信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)(原信诚中证基建工程指数分级证券投资基金转型)2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

自 2016 年 7 月 27 日起,信诚中证基建工程指数分级证券投资基金不再设置基金份额的分级,并正式变更为信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)。原信诚中证基建工程指数分级证券投资基金本报告期自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日止, 信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)本报告期自 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金名称	信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)
基金简称	信诚中证基建工程指数(LOF)
场内简称	基建工程
基金主代码	165525
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,200,138.19 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2016 年 12 月 9 日

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	信诚中证基建工程指数分级证券投资基金
基金简称	信诚中证基建工程指数分级
场内简称	基建工程
基金主代码	165525
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 日
基金管理人	信诚基金管理有限公司

基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	10,361,569.94 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	信诚中证基建工程指数分级 A	信诚中证基建工程指数分级 B	信诚中证基建工程指数分级
下属分级基金的场内简称	基建 A	基建 B	基建工程
下属分级基金的交易代码	150313	150314	165525
报告期末下属分级基金的份额总额	25,013.00	25,014.00	10,311,542.94

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证基建工程指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其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,如预期大额申购赎回、大量分红等,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%×中证基建工程指数收益率+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,具有较高预期风险、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。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证基建工程指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其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,如预期大额申购赎回、大量分红等,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%×中证基建工程指数收益率+5%×金融同业存款利率		
风险收益特征	信诚基建 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	信诚基建 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。	本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日)
本期已实现收益	-1,524,441.30
本期利润	-3,502,377.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0690
本期基金份额净值增长率	17.52%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 12 月 31 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0900
期末基金资产净值	212,755,473.30
期末基金份额净值	1.194

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。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

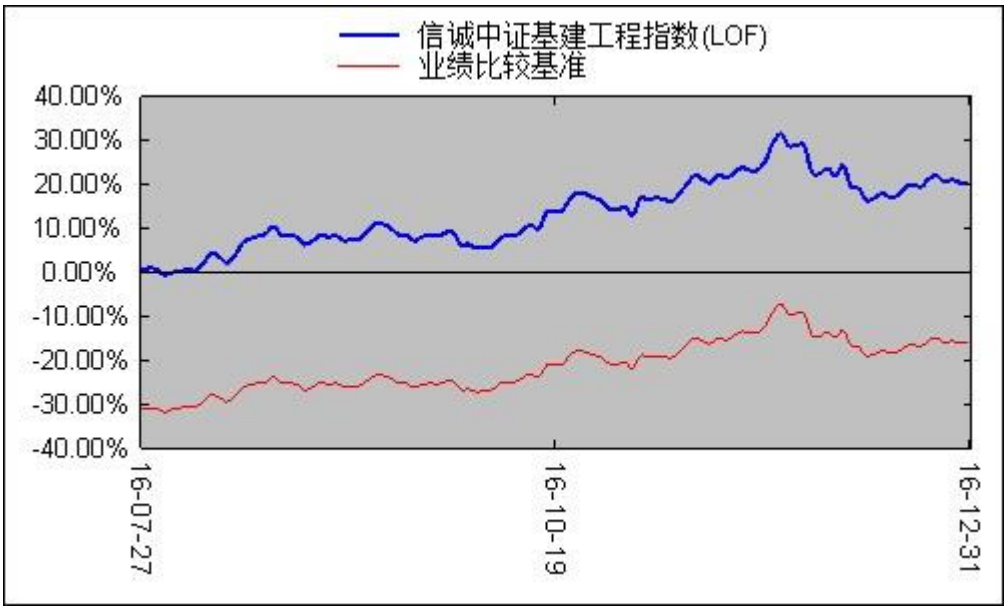
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日)
本期已实现收益	1,159,626.68
本期利润	1,698,390.32
加权平均基金份额本期利润	0.0512
本期基金份额净值增长率	2.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 7 月 26 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0239
期末基金资产净值	10,529,981.62
期末基金份额净值	1.016

3.2 基金净值表现(转型后)

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	13.82%	1.50%	14.50%	1.62%	-0.68%	-0.12%
自基金合同生效起至今(2016/7/27 至 2016/12/31)	17.52%	1.35%	19.79%	1.43%	-2.27%	-0.08%

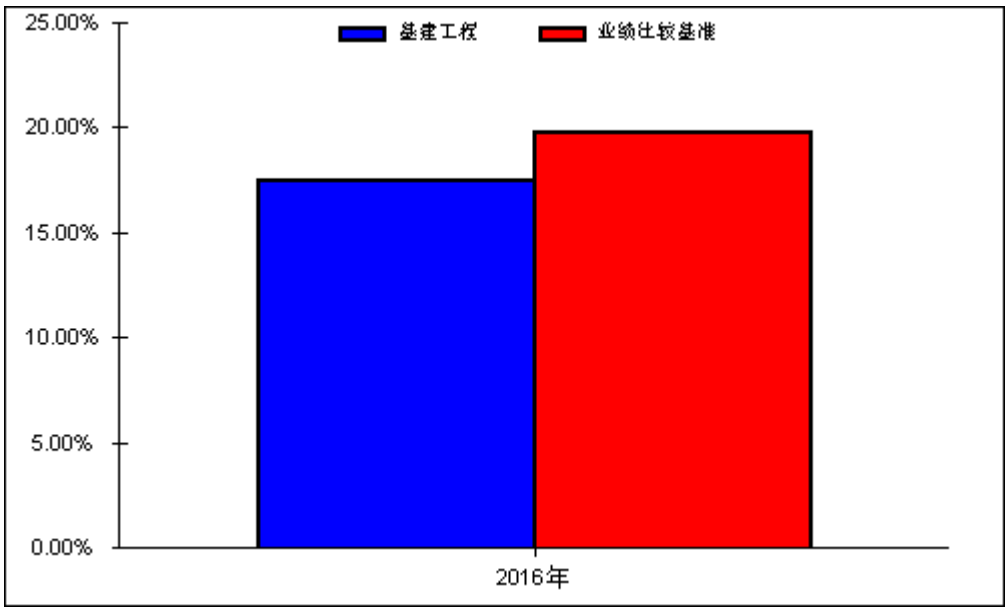
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本基金转型日期为 2016 年 7 月 27 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 2015 年 8 月 6 日至 2016 年 2 月 6 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:2016 年的净值增长率按照基金转型后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

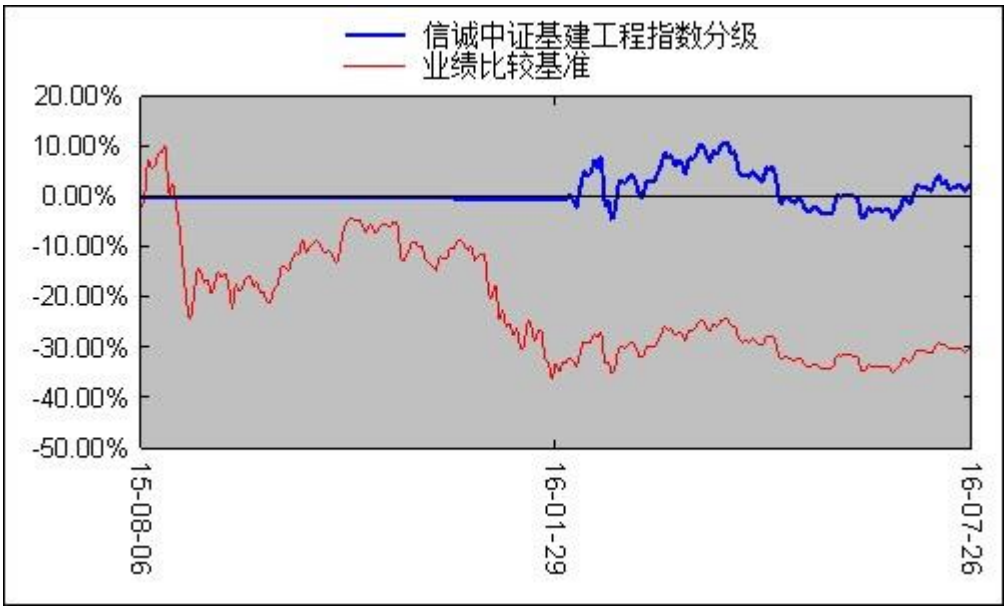
3.2 基金净值表现(转型前)

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
过去六个月(2016/7/1	3.25%	0.97%	3.88%	0.91%	-0.63%	0.06%

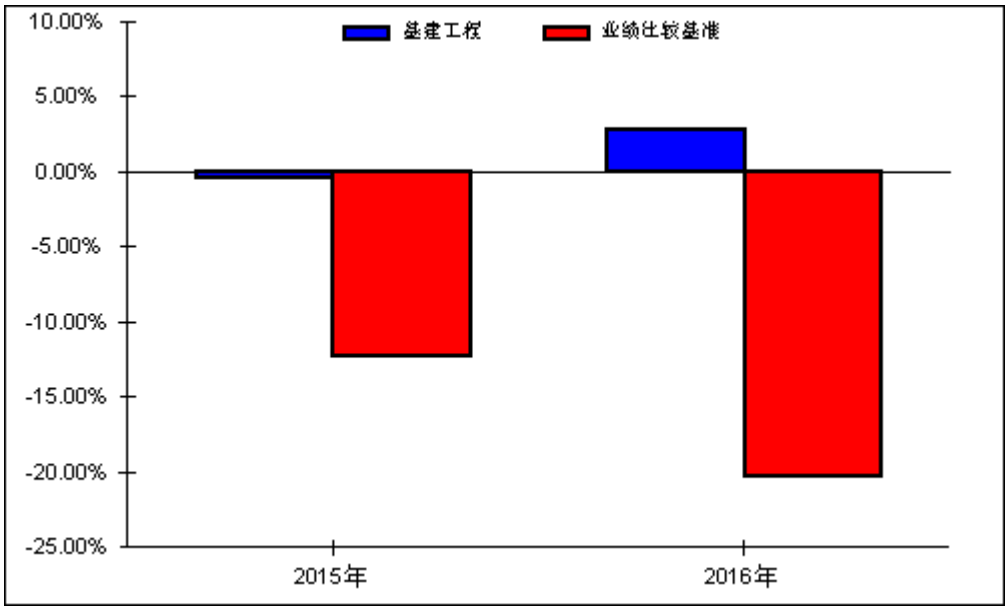
至 2016/7/26)						
过去一年(2016/1/1 至 2016/7/26)	2.83%	1.46%	-20.24%	2.21%	23.07%	-0.75%
自基金合同生效起至今(2015/8/6 至 2016/7/26)	2.45%	1.12%	-29.99%	2.44%	32.44%	-1.32%

3.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期自 2015 年 8 月 6 日至 2016 年 2 月 6 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。2016 年的净值增长率按照基金转型前当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为 2015 年 8 月 6 日,本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

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 12 月 31 日,本基金管理人共管理 55 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性证券投资基金、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、、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金。

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		
杨旭	本基金基金经理，兼任信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 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、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、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配	2015 年 8 月 6 日	-	4	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司，担任数量分析师；于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司，担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入信诚基金，历任助理投资经理、专户投资经理。现任数量投资副总监，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、信诚中证基建工程指数型基金（LOF）、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活配置混合基金、信

	置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金的基金经理				诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金的基金经理。

注:1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.1.3 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。

4.1.4 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。

4.1.5 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2016年,年初A股市场经历了熔断后的快速下跌,随着紧急暂停“熔断”,之后开始进入了修复行情,二季度投资者信心逐步恢复,上涨的板块比较分散,从券商,计算机,军工到白酒,均缺乏一个持续的领涨板块。整体股票市场整体的情况是存量资金博弈的情况,进入三季度后市场进入均衡市,一方面,资产价格不断升高,从 110 亿“地王”,到 10 年期国债到 2.7,股市再次成为估值相对低的资产,外加“国家队”维稳平抑波动,大幅下跌的动力不足。 另一方面,政策以稳为主,缺乏新增资金,做空筹码依然存在,去年入市亏损资金,IPO加快,要解禁的限售股都使股票上涨动力缺乏。四季度,在政府出房地产政策后,A股相对于楼市,大宗商品性价比高,资金回流A股的资产再配置的逻辑扩散,股市上涨。之后进入 12 月中央经济会议把政策基调弱化增长目标,强调改革与防风险,货币政策更加强调不会宽松,市场形成流动性的拐点的预期而回调。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,在震荡市场环境中及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内,原信诚中证基建工程指数分级证券投资基金(2016/1/1 至 2016/7/26)基金份额净值增长率为 2.83%,同期业绩比较基准收益率为-20.24%,基金超越业绩比较基准 23.07%。信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)(2016/7/27 至 2016/12/31)基金份额净值增长率为 17.52%,同期业绩比较基准收益率为 19.79%,基金落后业绩比较基准 2.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年,对市场判断为行情整体震荡,核心风险因素从国内转向国外,流动性风险预期驱动全年走势,所以看好两类股票:第一,看好有抗通胀、有需求增量、符合中长期需求趋势的板块,例如消费结构升级,二胎、养老进程启动相关的消费、医疗行业值得关注,大众消费品则需要甄选提价能力显著的标的,特朗普的战略收缩可能为一路一带松绑,建筑、高铁乃至核电的出口局面都有望打开; 第二,由于绝对收益账户增多,账户的止损机制催生统计套利的交易机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度内,依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1、对公司规章制度体系不断补充和完善。

公司监察稽核部组织各业务部门对公司相关规章制度进行梳理补充和完善,主要包括投资、财务、风控、产品、人力资源、监察稽核等业务范畴。推进了公司规章制度建设,完善了公司规章制度体系。

2、开展各类合规监察工作。

监察稽核部严格遵照法律法规和公司制度,对基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况进行监督检查,防范内幕交易,防范不正当关联交易和利益输送,确保基金运作的独立性、公平性及合规性,维护基金份额持有人的合法权益。

3、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时将新颁布的监管法规传递给公司相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4、开展各类内外部审计工作,包括 4 次常规审计、12 项专项检查、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成多项自查工作等。

5、完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。
监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法规要求进行信息披露和公告,并按法律法规规定报监管机构备案。
6、牵头开展反洗钱的各项工作,进一步更新完善了反洗钱制度,按照相关规定将可疑交易报告及时上报中国反洗钱监测中心,根据中国人民银行通知要求组织开展反洗钱培训和宣传工作。
本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.根据基金合同的约定至 2016 年 7 月 26 日,本基金(包括信诚基建份额、信诚基建 A 份额、信诚基建 B 份额)不进行收益分配。
2.2016 年 7 月 27 日转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的收益分配原则如下:
(1)《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;
(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,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;登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

(3)每一基金份额享有同等分配权;
(4)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
(5)基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。
本基金于本期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

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,本基金自 2015 年 11 月 10 日起至 2016 年 11 月 9 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF) (以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 审计报告(转型后)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20082 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)(原信诚中证基建工程指数分级证券投资基金,以下简称“信诚中证基建工程指数基金(LOF)”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日

	的资产负债表、2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是信诚中证基建工程指数基金(LOF)的基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,上述信诚中证基建工程指数基金(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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,公允反映了信诚中证基建工程指数基金(LOF)2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞　　赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日

6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20099 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚中证基建工程指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的信诚中证基建工程指数分级证券投资基金(以下简称“信诚中证基建工程指数分级基金”)的财务报表,包括 2016 年 7 月 26 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是信诚中证基建工程指数分级基金的基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表

	金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,上述信诚中证基建工程指数分级基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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,公允反映了信诚中证基建工程指数分级基金 2016 年 7 月 26 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	薛竞	赵钰

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日

7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	20,586,201.50
结算备付金		602,779.43
存出保证金		60,793.85
交易性金融资产	7.4.7.2	181,803,005.70
其中：股票投资		181,803,005.70

基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	3,193.27
应收股利		-
应收申购款		11,634,362.93
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	0.00
资产总计		214,690,336.68
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 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		-
应付赎回款		1,116,324.71
应付管理人报酬		152,572.23
应付托管费		33,565.91
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	198,193.47
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	434,207.06
负债合计		1,934,863.38
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	176,816,555.68
未分配利润	7.4.7.10	35,938,917.62
所有者权益合计		212,755,473.30
负债和所有者权益总计		214,690,336.68

注：1、截止本报告期末,基金份额净值为 1.194 元,基金份额总额 178,200,138.19 份.

7.2 利润表

会计主体：信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期

		2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-2,637,164.06
1.利息收入		16,534.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,530.18
债券利息收入		3.85
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）		-897,779.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-901,670.28
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	4,231.46
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-340.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,977,936.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	222,017.18
减：二、费用		865,213.49
1．管理人报酬		241,854.45
2．托管费		53,207.97
3．销售服务费		-
4．交易费用	7.4.7.19	274,785.37
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．其他费用	7.4.7.20	295,365.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,502,377.55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,502,377.55

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 27 日至 2016 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）	10,282,562.98	247,418.64	10,529,981.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-3,502,377.55	-3,502,377.55

润）			
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）	166,533,992.70	39,193,876.53	205,727,869.23
其中：1.基金申购款	313,545,570.20	70,863,585.12	384,409,155.32
2.基金赎回款	-147,011,577.50	-31,669,708.59	-178,681,286.09
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）	176,816,555.68	35,938,917.62	212,755,473.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

吕涛　　陈逸辛　　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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中证基建工程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”)《关于准予信诚中证基建工程指数分级证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]892 号文)和《关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金备案确认的函》(机构部函[2015]2311 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《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 8 月 6 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 7 月 6 日至 2015 年 7 月 17 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 220,740,720.41 元,利息人民币 49,170.41 元,共计人民币 220,789,890.82 元。上述认购资金折合 220,789,890.82 份基金份额。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2015)第 993 号验资报告。

本基金管理人于 2016 年 7 月 28 日发布《信诚基金管理有限公司关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》,信诚中证基建工程指数分级证券投资基金分级份额终止运作转换已于 2016 年 7 月 27 日完成,、信诚中证基建工程指数分级证券投资基金已于 2016 年 7 月 26 日开始暂停办理申购、赎回、定期定额投资、转换、转托管业务,自 2016 年 7 月 27 日起,信诚中证基建工程指数分级证券投资基金正式变更为信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)(基金代码为“165525”,场内简称为“基建工程”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金基金合同》和《信诚中证基建工程指数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具有良好流动性的金融工具,包括中证基建工程指数的成份股、备选成份股、债券、债券回购、中期票据、银行存款、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)。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。

基金的投资组合比例为: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%,投资于中证基建工

程指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;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。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准为:95%×中证基建工程指数收益率+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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,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 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.3.1 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(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。

7.4.6 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	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	基金管理人出资成立的子公司

7.4.7 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 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本年度未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.1.1 应支付关联方的佣金

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	241,854.45
其中：支付销售机构的客户维护费	109,575.40

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	53,207.97

注：支付基金托管人中国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。

7.4.3.2.3 销售服务费

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 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 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日
2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动的份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其它关联方在本年末未持有本基金。

7.4.3.5 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 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	20,586,201.50	15,076.96

注：本基金通过“中国银行基金托管结算资金转用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币 602,779.43 元。(上年度末余额:人民币 35,245.68 元)

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度,在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.4 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

7.4.4.2 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
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大资产重组	23.08	2017-01-06	19.60	18,400	382,953.16	424,672.00	-

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

7.4.5 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 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：信诚中证基建工程指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 7 月 26 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 7 月 26 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	949,883.48	21,289,625.35
结算备付金		35,245.68	95,238.10
存出保证金		31,708.46	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,862,389.97	-
其中：股票投资		9,862,389.97	-
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,207.24	18,618.16
应收股利		-	-
应收申购款		299.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		10,880,734.53	41,403,481.61
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 7 月 26 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		938.99	984.45
应付管理人报酬		15,791.57	35,607.80
应付托管费		3,474.15	7,833.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	25,642.10	-
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	304,906.10	260,003.71
负债合计		350,752.91	304,429.70
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	10,282,562.98	41,254,228.91
未分配利润	7.4.7.10	247,418.64	-155,177.00
所有者权益合计		10,529,981.62	41,099,051.91
负债和所有者权益总计		10,880,734.53	41,403,481.61

注：报告截止日 2016 年 7 月 26 日(基金合同失效前日)，信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之基础份额净值为 1.016 元，信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之信诚基建工程 A 份额净值为 1.013 元，信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之信诚基建工程 B 份额净值为 0.987 元；基金份额总额为 10,361,569.94 份，其中信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之基础份额为 10,311,542.94 份，信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之信诚基建工程 A 份额为 25,013.00 份，信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之信诚基建工程

B 份额为 25,014.00 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚中证基建工程指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		2,386,662.37	535,804.50
1.利息收入		63,727.75	310,738.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,311.97	197,178.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,415.78	113,560.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,733,280.54	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,392,845.85	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	340,434.69	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	538,763.64	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	50,890.44	225,065.69
减：二、费用		688,272.05	684,462.47
1．管理人报酬		190,990.90	303,355.08
2．托管费		42,018.06	66,738.16
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	97,650.62	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	7.4.7.20	357,612.47	314,369.23

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,698,390.32	-148,657.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,698,390.32	-148,657.97

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 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）	41,254,228.91	-155,177.00	41,099,051.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,698,390.32	1,698,390.32
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）	-30,971,665.93	-1,295,794.68	-32,267,460.61
其中：1.基金申购款	8,149,136.18	294,692.95	8,443,829.13
2.基金赎回款	-39,120,802.11	-1,590,487.63	-40,711,289.74
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）	10,282,562.98	247,418.64	10,529,981.62
项目	**上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 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）	220,789,890.82	-	220,789,890.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-148,657.97	-148,657.97
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）	-179,535,661.91	-6,519.03	-179,542,180.94
其中：1.基金申购款	510,147.32	162.13	510,309.45
2.基金赎回款	-180,045,809.23	-6,681.16	-180,052,490.39
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）	41,254,228.91	-155,177.00	41,099,051.91

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告财务报表起始至 财务报表结束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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中证基建工程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”)《关于准予信诚中证基建工程指数分级证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]892 号文)和《关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金备案确认的函》(机构部函[2015]2311 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《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 8 月 6 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 7 月 6 日至 2015 年 7 月 17 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 220,740,720.41 元,利息人民币 49,170.41 元,共计人民币 220,789,890.82 元。上述认购资金折合 220,789,890.82 份基金份额。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2015)第 993 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、《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证基建工程指数分级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具有良好流动性的金融工具,包括中证基建工程指数的成份股、备选成份股、债券、债券回购、中期票据、银行存款、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)。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。

基金的投资组合比例为: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%,投资于中证基建工程指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;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。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较标准为: 95%×中证基建工程指数收益率+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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,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 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.3.1 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(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。

7.4.5 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	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	基金管理人出资成立的子公司

7.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
-	-	-	-	-

本基金在本年度未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.6.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.6.1.3 **债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.6.1.4 应收黄金合约拆借孳息**债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.6.1.5 **应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.6.2 关联方报酬

7.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	190,990.90	303,355.08
其中：支付销售机构的客户维护费	30,204.27	69,114.92

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

7.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,018.06	66,738.16

注: 支付基金托管人中国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:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

本基金在本年度未与关联方通过银行间同行业市场进行债券(含回购)交易

7.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

信诚中证基建工程指数分级

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）持有的基金份额	20,017,900.00	20,017,900.00
报告期初持有的基金份额	20,185,457.51	-
报告期间申购/买入总份额	-	167,557.51
报告期间因拆分变动的份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	20,185,457.51	-
报告期末持有的基金份额	-	20,185,457.51
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	48.52%

注：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。

信诚中证基建工程指数分级 A

份额单位：份

项目	本期 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动的份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

信诚中证基建工程指数分级 B

份额单位：份

项目	本期 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
2016 年 7 月 27 日(基金合同生效日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动的份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.6.4.2 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

信诚中证基建工程指数分级 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-

信诚中证基建工程指数分级 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-

7.4.6.5 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 7 月 26 日		上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日) 至 2015 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
中国银行	949,883.48	32,116.39	21,289,625.35	196,284.71

注:本基金通过“中国中国银行基金托管结算资金转用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币 35,245.68 元。(上年度期末余额为人民币 35,245.68 元。)

7.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-

本基金在本年度,在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.7 期末（报告期间结束日期）本基金持有的流通受限证券

7.4.7.1 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

7.4.7.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.7.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券类别	证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

7.4.7.2 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
601789	宁波建工	2016-07-12	重大事项停牌	6.14	2016-10-27	6.75	40,800	182,104.48	250,512.00	-
600528	中铁二局	2016-07-22	重大资产置换	12.02	2016-08-01	11.85	14,700	190,949.61	176,694.00	-
600545	新疆城建	2016-05-31	重大事项停牌	7.54	2016-11-18	7.55	40,200	295,557.90	303,108.00	-
002469	三维工程	2016-05-10	重大事项停牌	11.21	2016-08-02	8.11	29,850	223,474.44	334,618.50	-

7.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

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
-	-	-	-	-	-

于本报告期末,本基金未持有因正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

7.4.8 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

8 投资组合报告(转型后)

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	181,803,005.70	84.68
	其中：股票	181,803,005.70	84.68
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	21,188,980.93	9.87
7	其他各项资产	11,698,350.05	5.45
8	合计	214,690,336.68	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,030,056.93	0.48
C	制造业	2,392,201.45	1.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	177,760,179.32	83.55
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	620,568.00	0.29
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	181,803,005.70	85.45

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有沪港通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601390	中国中铁	2,078,000	18,411,080.00	8.65
2	601668	中国建筑	1,996,400	17,688,104.00	8.31
3	601186	中国铁建	1,474,592	17,636,120.32	8.29
4	601669	中国电建	1,322,400	9,600,624.00	4.51
5	600068	葛洲坝	885,400	8,136,826.00	3.82
6	601800	中国交建	489,400	7,433,986.00	3.49
7	601618	中国中冶	1,561,200	7,275,192.00	3.42
8	600820	隧道股份	604,500	6,655,545.00	3.13
9	600170	上海建工	1,142,740	5,405,160.20	2.54
10	002081	金 螳 螂	507,700	4,970,383.00	2.34
11	002310	东方园林	343,200	4,856,280.00	2.28
12	601117	中国化学	632,300	4,280,671.00	2.01
13	000961	中南建设	356,600	3,708,640.00	1.74
14	600528	中铁二局	233,800	3,217,088.00	1.51
15	600502	安徽水利	289,750	2,891,705.00	1.36
16	601611	中国核建	168,200	2,891,358.00	1.36
17	600039	四川路桥	580,600	2,752,044.00	1.29
18	002375	亚厦股份	257,700	2,726,466.00	1.28
19	002051	中工国际	118,920	2,725,646.40	1.28
20	002047	宝鹰股份	283,400	2,649,790.00	1.25
21	300197	铁汉生态	194,890	2,471,205.20	1.16
22	002431	棕榈股份	264,507	2,422,884.12	1.14
23	600970	中材国际	337,405	2,392,201.45	1.12
24	600284	浦东建设	170,000	2,242,300.00	1.05
25	600491	龙元建设	193,600	2,234,144.00	1.05
26	002325	洪涛股份	269,700	2,160,297.00	1.02

27	600545	新疆城建	173,300	2,107,328.00	0.99
28	000928	中钢国际	112,000	1,963,360.00	0.92
29	300355	蒙草生态	192,800	1,933,784.00	0.91
30	000090	天健集团	191,995	1,854,671.70	0.87
31	002482	广田集团	198,800	1,838,900.00	0.86
32	300237	美晨科技	103,500	1,726,380.00	0.81
33	600477	杭萧钢构	169,450	1,702,972.50	0.80
34	600496	精工钢构	387,300	1,657,644.00	0.78
35	601886	江河集团	148,000	1,576,200.00	0.74
36	600846	同济科技	160,200	1,475,442.00	0.69
37	002323	雅百特	95,600	1,447,384.00	0.68
38	300506	名家汇	28,900	1,396,159.00	0.66
39	002717	岭南园林	52,500	1,363,950.00	0.64
40	002504	弘高创意	164,406	1,300,451.46	0.61
41	002586	围海股份	116,700	1,177,503.00	0.55
42	000498	山东路桥	143,669	1,139,295.17	0.54
43	600326	西藏天路	128,100	1,083,726.00	0.51
44	603979	金诚信	57,771	1,030,056.93	0.48
45	000018	神州长城	92,100	985,470.00	0.46
46	002775	文科园林	39,800	897,092.00	0.42
47	002135	东南网架	109,600	797,888.00	0.38
48	603959	百利科技	21,600	620,568.00	0.29
49	002781	奇信股份	14,461	466,367.25	0.22
50	002659	中泰桥梁	18,400	424,672.00	0.20

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	601668	中国建筑	21,199,998.00	201.33
2	601390	中国中铁	19,387,400.71	184.12
3	601186	中国铁建	18,120,378.28	172.08
4	601669	中国电建	10,400,496.00	98.77
5	600068	葛洲坝	8,800,380.03	83.57
6	601618	中国中冶	8,149,637.00	77.39
7	601800	中国交建	7,725,874.10	73.37
8	600820	隧道股份	6,512,682.75	61.85
9	002081	金螳螂	6,209,293.00	58.97
10	600170	上海建工	5,627,127.00	53.44
11	002310	东方园林	4,916,763.00	46.69
12	601117	中国化学	4,347,915.00	41.29

13	002051	中工国际	3,886,207.43	36.91
14	002047	宝鹰股份	3,575,390.81	33.95
15	600528	中铁二局	3,530,592.56	33.53
16	000961	中南建设	3,501,250.00	33.25
17	300055	万邦达	3,140,071.20	29.82
18	002375	亚厦股份	3,053,713.00	29.00
19	600039	四川路桥	2,938,647.98	27.91
20	601611	中国核建	2,922,995.00	27.76
21	600502	安徽水利	2,906,765.07	27.60
22	600970	中材国际	2,749,868.42	26.11
23	600846	同济科技	2,737,416.00	26.00
24	002325	洪涛股份	2,670,348.90	25.36
25	002431	棕榈股份	2,616,834.52	24.85
26	300197	铁汉生态	2,542,889.40	24.15
27	600491	龙元建设	2,481,169.00	23.56
28	600284	浦东建设	2,097,880.32	19.92
29	000090	天健集团	1,990,360.60	18.90
30	000928	中钢国际	1,983,075.00	18.83
31	300355	蒙草生态	1,946,366.00	18.48
32	600545	新疆城建	1,932,909.00	18.36
33	600477	杭萧钢构	1,878,948.20	17.84
34	600496	精工钢构	1,868,897.00	17.75
35	002482	广田集团	1,862,038.00	17.68
36	601886	江河集团	1,833,060.00	17.41
37	300237	美晨科技	1,726,818.00	16.40
38	300506	名家汇	1,545,286.00	14.68
39	002504	弘高创意	1,523,687.63	14.47
40	002717	岭南园林	1,507,577.00	14.32
41	002323	雅百特	1,405,863.00	13.35
42	002586	围海股份	1,266,412.21	12.03
43	600326	西藏天路	1,237,732.00	11.75
44	000498	山东路桥	1,201,258.17	11.41
45	603979	金诚信	1,145,589.20	10.88
46	002775	文科园林	997,792.60	9.48
47	000018	神州长城	991,140.00	9.41
48	002135	东南网架	922,483.11	8.76
49	600133	东湖高新	804,819.35	7.64
50	000065	北方国际	785,914.00	7.46
51	002542	中化岩土	764,449.00	7.26
52	603959	百利科技	676,086.00	6.42
53	002469	三维工程	664,943.00	6.31

54	002781	奇信股份	636,141.86	6.04
55	002060	粤 水 电	615,601.00	5.85
56	002062	宏润建设	582,652.04	5.53
57	601226	华电重工	564,556.50	5.36
58	002307	北新路桥	555,660.88	5.28
59	601789	宁波建工	542,662.00	5.15
60	002659	中泰桥梁	329,112.00	3.13

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	601668	中国建筑	4,283,346.41	40.68
2	300055	万邦达	3,113,297.00	29.57
3	601390	中国中铁	1,451,733.00	13.79
4	601186	中国铁建	1,314,401.83	12.48
5	600846	同济科技	1,203,389.00	11.43
6	600068	葛洲坝	1,151,765.00	10.94
7	002051	中工国际	1,120,459.00	10.64
8	601669	中国电建	1,044,214.15	9.92
9	601618	中国中冶	899,704.00	8.54
10	002469	三维工程	897,770.50	8.53
11	000065	北方国际	840,095.50	7.98
12	600133	东湖高新	828,511.44	7.87
13	002542	中化岩土	808,494.00	7.68
14	601800	中国交建	777,527.00	7.38
15	601789	宁波建工	757,929.00	7.20
16	002081	金 螳 螂	723,500.00	6.87
17	002060	粤 水 电	659,199.00	6.26
18	601226	华电重工	606,699.50	5.76
19	002062	宏润建设	591,012.60	5.61
20	002307	北新路桥	581,544.00	5.52
21	600820	隧道股份	568,267.00	5.40
22	601117	中国化学	499,191.00	4.74

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	207,039,874.83
卖出股票收入（成交）总额	32,219,652.57

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。

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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（元）	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)			-		
股指期货投资本期收益(元)			-		
股指期货投资本期公允价值变动(元)			-		

本基金本报告期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

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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)			-		
国债期货投资本期收益(元)			-		
国债期货投资本期公允价值变动(元)			-		

本基金本报告期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

中国冶金科工股份有限公司于 2016 年 4 月 12 日接到上海证券交易所的通报批评(纪律处分决定书〔2016〕号)。因公司未按分阶段披露原则披露重大事项,公司股票长期停牌理由不充分,重要公告的信息披露内容缺乏事实基础等行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》。上海证券交易所做出如下纪律处分决定:对中国冶金科工股份有限公司、董事会秘书予以通报批评。

对中国中冶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,该处罚事项未对中国中冶的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外, 信诚基建工程是指数型基金,对于中国中冶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。

8.12.1 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,793.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,193.27
5	应收申购款	11,634,362.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,698,350.05

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的股票。

8.12.4 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 投资组合报告(转型前)

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	9,862,389.97	90.64
	其中：股票	9,862,389.97	90.64
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	985,129.16	9.05
7	其他各项资产	33,215.40	0.31
8	合计	10,880,734.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	53,580.26	0.51
C	制造业	147,340.00	1.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,260,351.21	87.94
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	401,118.50	3.81
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	9,862,389.97	93.66

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有沪港通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	164,800	916,288.00	8.70
2	601390	中国中铁	112,800	781,704.00	7.42
3	601186	中国铁建	69,692	627,228.00	5.96
4	601669	中国电建	83,300	488,138.00	4.64
5	601618	中国中冶	98,300	378,455.00	3.59
6	600068	葛洲坝	55,700	362,050.00	3.44
7	002469	三维工程	29,850	334,618.50	3.18
8	601800	中国交建	30,800	333,256.00	3.16
9	002081	金螳螂	32,000	331,520.00	3.15
10	600545	新疆城建	40,200	303,108.00	2.88
11	600820	隧道股份	31,700	284,666.00	2.70
12	600477	杭萧钢构	36,250	266,437.50	2.53
13	601789	宁波建工	40,800	250,512.00	2.38

14	600170	上海建工	57,440	229,760.00	2.18
15	601117	中国化学	39,800	226,064.00	2.15
16	300055	万邦达	12,200	222,650.00	2.11
17	002051	中工国际	9,320	193,576.40	1.84
18	002047	宝鹰股份	17,800	189,926.00	1.80
19	600528	中铁二局	14,700	176,694.00	1.68
20	002325	洪涛股份	16,980	174,894.00	1.66
21	000961	中南建设	22,500	172,575.00	1.64
22	002375	亚厦股份	13,500	156,870.00	1.49
23	600970	中材国际	21,200	147,340.00	1.40
24	600039	四川路桥	36,600	145,668.00	1.38
25	600284	浦东建设	11,200	125,552.00	1.19
26	600502	安徽水利	14,550	125,421.00	1.19
27	300197	铁汉生态	8,170	115,197.00	1.09
28	600846	同济科技	10,100	112,615.00	1.07
29	000090	天健集团	12,095	111,636.85	1.06
30	600491	龙元建设	12,700	108,839.00	1.03
31	600496	精工钢构	24,400	107,604.00	1.02
32	601886	江河集团	9,300	106,485.00	1.01
33	002482	广田集团	12,500	98,750.00	0.94
34	002504	弘高创意	8,406	91,709.46	0.87
35	000928	中钢国际	6,500	89,310.00	0.85
36	002659	中泰桥梁	4,400	88,528.00	0.84
37	002542	中化岩土	10,600	85,860.00	0.82
38	600133	东湖高新	10,200	82,314.00	0.78
39	000065	北方国际	2,200	72,424.00	0.69
40	600326	西藏天路	8,100	72,414.00	0.69
41	002586	围海股份	7,300	70,153.00	0.67
42	601226	华电重工	7,000	66,500.00	0.63
43	002060	粤水电	8,500	61,200.00	0.58
44	000498	山东路桥	9,000	59,040.00	0.56
45	002062	宏润建设	8,920	58,872.00	0.56
46	002135	东南网架	6,900	56,235.00	0.53
47	002307	北新路桥	6,700	55,744.00	0.53
48	603979	金诚信	2,671	53,580.26	0.51
49	000018	神州长城	4,300	50,396.00	0.48
50	002781	奇信股份	900	42,012.00	0.40

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	601668	中国建筑	3,941,194.00	9.59
2	601390	中国中铁	3,527,267.00	8.58
3	601186	中国铁建	3,059,914.24	7.45
4	601669	中国电建	2,304,199.99	5.61
5	601618	中国中冶	1,722,929.00	4.19
6	601800	中国交建	1,455,781.00	3.54
7	600068	葛洲坝	1,348,677.00	3.28
8	002081	金螳螂	1,122,039.00	2.73
9	600820	隧道股份	1,106,081.00	2.69
10	601117	中国化学	978,044.00	2.38
11	600170	上海建工	916,539.00	2.23
12	600528	中铁二局	846,374.00	2.06
13	300055	万邦达	802,323.27	1.95
14	002051	中工国际	750,920.88	1.83
15	002047	宝鹰股份	689,905.00	1.68
16	002325	洪涛股份	666,363.00	1.62
17	002375	亚厦股份	638,524.00	1.55
18	600039	四川路桥	620,782.00	1.51
19	600970	中材国际	607,678.00	1.48
20	000961	中南建设	593,688.00	1.44

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	601668	中国建筑	3,285,428.00	7.99
2	601390	中国中铁	2,493,376.00	6.07
3	601186	中国铁建	2,441,095.00	5.94
4	601669	中国电建	1,699,487.00	4.14
5	601618	中国中冶	1,346,195.00	3.28
6	600068	葛洲坝	1,199,609.00	2.92
7	601800	中国交建	1,148,537.00	2.79
8	002081	金 螳 螂	1,008,903.48	2.45
9	600820	隧道股份	949,695.01	2.31
10	601117	中国化学	784,404.00	1.91
11	600170	上海建工	698,299.40	1.70
12	300055	万邦达	672,866.68	1.64
13	600528	中铁二局	621,395.00	1.51
14	002051	中工国际	595,185.00	1.45
15	002047	宝鹰股份	592,675.00	1.44
16	002375	亚厦股份	550,632.00	1.34

17	002325	洪涛股份	540,283.00	1.31
18	600970	中材国际	502,747.00	1.22
19	600039	四川路桥	495,929.00	1.21
20	000961	中南建设	470,861.00	1.15

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	37,516,608.10
卖出股票收入（成交）总额	29,585,827.62

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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（元）	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

本基金本报告期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

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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 中国冶金科工股份有限公司于 2016 年 4 月 12 日接到上海证券交易所的通报批评(纪律处分决定书〔2016〕号)。因公司未按分阶段披露原则披露重大事项,公司股票长期停牌理由不充分,重要公告的信息披露内容缺乏事实基础等行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》。上海证券交易所做出如下纪律处分决定:对中国冶金科工股份有限公司、董事会秘书予以通报批评。

8.12.2 对中国中冶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

事项未对中国中冶的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外，信诚基建工程是指数型基金,对于中国中冶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。

8.12.3 除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

8.12.5 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,708.46
2	应收利息	1,207.24
3	应收申购款	299.70
4	合计	33,215.40

8.12.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.7 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600545	新疆城建	303,108.00	2.88	筹划重大事项

8.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

9 基金份额持有人信息(转型后)

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
9,932	17,942.02	2,340,997.23	1.31%	175,859,140.96	98.69%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例

1	卢锡根	4,162,364.70	2.34%
2	刘青霞	2,317,059.21	1.30%
3	秦泰	2,024,368.62	1.14%
4	马锦章	1,699,499.58	0.95%
5	赵敏	1,660,330.58	0.93%
6	殷敏	1,602,413.70	0.90%
7	彭奉杨	1,531,649.03	0.86%
8	周代群	1,248,126.56	0.70%
9	张红梅	1,056,123.23	0.59%
10	王芳莲	950,522.63	0.53%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	149,056.79	0.08%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10～ 50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 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
信诚中证基建工程指数分级 A	8	3,126.63	-	-	25,013.00	100.00%
信诚中证基建工程指数分级 B	8	3,126.75	-	-	25,014.00	100.00%
信诚中证基建工程指数分级	581	17747.92			10311542.9	100.00%
合计	597	17,356.06	-	-	10,361,569.90	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证基建工程指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩谦元	25,005.00	99.97%
2	冯斌	2.00	0.01%
3	叶庆福	1.00	0.00%
4	李衡	1.00	0.00%
5	石海辉	1.00	0.00%
6	李小彬	1.00	0.00%
7	黄友清	1.00	0.00%
8	吕镒婷	1.00	0.00%

信诚中证基建工程指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩谦元	25,005.00	99.96%
2	吕镒婷	2.00	0.01%
3	黄友清	1.00	0.01%
4	程贯西	1.00	0.00%
5	黄钰林	1.00	0.00%
6	冯斌	1.00	0.00%
7	张嘉沛	1.00	0.00%
8	孔祥苓	1.00	0.00%

信诚中证基建工程

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	林彩虹	2,016,838.00	19.56%
2	曾效良	1,008,224.17	9.78%
3	宾容	772,652.16	7.49%
4	唐锚	501,699.50	4.87%
5	林家荣	490,677.00	4.76%
6	林玉群	390,060.00	3.78%
7	吕涛	300,137.46	2.91%
8	冯刚	200,264.08	1.94%
9	李英杰	200,146.09	1.94%
10	王宇	200,082.57	1.94%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目		持有份额总数（份）	占基金总份额

			比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信诚中证基建工程指数分级 A	-	-
	信诚中证基建工程指数分级 B	-	-
	信诚中证基建工程指数分级	457,197.48	4.41%
	合计	457,197.48	4.41%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	信诚中证基建工程指数分级 A	-
	信诚中证基建工程指数分级 B	-
	信诚中证基建工程指数分级	10～ 50
	合计：	-
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚中证基建工程指数分级 A	-
	信诚中证基建工程指数分级 B	-
	信诚中证基建工程指数分级	
	合计	-

10 开放式基金份额变动

10.1 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日(2016 年 7 月 27 日)基金份额总额	10,361,569.94
本报告期期初基金份额总额	10,361,569.94
本报告期基金总申购份额	316,007,861.35
减：本报告期基金总赎回份额	148,169,293.10

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	178,200,138.19

10.1 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	信诚中证基建工程指数分级 A	信诚中证基建工程指数分级 B	信诚中证基建工程指数分级
基金合同生效日(2015 年 8 月 27 日)基金份额总额	23,321,580.00	23,321,581.00	174,146,729.82
本报告期期初基金份额总额	1,845,135.00	1,845,136.00	37,909,179.09
本报告期基金总申购份额	-	-	8,217,140.77
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	39,455,020.92
本报告期基金拆分变动份额	-1,820,122.00	-1,820,122.00	3,640,244.00
本报告期期末基金份额总额	25,013.00	25,014.00	10,311,542.94

11 重大事件揭示

11.2 基金份额持有人大会决议

依据《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》、《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》,本基金自 2016 年 6 月 14 日起至 2016 年 7 月 8 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议并通过了《关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。自 2016 年 7 月 27 日起,信诚中证基建工程指数分级证券投资基金正式变更为信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)(基金代码为“165525”,场内简称为“基建工程”)。自 2016 年 7 月 27 日起,《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)托管协议》、《信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》生效,原《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金托管协议》、《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金招募说明书》将自同一日起失效。有关信诚中证基建工程指数分级证券投资基金转型为信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)的基金份额转换业务详情可参阅本基金管理人于 2016 年 7 月 12 日发布的《信诚基金管理有限公司关于信诚中证基建工程指数分级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》。

11.3 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:

经信诚基金管理有限公司董事会审议通过,隋晓炜先生专职担任中信信诚资产管理有限公司总经理,不再兼任信诚基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已于 2017 年 1 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会、中国证券监督管理委员会上海证监局报备。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月,郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.4 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。

11.5 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.6 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普华永道中天会计师事务所的报酬为人民币 60,000 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。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.8.1 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	1	164,304,391.75	68.67%	153,015.66	69.14%	-
国信证券	1	33,806,051.07	14.13%	30,807.86	13.92%	-
招商证券	2	21,025,846.98	8.79%	19,161.07	8.66%	-
安信证券	1	20,123,237.60	8.41%	18,338.20	8.29%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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

11.8.2 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	
	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
中信证券	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
安信证券	21,135.31	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-

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

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.8.3 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

		股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中信证券	1	47,951,587.45	71.46%	44,656.91	71.90%	-
浙商证券	1	9,695,627.60	14.45%	8,835.71	14.23%	-
招商证券	2	9,455,220.67	14.09%	8,616.89	13.87%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

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

11.8.4 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	
	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
中信证券	-	-	20,000,000.00	100.00%
浙商证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-

大通证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-

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

12 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
2017 年 3 月 31 日