

## 中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 26 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。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中信保诚嘉鑫
基金主代码	005617
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018 年 01 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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,509,999,000.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）类属资产配置策略</p> <p>在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。</p> <p>（2）普通债券投资策略</p> <p>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>3、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来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> <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、开放期投资安排</p> <p>在开放期内，本基金将主要采用流动性管理策略进行基金投资管理。基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</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：中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	李修滨
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lixubi@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	150,241,151.40
本期利润	143,106,866.89
加权平均基金份额本期利润	0.0260
本期基金份额净值增长率	2.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配利润	174,715,318.00
期末可供分配基金份额利润	0.0317
期末基金资产净值	5,801,960,532.21
期末基金份额净值	1.0530

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。

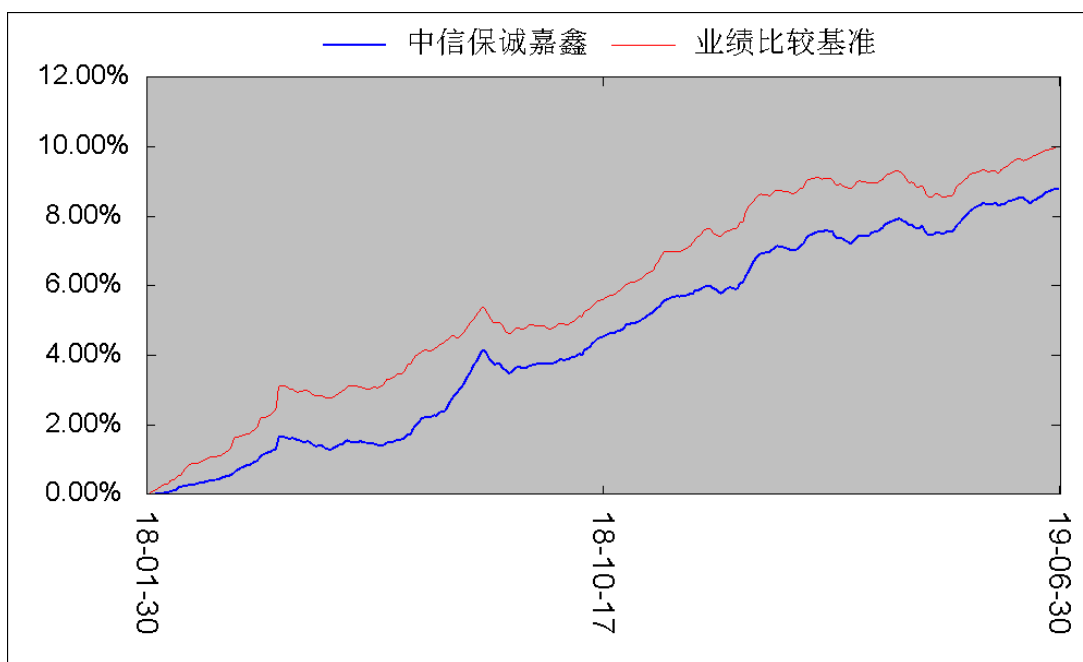
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	0.37%	0.04%	0.52%	0.03%	-0.15%	0.01%
过去三个月	0.80%	0.05%	0.64%	0.06%	0.16%	-0.01%
过去六个月	2.53%	0.05%	2.00%	0.06%	0.53%	-0.01%
过去一年	6.93%	0.05%	6.00%	0.06%	0.93%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.79%	0.05%	10.00%	0.06%	-1.21%	-0.01%

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



本基金建仓期自 2018 年 1 月 30 日至 2018 年 7 月 30 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 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 2019 年 6 月 30 日,本基金管理人管理的运作中基金为 67 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)、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、信诚智慧金货币市场基金、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、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。

#### 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		
吴胤希	本基金基金经理,兼任中信保诚信诚理财 28 日盈债券基金、中信保诚稳达债券基金、中信保诚景丰债券基金的基金经理。	2018 年 01 月 30 日	-	3	理学硕士。曾任职于远东国际租赁有限公司,担任投资分析员;于 Excel Markets 担任外汇交易员;于重庆农村商业银行股份有限公司,担任债券交易员。2016 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司。现任中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式基金、信

					诚理财 28 日盈债券基金、中信保诚稳达债券基金、中信保诚景丰债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》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。

##### 4.3.2 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

19 年债券市场的逻辑主线较 18 年有所转变。由“宽货币紧信用”向“宽货币宽信用”转变。经济下行压力显现, 但政策对冲力度加强。社融增速企稳, 货币政策边际不再放松。债券市场由单边牛市过渡到震荡市。

一季度债券收益率整体走出调整态势。1 月份, 长短端收益率均先下后上。月初时点, 由于跨过年关, 资金面宽松, 长短端收益率均有所下行。但中旬之后, 宽信用的预期较为强烈, 地方债开始逐步发行, 加上临近春节时点, 资金面受到考验, 长短端收益率均有所调整。2 月份, 股债跷跷板的效应较为明显。在社融放出天量以及中美达成谅解备忘录, 贸易战的预期大为缓和的背景下, 股票走势非常强劲, 债券走势则较为疲弱。1 年以内的短端收益率走平。3-10 年的调整较为明显, 其中 10 年国开上行最多接近 20BP。3 月份, 债券整体维持震荡格局。1 年以内的短端收益率基本走平。3-7 年的收益率也震荡走平, 10 年期国债和政金债则略有下行。

二季度债券收益率先上后下。4 月份, PMI 超预期成为债市调整的导火索。央行货币政策例会重提“总闸门”、“防风险”, 一季度宏观经济数据大幅超预期, 资金面紧张情绪加剧, 央行降准落空叠加减量续作 MLF, 政治局会议召开等因素均导致了债市调整。5 月份, 债市开启的超跌反弹行情, 中美贸易谈判急转直下, 避险情绪快速上升, 实体、金融数据均明显走弱, 海外美债收益率大幅下跌。6 月份, 债券收益率继续下行, 6 月公布的 5 月经济数据走弱, 市场重回经济不强、政策托底的市场主线。另外包商银行被托管事件持续发酵, 央行投放流动性呵护市场, 提供了 3000 亿再贷款和 SLF 额度, 对中小银行定向投放了 MLF 额度。虽然流动性分层严重, 但无风险收益率反而下行。

嘉鑫在投资策略上以获取票息和杠杆利差为主要手段, 持仓以中高信用等级信用债为主, 坚持中高等

级信用债中短久期加杠杆的策略。嘉鑫上半年的总资产久期在 1.5 年至 2 年之间，杠杆率维持在 150%左右，利用杠杆仍有利差的局面，维持较高杠杆。同时，以 5%以内的仓位进行了利率债波段交易，交易品种包括 1、3、5、10 年国开、农发活跃券。

#### 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，同期业绩比 2.53%，较基准收益率为 2.00%，基金超越业绩比较基准 0.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度的经济形势和政策组合对债券较为有利。4、5 月份的经济数据显示经济韧性有所减弱，有下行压力，但对冲政策会相应加码。需求端整体下行趋势愈发明显。1-5 月固定资产投资累计同比 5.6%，较上月回落 0.5 个百分点。基建地产双双回落，尤其地产投资出现今年首次下行，制造业投资小幅反弹。基建发力不足，逆周期加码仍存必要性。房地产融资政策边际收紧，叠加今年棚改减半且开工前置，前期拿地回落已向开工端传导，房地产投资高韧性的拐点已至，下半年投资增速或逐步走低。进出口方面，出口受美国加征关税和全球需求萎缩的影响，有较大回落风险，进口也因内需疲软走弱，整体呈现衰退性顺差。5 月规模以上工业增加值同比 5.0%，较上月回落 0.4 个百分点。需求疲弱、库存回升、PPI 步入下行通道，制约工业生产动力。

随着经济下行压力显现，政策对冲政策也开始加码。专项债新规有助于拉动基建投资，缓解经济失速担忧。但在隐性债务约束下，基建仍难以回到过去高增长时代。但在内外部复杂环境下，政策仍需要保持灵活性，必要条件下其他工具如特别国债发行、货币政策宽松、非标融资政策放松等仍可能推出。

货币政策方面，美联储议息会议鸽派，降息预期升温，欧洲央行也释放宽松信号。人民币汇率压力变小，货币政策掣肘减弱。另外为配合财政发力，货币政策也有维持宽松的必要性。

综合来看，收益率已具备创年内新低的可能性。但下行幅度依然有限。后续若看到经济触底、货币收紧的迹象，则需要缩短久期、降低仓位。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、在符合有关基金分红条件的前提下, 基金管理人可以根据实际情况进行收益分配, 具体分配方案以公告为准, 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

本基金本报告期内未进行过利润分配, 该处理符合基金利润分配原则。

#### 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

作为本基金的托管人, 中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对中信保诚嘉鑫定期开放债券型证券投资基金 2019 年上半年的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 履行了托管人的义务, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为, 中信保诚基金管理有限公司在中信保诚嘉鑫定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的中信保诚嘉鑫定期开放债券型证券投资基金 2019 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2019 年 06 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,558,794.37	2,524,778.21
结算备付金		52,047,063.88	16,700,626.88
存出保证金		98,968.99	79,350.99
交易性金融资产	6.4.7.2	8,952,198,200.90	8,279,514,713.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,507,594,200.90	8,075,002,713.00
资产支持证券投资		444,604,000.00	204,512,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	92,138,578.21
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	121,431,122.35	171,756,702.77
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,130,334,150.49	8,562,714,750.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 (2019 年 06 月 30 日)</b>	<b>上年度末 (2018 年 12 月 31 日)</b>
<b>负债：</b>			
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		3,323,116,910.31	2,896,487,384.76
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,427,321.65	1,454,435.54
应付托管费		475,773.90	484,811.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	47,908.12	31,541.06
应交税费		898,138.23	928,086.37
应付利息		2,183,978.85	4,220,325.18
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	223,587.22	254,500.00
负债合计		3,328,373,618.28	2,903,861,084.74
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,509,999,000.00	5,509,999,000.00
未分配利润	6.4.7.10	291,961,532.21	148,854,665.32
所有者权益合计		5,801,960,532.21	5,658,853,665.32
负债和所有者权益总计		9,130,334,150.49	8,562,714,750.06

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.0530 元，基金份额总额 5,509,999,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 (2019 年 01 月 01 日 至 2019 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2018 年 01 月 30 日 (基金合同生效日)至 2018 年 06 月 30 日)
<b>一、收入</b>		194,940,202.79	112,747,433.74
1. 利息收入		193,096,822.97	104,689,598.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	254,190.45	27,088,693.79
债券利息收入		188,468,616.31	64,265,520.50
资产支持证券利息收入		4,256,963.79	2,988,951.60
买入返售金融资产收入		117,052.42	10,346,432.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,977,664.33	-2,694,410.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,926,204.19	-2,789,479.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	51,460.14	95,069.08
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,134,284.51	10,752,245.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		51,833,335.90	16,969,433.77
1. 管理人报酬		8,543,366.61	6,905,004.19
2. 托管费		2,847,788.85	2,301,668.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	36,804.04	40,587.51
5. 利息支出		39,656,917.83	7,404,428.61
其中：卖出回购金融资产支出		39,656,917.83	7,404,428.61

6. 税金及附加		584,055.26	199,617.98
7. 其他费用	6.4.7.20	164,403.31	118,127.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		143,106,866.89	95,777,999.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		143,106,866.89	95,777,999.97

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (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）	5,509,999,000.00	148,854,665.32	5,658,853,665.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	143,106,866.89	143,106,866.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,509,999,000.00	291,961,532.21	5,801,960,532.21
项目	上年度可比期间 (2018 年 01 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 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）	5,509,999,000.00	-	5,509,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	95,777,999.97	95,777,999.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,509,999,000.00	95,777,999.97	5,605,776,999.97

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

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]61号《关于准予信诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》负责募集。本基金为契约型定期开放式,存续期不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,509,999,000.00 元,业经普华永道中天验字(2018)第 0087 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,509,999,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金以定期开放方式运作,即本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作。本基金的封闭期为自《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)3 个月的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日,封闭期相应顺延。本基金自封闭期结束之后第 1 个工作日(包括该日)起进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日。投资人办理基金份额的申购和赎回等业务的开放日为本基金开放期的每个工作日。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算。在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起,开放期时间顺延,直至满足开放期的时间要求。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和最新公布的《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、非金融企业债务融资工具、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场工具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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。在每次开放期前 10 个工作日内、开放期和开放期后 10 个工作日内,不受上述投资组合比例限制。在开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;在封闭期内,本基金不受前述限制,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金的业绩比较基准:中证综合债指数收益率。

### 6.4.2 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》、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

本基金在本报告期内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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

#### 6.4.7.1 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关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 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、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)	基金托管人

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.8 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。

**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.8.1.1 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。

**6.4.8.1.2 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。

**6.4.8.1.3 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。

**6.4.8.1.4 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。

**6.4.8.1.5 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通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.8.2 关联方报酬**

**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位:人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至 2019年06月30日)	上年度可比期间 (2018年01月30日(基金合同生 效日)至2018年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	8,543,366.61	6,905,004.19
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

支付基金管理人中信保诚基金的管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 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× 0.3%/当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位:人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至 2019年06月30日)	上年度可比期间 (2018年01月30日(基金合同生 效日)至2018年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	2,847,788.85	2,301,668.08

支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%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×0.1%/当年天数。

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生应支付给关联方的销售服务费。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及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。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位:份

项目	本期 (2019年01月01日至 2019年06月30日)	上年度可比期间 (2018年01月30日(基 金合同生效日)至2018年 06月30日)
基金合同生效日(2018年01月30日) 持有的基金份额	-	10,000,000.00

报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.18%

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。

#### 6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2019年06月30日）		上年度末（2018年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信银行股份有限公司	5,499,999,000.00	99.82%	5,499,999,000.00	99.82%

本基金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。

#### 6.4.8.5 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 (2019年01月01日至2019年06月30日)		上年度可比期间 (2018年01月30日(基金合同生效日)至2018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
中信银行	4,558,794.37	24,812.47	1,739,404.05	255,283.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

本基金通过“中信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2019年6月30日的相关余额为人民币52,047,063.88元。（2018年6月30日余额为13,825,418.70元）

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金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1,193,116,910.31元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101800191	18津城建	2019年	102.77	870,000	89,409,900.00



	MTN005	07 月 01 日			
101800352	18 津城建 MTN008B	2019 年 07 月 01 日	103.61	1,000,000	103,610,000.00
101801113	18 云能投 MTN001	2019 年 07 月 01 日	102.44	1,120,000	114,732,800.00
111980605	19 贵州银行 CD031	2019 年 07 月 01 日	96.31	560,000	53,933,600.00
1822016	18 江苏租赁 债 02	2019 年 07 月 01 日	102.83	400,000	41,132,000.00
190207	19 国开 07	2019 年 07 月 01 日	100.00	500,000	50,000,000.00
011900528	19 桂交投 SCP001	2019 年 07 月 03 日	100.18	1,000,000	100,180,000.00
011900609	19 联发集 SCP002	2019 年 07 月 03 日	100.19	200,000	20,038,000.00
011900702	19 太湖新城 SCP002	2019 年 07 月 03 日	100.12	1,000,000	100,120,000.00
041800441	18 太湖新城 CP003	2019 年 07 月 03 日	100.61	1,000,000	100,610,000.00
011802379	18 涪陵国资 SCP005	2019 年 07 月 04 日	100.51	570,000	57,290,700.00
011900509	19 海宁资产 SCP001	2019 年 07 月 04 日	100.16	800,000	80,128,000.00
011900609	19 联发集 SCP002	2019 年 07 月 04 日	100.19	800,000	80,152,000.00
011900675	19 中联重科 SCP001	2019 年 07 月 04 日	100.17	1,000,000	100,170,000.00
011901303	19 连云市政 SCP002	2019 年 07 月 04 日	100.09	500,000	50,045,000.00
101800183	18 川交投 MTN002	2019 年 07 月 04 日	103.03	30,000	3,090,900.00
111980605	19 贵州银行 CD031	2019 年 07 月 04 日	96.31	1,090,000	104,977,900.00
111980836	19 贵州银行 CD032	2019 年 07 月 04 日	96.30	500,000	48,150,000.00
合计				12,940,000	1,297,770,800.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,130,000,000.00 元,其中 GC014 余额 1,930,000,000.00 元,截止 2019 年 7 月 2 日到期, R-007 余额 200,000,000.00 元,截止 2019 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 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 2019 年 6 月 30 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二层次的余额为 8,952,198,200.90 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 8,279,514,713.00 元，无属于第一或第三层次的余额)。

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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 年 12 月 31 日：无）。

##### (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) 其他

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	-	-
	其中：股票	-	-
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	8,952,198,200.90	98.05
	其中：债券	8,507,594,200.90	93.18
	资产支持证券	444,604,000.00	4.87
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	56,605,858.25	0.62
7	其他各项资产	121,530,091.34	1.33

8	合计	9,130,334,150.49	100.00
---	----	------------------	--------

## 7.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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股票投资明细

### 7.3.1 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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

## 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

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。本基金本报告期内无股票买入交易。

### 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

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。本基金本报告期内无股票卖出交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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。本基金本报告期内无股票买卖交易。

## 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	141,297,000.00	2.44
	其中:政策性金融债	50,000,000.00	0.86
4	企业债券	3,335,026,200.90	57.48
5	企业短期融资券	2,257,449,000.00	38.91
6	中期票据	2,291,827,000.00	39.50
7	可转债	-	-
8	同业存单	481,995,000.00	8.31
9	其他	-	-
10	合计	8,507,594,200.90	146.63

## 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	101801560	18 中化工程 MTN001	3,000,000	300,870,000.00	5.19

2	111980859	19 晋商银行 CD069	2,500,000	241,225,000 .00	4.16
3	143520	18 金地 01	2,000,000	206,620,000 .00	3.56
4	111980605	19 贵州银行 CD031	2,000,000	192,620,000 .00	3.32
5	101801113	18 云能投 MTN001	1,800,000	184,392,000 .00	3.18

**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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	159340	19 花 02A1	2,000,000	199,980,000 0.00	3.45
2	139735	蚁信 07A	1,500,000	150,000,000 0.00	2.59
3	1889049	18 飞驰建融 1A	2,000,000	74,420,000 .00	1.28
4	1889011	18 融腾 1B_bc	200,000	20,204,000 .00	0.35

**7.8 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。

**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**

本基金投资范围不包括股指期货投资。

**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**

本基金投资范围不包括国债期货投资。

**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**

本基金本期投资的前十名证券的发行主体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**

本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过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	98,968.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121,431,122.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,530,091.34

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金投资范围不包括可转换债券投资(可分离交易可转债的纯债部分除外)。

**7.12.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明**

**7.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金投资范围不包括股票投资。

**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	2,754,999,500.00	5,509,999,000.00	100.00%	-	-

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

期末基金管理人的从业人员未持有本基金的基金份额。

**8.3 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	0
本基金基金经理持 有本开放式基金	0

- 1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金的基金份额。
- 2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

#### 8.4 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	10,000,000. 00	0.18	10,000,000. 00	0.18	自合同生 效之日起 不少于 3年
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	10,000,000. 00	0.18	10,000,000. 00	0.18	自合同生 效之日起 不少于 3年

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚嘉鑫
基金合同生效日(2018年01月30日)基金 份额总额	5,509,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	5,509,999,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,509,999,000.00

## § 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

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：

吕涛先生于 2019 年 3 月 6 日离任公司总经理职务，同日起公司董事长张翔燕女士代为履行总经理职务；唐世春先生于 2019 年 6 月 3 日新任公司总经理职务，同日起，唐世春先生离任公司副总经理职务、张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述事项已按监管要求备案并公告。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过，聘任方合英先生为本行行长，任职资格于 2019 年 3 月 29 日获中国银行保险监督管理委员会批复核准。孙德顺先生因年龄原因不再担任本行执行董事、行长等职务。根据工作需要，任命杨璋琪先生担任本行资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。

### 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。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

报告期内管理人、托管人及其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	
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	544,638,103.77	77.65%	30,655,200,000.00	88.93%	-	-
中泰证券	156,784,516.28	22.35%	3,815,851,000.00	11.07%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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。

### § 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

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	2019-01-01 至 2019-06-30	5,499,999,000.00	-	-	5,499,999,000.00	99.82%
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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中信保诚基金管理有限公司  
2019 年 08 月 26 日