

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金)2018 年第一季度报告

2018 年 3 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 4 月 23 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2018 年 1 月 15 日起，本基金的基金名称由“信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金”变更为“信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。自 2018 年 1 月 15 日起《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》、《信诚鼎泰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《信诚鼎泰多策略灵活配

置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚鼎泰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。原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2018年1月1日至2018年1月12日止，信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)本报告期自2018年1月13日至2018年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

基金简称	信诚鼎泰策略(LOF)
场内简称	信诚鼎泰
基金主代码	165532
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月15日
报告期末基金份额总额	2,168,619.25份
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>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,选取具备选成长性好,估值合理的股票,主要采用的指标包括但不限于:公司收入、未来公司利润增长率等;净资产收益率(ROE)、资本回报率(ROIC)、毛利率、净利率等;市盈率(PE)、市盈增长比率(PEG)、市净率(PB)、市销率(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、</p>

	<p>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、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 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 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。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。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

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。

2.2 原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	信诚鼎泰策略
场内简称	信诚鼎泰
基金主代码	165532
基金运作方式	契约型基金。基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为信诚鼎泰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 7 月 28 日
报告期末基金份额总额	1,507,067.99 份
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 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</p>

益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

2、股票投资策略

(1) 定向增发投资策略

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)非公开发行股票融资的方式。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。

同时,择机在二级市场买入定增事件驱动股票。已公告定增预案的股票在定增实施前,往往经历多个环节,其间或隐含投资机会。

(2) 价值策略

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,选取具备选成长性好,估值合理的股票,主要采用的指标包括但不限于:公司收入、未来公司利润增长率等;ROE、ROIC、毛利率、净利率等;PE、PEG、PB、PS等。

(3) 成长策略

本基金将挖掘内生增长型公司和外延增长型公司。

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。

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。

(4) 主题投资策略

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>3、固定收益投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。</p> <p>(1)类属资产配置策略 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 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、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略 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 对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</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,属于较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2018 年 1 月 13 日至 2018 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-15,310.74
2. 本期利润	-15,310.74
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0120
4. 期末基金资产净值	2,139,309.97
5. 期末基金份额净值	0.9865

3.1 主要财务指标

原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 12 日)
1. 本期已实现收益	-3,118.90
2. 本期利润	-3,118.90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0012
4. 期末基金资产净值	1,507,068.90
5. 期末基金份额净值	1.0000

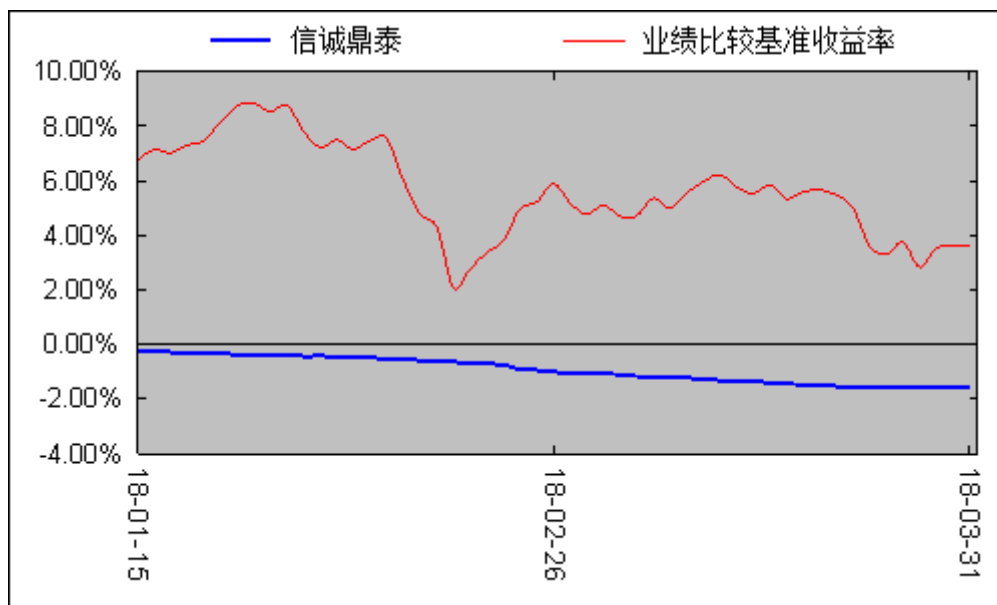
3.2 基金净值表现

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	-1.35%	0.03%	-2.93%	0.62%	1.58%	-0.59%

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、本基金转型日期为 2018 年 1 月 12 日,截至本报告期末,本基金转型未满一年。

2、本基金建仓期自 2017 年 7 月 28 日至 2018 年 1 月 28 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

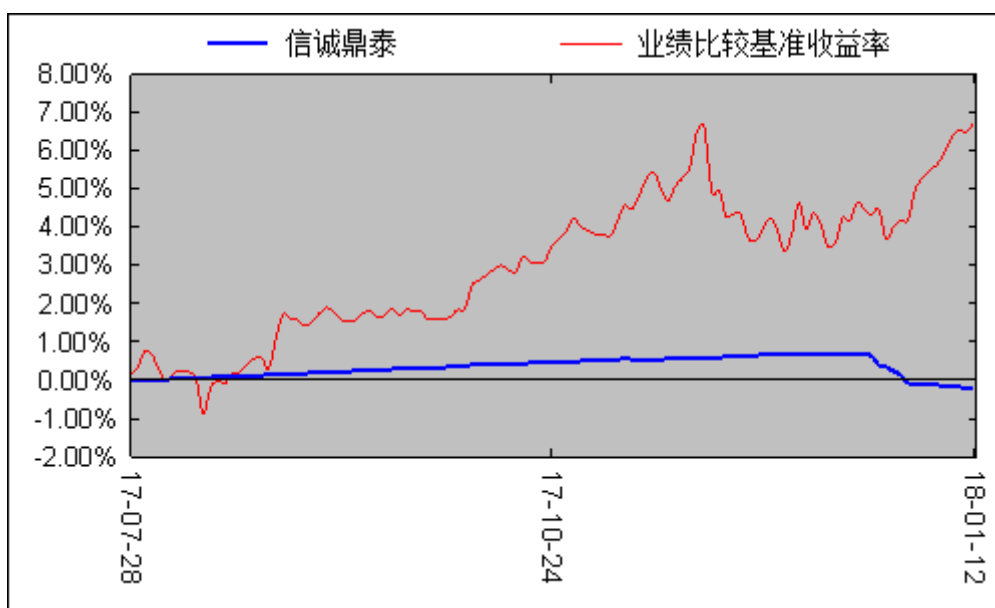
3.2 基金净值表现

原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	-0.14%	0.01%	2.44%	0.22%	-2.58%	-0.21%

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



1、本基金建仓期自 2017 年 7 月 28 日至 2018 年 1 月 28 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷孝东	本基金基金 经理、 信诚鼎利 定增灵活 配置混合 基金、信 诚多策略	2017年7月 28日	-	15	工商管理硕士。曾任职于大鹏证券有限公司, 担任资讯部分析师; 于中信证券股份有限公司, 历任研究部行业首席分析师、研究部执行总经理、研究部运营负责人、投行委能源化工组执行总经理、经发管委执行总经理等职。2016年3月加入中信保诚基金管理有限公司, 担任投行部董事

	灵活配置混合基金的基金经理			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合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚鼎泰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,本基金由于巨额赎回导致该基金总资产/净资产被动超过 140%,最终在 2018 年 3 月 23 日该超标调整到位。该情况我们及时与托管行中国银行进行了沟通,并出具了书面情况说明,并向相关监管部门进行了情况说明和报告。除此之外,本基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2018 年一季度,全球股市经历了重大波动,海内外的政治经济环境出现了较大变化,并会对未来 A 股市场带来一定影响。从海外来看,美联储加息和中美贸易摩擦给全球风险资产尤其是处于相对高位的美股带来巨大波动,并进而影响全球股市;从国内来看,宏观货币政策进一步收紧的预期被打破,政府对新兴产业的政策支持力度加大,以成长股为代表的中证 500 指数从底部大幅反弹。一季度的市场表现初步验证了我们年报中“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”的观点。对于 2018 年全年,我继续维持对全球经济复苏谨慎乐观的判断,并认为新兴市场尤其是 A 股市场将会在全球股市中具备明显超额收益。但是考虑到中美间的政治经济摩擦可能逐步加剧,全球经济复苏和权益资产表现也会一波三折,波动率将逐步加大。

考虑到市场波动较大,信诚鼎泰多策一季度主要以固定收益类资产投资为主,净值波动较小。展望二季度,我继续保持乐观预期,市场有望迎来一季度深度调整后的补涨行情。但是创业板短期涨幅过大,部分个股估值较高,存在大幅调整的风险,而前期调整较为剧烈的消费、金融、周期白马股重新进入合理的配置区间。我们将继续基于个股精选原则,综合考虑估值合理性和行业空间,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(2018-01-01至2018-01-12)基金份额净值增长率为-0.14%,同期业绩比较基准收益率为2.44%,基金落后业绩比较基准2.58%。信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018-01-13至2018-3-31)基金份额净值增长率为-1.35%,同期业绩比较基准收益率为-2.93%,基金超越业绩比较基准1.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金自2017年12月26日起至2018年3月30日止基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§ 5 投资组合报告

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
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	800,000.00	33.31
	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	1,600,645.05	66.65
7	其他资产	920.79	0.04
8	合计	2,401,565.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	920.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	920.79

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§5 投资组合报告

原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益投资		
	其中：股票		
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	3,511,088.41	99.59
7	其他资产	14,532.12	0.41
8	合计	3,525,620.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.3 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投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,532.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,532.12

5.11.4 报告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可转换债券投资。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.6 其他需说明的重要事项

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。

§6 开放式基金份额变动

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,507,067.99
报告期期间基金总申购份额	1,217,384.56
减:报告期期间基金总赎回份额	555,833.30
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,168,619.25

注:根据《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚鼎泰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》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》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2018年1月12日(份额转换基准日)实施转型,2018年1月12日日终,信诚鼎泰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鼎泰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

2018 年 1 月 15 日发布的《信诚鼎泰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鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)合同生效公告》。

§ 6 开放式基金份额变动

原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,442,546.54
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,935,478.55
报告期期末基金份额总额	1,507,067.99

注：根据《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚鼎泰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》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》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 2018 年 1 月 12 日（份额转换基准日）实施转型，2018 年 1 月 12 日日终，信诚鼎泰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鼎泰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 2018 年 1 月 15 日发布的《信诚鼎泰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鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)合同生效公告》。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

原信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金份额情况
------	----------------	--------------

别								
	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	20180323 至 20180331		506,739.64		506,739.64	23.37%	
	2	20180104 至 20180322	494,273.65		193,451.62	300,000.00	13.83%	
	3	20180124 至 20180129	299,761.93		299,145.89			
	4	20180104 至 20180110	494,138.65		494,138.65			
个人	5	20180101 至 20180103	1,000,409.05		1,000,409.05			
产品特有风险								
<p>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:</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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。</p>								

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金于 2017 年 12 月 13 日发布了《信诚基金管理有限公司关于信诚鼎泰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》。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 11 月 15 日起至 2017 年 12 月 11 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 12 月 12 日表决通过了《关于信诚鼎泰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 2018 年 1 月 12 日为本基金的份额结转基准日,2018 年 1 月 15 日正式实施基金转型。自 2018 年 1 月 15 日起,本基金的基金名称由“信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金”变更为“信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。自 2018 年 1 月 15 日起《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》、《信诚鼎泰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《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚鼎泰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。

2、本基金管理人于2018年3月27日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》，并分别于2018年3月28日、2018年3月29日发布了第一次及第二次提示性公告：本基金自2018年3月30日起，至2018年4月26日17:00召开基金份额持有人大会，审议《关于终止信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同有关事项的议案》。

§ 10备查文件目录

10.1 备查文件目录

- | |
|---|
| <ol style="list-style-type: none">1、(原) 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件2、中信保诚基金管理公司营业执照、公司章程3、(原) 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同4、(原) 信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书5、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同6、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书7、本报告期内按照规定披露的各项公告 |
|---|

10.2 存放地点

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

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2018年4月23日