

信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：信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：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2016 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚沪深 300 指数分级		
场内简称	信诚 300		
基金主代码	165515		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 2 月 1 日		
基金管理人	信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	447,058,183.00 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 2 月 17 日		
下属分级基金的基金简称	信诚沪深 300 指数 分级 A	信诚沪深 300 指数 分级 B	信诚沪深 300 指数 分级
下属分级基金的场内简称	沪深 300A	沪深 300B	信诚 300
下属分级基金的交易代码	150051	150052	165515
报告期末下属分级基金的份额总额	186,716,248.00 份	186,716,248.00 份	73,625,687.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过对沪深 300 指数的跟踪复制,为投资人提供一个投资沪深 300 指数的有效工具。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪指数,即按照沪深 300 指数中成份股组成及在权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份

	股及其权重的变化进行相应调整, 力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。 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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理, 以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。		
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×金融同业存款利率		
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看, 信诚沪深 300 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征; 信诚沪深 300 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	信诚沪深 300 指数分级 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征	信诚沪深 300 指数分级 B 份额具有高风险、高预期收益的特征	信诚沪深 300 指数分级基金为跟踪指数的股票型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金

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		信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@xcfunds.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

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.xcfunds.com
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(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-240,189,894.81
本期利润	-228,743,483.32
加权平均基金份额本期利润	-0.3203
本期基金份额净值增长率	-13.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3300
期末基金资产净值	480,963,585.28
期末基金份额净值	1.076

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

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

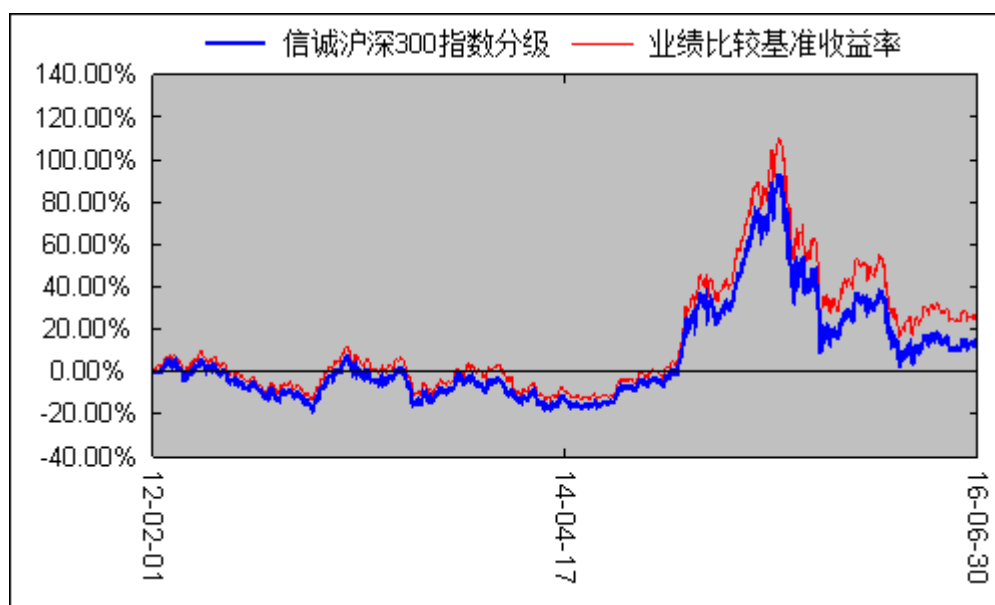
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	0.95%	-0.46%	0.93%	1.02%	0.02%
过去三个月	-0.92%	1.01%	-1.87%	0.96%	0.95%	0.05%
过去六个月	-13.81%	1.77%	-14.65%	1.75%	0.84%	0.02%
过去一年	-28.51%	2.20%	-27.99%	2.19%	-0.52%	0.01%
过去三年	34.06%	1.76%	41.76%	1.75%	-7.70%	0.01%
自基金合同生效起至今	15.00%	1.61%	27.56%	1.60%	-12.56%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效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:本基金建仓日自 2012 年 2 月 1 日至 2012 年 8 月 1 日,建仓日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

本基金管理人信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%。截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 40 只基金,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、信诚添金分级债券型证券投资基金、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、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、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分级证券投资基金、信诚惠报债券型证券投资基金和信诚鼎利定增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		
提云涛	本基金基金经理,信诚基金管理有限公司数量投资总监	2016 年 3 月 2 日	-	16	复旦大学经济学博士。曾任上海申银万国证券研究所宏观策略部/金融工程部副总监、总监,平安资产管理有限责任公司量化投研部总经理,中信证券股份有限公司研究部金融工程总监。2015 年 6 月加入信诚基金管理有限公

					司。现任信诚基金管理有限公司数量投资总监、信诚沪深 300 指数分级基金的基金经理。
杨旭	本基金基金经理，兼任信诚沪深 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金及信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理	2015 年 1 月 15 日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金 Robust methods 公司数量分析师，华尔街对冲基金 WSFA Group 公司助理基金经理，该基金为股票多空型对冲基金。2012 年 8 月加入信诚基金，曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理。

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《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚沪深 300 指数分级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、二级市场对于同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,随着转方式、调结构稳步推进,中国经济运行整体平稳。一方面,国内生产总值同比增长 6.7%,较去年同期 7% 的增速下降 0.3 个百分点;固定资产投资、居民可支配收入较去年同比有所回落,1-6 月份民间投资增速快速下滑,经济增速有所回落。另一方面,居民消费稳健增长,居民消费价格基本稳定,对外贸易顺差继续扩大,经济运行呈现平稳态势。市场逐步形成对经济长期运行“L”型的一致预期。金融市场上,上半年国内低风险金融产品收益率不断下降,信托计划、银行理财产品、债券等收益率逐步下行;同时,债券违约等金融市场风险事件频发。收益率下滑和风险事件频发证实了“资产荒”预期。海外市场,6 月份英国脱欧公投增加了金融市场的不确定性,虽然全球市场经过短暂动荡后趋于平稳,但未来风险仍然未知。

A 股市场经历了熔断后的快速下跌,随着紧急暂停“熔断”,之后逐步企稳,投资者信心逐步恢复,沪深 300 指数从 1 月份收盘最低点 2853 点逐步企稳。虽然中间有波折,但截止到 6 月 30 日收盘为 3153 点。虽然比 2015 年 12 月 31 日收盘的 3731 点下跌 15.5%,但比 1 月收盘最低点上涨 10.5%。未来“资产荒”的大环境下,随着风险资产的风险被证实、低风险(或无风险)产品收益率的下降、以及部分题材炒作逐步被证伪,低估值盈利稳定或低估值盈利稳定增长的股票资产的价值可能被市场逐步认可。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-13.81%,同期业绩比较基准收益率为-14.65%,基金超越业绩比较基准 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,我们在震荡市场环境及时处理每日申购赎回现金流,有效地管理跟踪误差;在市场震荡期间,也利用股指期货多头套保应对申赎的现金管理;同时,积极参与网下新股申购,以提高基金的净值。

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最严格的控制。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。

基金管理人根据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有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金(包括信诚沪深 300 份额、信诚沪深 300 A 份额、信诚沪深 300 B 份额)不进行收益分配。

本基金于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。

§ 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。

根据本基金合同的约定,本基金不进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：信诚沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		30,439,392.33	164,555,677.70
结算备付金		27,164,392.64	8,416,288.14
存出保证金		6,845,439.64	4,675,486.20
交易性金融资产		420,669,560.45	1,175,050,041.21
其中：股票投资		420,669,560.45	1,174,614,823.61
基金投资		-	-
债券投资		-	435,217.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		4,992,409.90	-
应收利息		20,620.38	27,335.48
应收股利		-	-
应收申购款		495.25	29,597,788.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		490,132,310.59	1,382,322,617.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,726,102.43	106,694.32
应付管理人报酬		418,857.93	989,025.49
应付托管费		92,148.75	217,585.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		398,893.54	997,796.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债		532,722.66	548,395.57
负债合计		9,168,725.31	2,859,497.81
所有者权益：			
实收基金		418,067,755.30	1,033,979,931.28
未分配利润		62,895,829.98	345,483,188.40
所有者权益合计		480,963,585.28	1,379,463,119.68
负债和所有者权益总计		490,132,310.59	1,382,322,617.49

注：截至本报告期末，基金份额总额 447,058,183.00 份。信诚沪深 300 指数分级份额净值 1.076 元，基金份额总额 73,625,687.00 份。下属两级基金：信诚沪深 300 指数分级 A 的基金份额净值 1.019 元，基金份额总额 186,716,248.00 份；信诚沪深 300 指数分级 B 的基金份额净值 1.133 元，基金份额总额 186,716,248.00 份。

6.2 利润表

会计主体：信诚沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-221,432,508.32	76,571,549.97
1. 利息收入		340,934.86	770,436.19
其中：存款利息收入		340,630.93	210,900.70
债券利息收入		303.93	559,535.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-234,957,284.78	335,197,237.18
其中：股票投资收益		-238,558,968.38	320,770,743.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益		105,173.10	2,283,278.13
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-552,453.00	1,706,850.00
股利收益		4,048,963.50	10,436,366.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		11,446,411.49	-261,672,404.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”		1,737,430.11	2,276,281.45

号填列)			
减：二、费用		7,310,975.00	13,497,900.73
1. 管理人报酬		3,312,924.99	5,227,331.60
2. 托管费		728,843.56	1,150,012.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,901,165.12	6,752,218.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		368,041.33	368,338.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-228,743,483.32	63,073,649.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-228,743,483.32	63,073,649.24

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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）	1,033,979,931.28	345,483,188.40	1,379,463,119.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-228,743,483.32	-228,743,483.32
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）	-615,912,175.98	-53,843,875.10	-669,756,051.08
其中：1. 基金申购款	623,890,873.34	98,620,356.00	722,511,229.34
2. 基金赎回款	-1,239,803,049.32	-152,464,231.10	-1,392,267,280.42
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）	418,067,755.30	62,895,829.98	480,963,585.28
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 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	680,948,821.13	221,880,441.58	902,829,262.71

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,073,649.24	63,073,649.24
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)	466,179,277.88	413,214,035.91	879,393,313.79
其中:1.基金申购款	1,553,745,768.18	1,135,053,175.06	2,688,798,943.24
2.基金赎回款	-1,087,566,490.30	-721,839,139.15	-1,809,405,629.45
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)	1,147,128,099.01	698,168,126.73	1,845,296,225.74

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:

吕涛	陈逸辛	时慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚沪深 300 指数分级证券投资基金(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”)《关于核准信诚沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许[2011]1472 号文)和《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2012]42 号文)批准,由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》及其配套规则和《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2012 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信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。

本基金于 2011 年 12 月 21 日至 2012 年 1 月 18 日募集,首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币 390,145,245.77 元,利息人民币 163,442.84 元,共计人民币 390,308,688.61 元。上述认购资金折合 390,308,688.61 份基金份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了 KPMG-B(2012)CR No.0003 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较标准为 95%×沪深 300 指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 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要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外，本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 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 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 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。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,312,924.99	5,227,331.60
其中：支付销售机构的客户维护费	246,392.93	284,291.70

注：支付基金管理人信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 1.0%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×1.0%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	728,843.56	1,150,012.92

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 0.22%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×0.22%/当年天数。

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

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。本基金的基金管理人在本报告期内及上年度可比期间未投资过本基金。

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

信诚沪深 300 指数分级 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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

中信信托有限责 任公司	-	-	13,000,000.00	1.57%
----------------	---	---	---------------	-------

注：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。本基金其它关联方在本报告期末未持有本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	30,439,392.33	211,118.72	81,186,374.93	134,334.77

注：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 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 元。（2015 年 6 月 30 日余额为 16,687,120.39 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。

6.4.9 期末（2016 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
601966	玲珑轮 胎	2016-06-24	2016-07-06	新股申 购	12.98	12.98	3,868	50,206.64	50,206.64	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股申 购	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国 创	2016-06-30	2016-07-08	新股申 购	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股 份	2016-06-29	2016-07-07	新股申 购	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
6.4.9.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原 因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000002	万 科 A	2015-12-18	筹 划 重	18.20	2016-07-04	21.99	870,278	12,131,984.47	15,839,059.60	-

			大事项							
000651	格力电器	2016-02-22	筹划重大事项	19.22	-	-	255,850	5,515,657.68	4,917,437.00	-
002065	东华软件	2015-12-21	筹划重大事项	18.72	2016-07-04	22.59	89,058	2,274,373.72	1,667,165.76	-
000415	渤海金控	2016-02-01	筹划重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	186,526	1,632,860.63	1,272,107.32	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	筹划重大事项	4.90	-	-	243,280	1,424,798.82	1,192,072.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	筹划重大事项	12.44	-	-	90,154	1,319,766.91	1,121,515.76	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项待核实	14.36	-	-	76,623	1,160,737.81	1,100,306.28	-
000728	国元证券	2016-06-08	筹划重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	61,925	1,360,647.65	1,035,386.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	筹划重大事项	8.29	-	-	87,857	988,904.22	728,334.53	-
600005	武钢股份	2016-06-27	筹划重大事项	2.76	-	-	198,798	745,159.66	548,682.48	-
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	筹划重大事项	2.39	-	-	225,557	800,360.85	539,081.23	-
601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	13,815	47,938.05	289,009.80	-

注:截至本报告批准报出日,“格力电器”、“宝钢股份”、“海格通信”、“城投控股”、“中环股份”、“武钢股份”和“*ST 钒钛”仍未发布复牌公告。

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

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§ 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	420,669,560.45	85.83
	其中:股票	420,669,560.45	85.83

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	57,603,784.97	11.75
7	其他各项资产	11,858,965.17	2.42
8	合计	490,132,310.59	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	316,651.14	0.07
B	采矿业	14,268,219.38	2.97
C	制造业	130,880,011.33	27.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,181,551.12	3.36
E	建筑业	13,362,483.84	2.78
F	批发和零售业	8,638,214.35	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	12,467,387.11	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,810,830.75	5.57
J	金融业	147,707,502.42	30.71
K	房地产业	29,715,793.19	6.18
L	租赁和商务服务业	5,618,666.35	1.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,873,777.96	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	693,814.29	0.14
R	文化、体育和娱乐业	7,704,271.20	1.60
S	综合	2,031,915.09	0.42
	合计	419,271,089.52	87.17

7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	539,081.23	0.11
C	制造业	479,761.40	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	-	-
E	建筑业	289,009.80	0.06
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	70,492.40	0.01
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	20,126.10	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,398,470.93	0.29

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 期末指数投资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

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	521,175	16,698,447.00	3.47
2	000002	万科 A	870,278	15,839,059.60	3.29
3	600016	民生银行	1,164,118	10,395,573.74	2.16
4	601166	兴业银行	656,627	10,006,995.48	2.08
5	600036	招商银行	507,617	8,883,297.50	1.85
6	601328	交通银行	1,352,818	7,616,365.34	1.58
7	600519	贵州茅台	24,115	7,039,650.80	1.46
8	600000	浦发银行	425,779	6,629,379.03	1.38
9	600030	中信证券	378,878	6,149,189.94	1.28
10	601288	农业银行	1,882,274	6,023,276.80	1.25

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000629	*ST 钒钛	225,557	539,081.23	0.11
2	601611	中国核建	13,815	289,009.80	0.06
3	601127	小康股份	6,873	164,058.51	0.03
4	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
5	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	25,025,946.83	1.81
2	600016	民生银行	19,929,786.48	1.44
3	601166	兴业银行	15,115,623.50	1.10
4	600036	招商银行	12,303,573.77	0.89
5	600000	浦发银行	12,253,162.86	0.89
6	601328	交通银行	10,652,901.47	0.77
7	600030	中信证券	10,125,720.00	0.73
8	601288	农业银行	8,863,112.29	0.64
9	600837	海通证券	8,491,079.97	0.62
10	600519	贵州茅台	8,329,260.62	0.60
11	601169	北京银行	7,556,773.52	0.55
12	601398	工商银行	7,279,223.00	0.53
13	601766	中国中车	6,921,970.90	0.50
14	600887	伊利股份	6,258,571.56	0.45
15	601668	中国建筑	6,247,193.62	0.45
16	601601	中国太保	5,833,044.60	0.42
17	600900	长江电力	5,261,416.00	0.38
18	601988	中国银行	5,252,664.00	0.38
19	600104	上汽集团	5,136,299.00	0.37
20	601377	兴业证券	5,037,092.84	0.37

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	48,253,081.60	3.50
2	600016	民生银行	40,887,717.60	2.96
3	601166	兴业银行	29,755,765.77	2.16
4	600000	浦发银行	25,032,488.48	1.81
5	600036	招商银行	24,124,536.56	1.75
6	601328	交通银行	18,749,289.33	1.36

7	600030	中信证券	17,947,255.41	1.30
8	601288	农业银行	17,227,987.00	1.25
9	600519	贵州茅台	16,218,328.78	1.18
10	600837	海通证券	15,570,949.73	1.13
11	601169	北京银行	14,587,375.09	1.06
12	601398	工商银行	13,222,279.00	0.96
13	601766	中国中车	13,182,115.23	0.96
14	600887	伊利股份	12,306,798.91	0.89
15	601668	中国建筑	11,660,604.62	0.85
16	601601	中国太保	11,314,866.22	0.82
17	601988	中国银行	10,296,462.10	0.75
18	600104	上汽集团	9,698,037.05	0.70
19	000333	美的集团	9,006,389.04	0.65
20	601989	中国重工	8,886,101.41	0.64

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	606,745,573.20
卖出股票收入（成交）总额	1,132,686,417.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

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
IF1609	IF1609	12	10,956,960.00	782,760.00	在本报告期内，基金利用股指期货作为工具进行套保，以配合现货

					投资复制标的指数减小跟踪误差, 及应付大额申购赎回。
IF1612	IF1612	12	10,733,040.00	120,120.00	在本报告期内, 基金利用股指期货作为工具进行套保, 以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差, 及应付大额申购赎回。
IF1607	IF1607	8	7,472,160.00	6,300.00	在本报告期内, 基金利用股指期货作为工具进行套保, 以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差, 及应付大额申购赎回。
公允价值变动总额合计(元)			909,180.00		
股指期货投资本期收益(元)			-552,453.00		

股指期货投资本期公允价值变动(元)	963,180.00
-------------------	------------

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。本基金本报告期内，股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

农业银行于 2016 年 1 月 23 日发布公告，农业银行北京分行票据买入返售业务发生重大风险事件，经核查，涉及风险金额为 39.15 亿元。公安机关已立案调查。对农业银行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，该处罚事项未对农业银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外，信诚沪深 300 是指数型基金，对于农业银行的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。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。

中信证券因在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌，于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书(稽查总队调查通字 153121 号)。对中信证券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，该处罚事项未对中信证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外，信诚沪深 300 是指数型基金，对于中信证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。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。

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。

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.1 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,845,439.64
2	应收证券清算款	4,992,409.90
3	应收股利	-
4	应收利息	20,620.38
5	应收申购款	495.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,858,965.17
---	----	---------------

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	15,839,059.60	3.29	筹划重大事项

7.12.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000629	*ST 钒钛	539,081.23	0.11	筹划重大事项
2	601611	中国核建	289,009.80	0.06	新股待上市

7.12.4 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

份额级别	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
信 诚 沪 深 300 指 数 分 级 A	1,065	175,320.42	146,608,098.00	78.52%	40,108,150.00	21.48%
信 诚 沪 深 300 指 数 分 级 B	9,914	18,833.59	31,721,903.00	16.99%	154,994,345.00	83.01%
信 诚 沪 深 300 指	4,789	15,373.92	28,432,925.34	38.62%	45,192,761.66	61.38%

数 分 级						
合计	15,768	28,352.24	206,762,926.34	46.25%	240,295,256.66	53.75%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

信诚沪深 300 指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	银华财富资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	14,976,801.00	8.02%
2	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利 3 号资产管理产品	12,987,063.00	6.96%
3	北京千石创富—招商银行—千石资本—华宝证券明泓套利 1 号资	10,466,411.00	5.61%
4	工银瑞信基金—农业银行—吉祥人寿保险—吉祥人寿万能产品	8,000,000.00	4.28%
5	海通证券股份有限公司	7,185,613.00	3.85%
6	中泰证券股份有限公司	4,631,500.00	2.48%
7	上海明泓投资管理有限公司—明泓多策略对冲 1 号基金	4,272,329.00	2.29%
8	全国社保基金二零八组合	4,000,000.00	2.14%
9	中金公司—建设银行—中金对冲绝对收益 1 号集合资产管理计划	3,519,921.00	1.89%
10	卞欣乐	3,499,544.00	1.87%

信诚沪深 300 指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管	7,820,000.00	4.19%
2	王景丽	5,115,036.00	2.74%
3	中泰证券股份有限公司	4,631,500.00	2.48%
4	谢华桃	4,270,500.00	2.29%
5	光大永明人寿保险有限公司—分红险	4,155,171.00	2.23%
6	宋伟铭	2,857,350.00	1.53%
7	易方达资产管理（香港）有	2,000,000.00	1.07%

	限公司—客户资金		
8	利得资本管理有限公司—利得资本—利得盈 1 号资产管理计划	1,953,802.00	1.05%
9	张立	1,951,700.00	1.05%
10	西南证券—农业银行—西南证券双喜盛誉策略 2 号集合资产管理	1,700,000.00	0.91%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	信诚沪深 300 指数分级 A	—	—
	信诚沪深 300 指数分级 B	—	—
	信诚沪深 300 指数分级	40,001.59	0.05%
	合计	40,001.59	0.01%

注：1、本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

2、期末本公司基金从业人员未持有本基金的 A 级份额和 B 级份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	信诚沪深 300 指数分级 A	0
	信诚沪深 300 指数分级 B	0
	信诚沪深 300 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚沪深 300 指数分级 A	0
	信诚沪深 300 指数分级 B	0
	信诚沪深 300 指数分级	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金 A 级份额和 B 级份额。

2、期末本基金基金经理未持有本基金 A 级份额和 B 级份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚沪深 300 指数分级 A	信诚沪深 300 指数分级 B	信诚沪深 300 指数分级
基金合同生效日(2012 年 2 月 1 日)基金份额总额	83,336,256.00	83,336,257.00	223,636,175.61
本报告期期初基金份额总额	826,378,496.00	826,378,497.00	123,033,902.02

本报告期基金总申购份额	-	-	681,459,845.08
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,477,196,831.27
本报告期基金拆分变动份额	-639,662,248.00	-639,662,249.00	746,328,771.17
本报告期期末基金份额总额	186,716,248.00	186,716,248.00	73,625,687.00

注: 1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

2. 根据《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金合同》、《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定, 基金管理人信诚基金管理有限公司于 2016 年 1 月 27 日(折算基准日)对本基金进行了基金份额不定期份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后减少信诚沪深 300 份额 532,995,725.83 份。

§ 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

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.4 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毕马威华振会计师事务所。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	
中泰证券	1	530,474,269.12	30.55%	494,026.53	30.73%	-
西南证券	3	341,259,268.62	19.65%	317,817.70	19.77%	-
广发证券	1	168,871,139.19	9.72%	157,268.70	9.78%	-
长江证券	2	152,853,272.78	8.80%	139,537.47	8.68%	-
东兴证券	1	135,138,919.26	7.78%	123,153.66	7.66%	-
川财证券	2	131,564,245.54	7.58%	120,556.25	7.50%	-
华创证券	3	80,963,977.88	4.66%	75,402.26	4.69%	-

华泰证券	2	77,041,220.64	4.44%	71,747.34	4.46%	-
东北证券	1	41,874,789.99	2.41%	38,159.55	2.37%	本期新增
方正证券	1	34,297,549.81	1.98%	31,255.07	1.94%	-
银河证券	2	16,481,597.84	0.95%	15,349.66	0.95%	-
兴业证券	1	16,445,076.20	0.95%	14,986.52	0.93%	-
东吴证券	2	9,275,182.14	0.53%	8,453.18	0.53%	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	本期退租
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

中信金通	1	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	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。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中泰证券	-	-
西南证券	347,767.00	42.02%
广发证券	-	-
长江证券	-	-
东兴证券	-	-
川财证券	142,731.07	17.25%
华创证券	-	-
华泰证券	337,110.80	40.73%
东北证券	-	-
方正证券	-	-
银河证券	-	-
兴业证券	-	-
东吴证券	-	-
安信证券	-	-
长城证券	-	-
大通证券	-	-
东方证券	-	-
高华证券	-	-
国金证券	-	-
国联证券	-	-
国泰君安	-	-
国信证券	-	-
海通证券	-	-
红塔证券	-	-
宏源证券	-	-
华融证券	-	-
联合证券	-	-
民生证券	-	-

平安证券	-	-
瑞银证券	-	-
山西证券	-	-
申银万国	-	-
信达证券	-	-
招商证券	-	-
浙商证券	-	-
中金公司	-	-
中投证券	-	-
中信建投	-	-
中信金通	-	-
中信山东	-	-
中信浙江	-	-
中信证券	-	-
中银国际	-	-
渤海证券	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

信诚基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日