06%	602,427.60	6.36%	-
长江证券	2	694,678,260.18	6.47%	638,789.13	6.74%	-

长城证券	2	1,046,030,795.02	9.74%	744,040.74	7.85%	本期新增一个交易单元
财通证券	2	-	-	-	-	本期新增
安信证券	3	64,396,227.97	0.60%	58,684.38	0.62%	本期减少两个交易单元
中航证券	1	-	-	-	-	本期退租
高盛高华	2	-	-	-	-	本期退租
英大证券	1	-	-	-	-	本期退租
申万宏源西部证券	4	-	-	-	-	本期退租
渤海证券	1	-	-	-	-	本期退租
中信万通	1	-	-	-	-	本期退租
华泰联合	3	-	-	-	-	本期退租
华宝证券	1	-	-	-	-	本期退租

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
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	200,000,000.00	44.44%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	150,000,000.00	33.33%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	100,000,000.00	22.22%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-06-11 至 2018-06-19, 2018-07-05 至 2018-07-10, 2018-07-26 至 2018-11-06	367, 759, 870 .01	883, 935, 797 .97	667, 135, 749 .75	584, 559, 918.23	15.0 0%
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

本基金管理人于 2019 年 3 月 8 日发布《中信保诚基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，经中信保诚基金管理有限公司第三届董事会第二十三次会议审议通过，自 2019 年 3 月 6 日起吕涛先生不再担任公司总经理职务，同日起由公司董事长张翔燕女士代为履行公司总经理职责。

中信保诚基金管理有限公司
2019 年 03 月 28 日