

## 信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 28 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 2017 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	信诚盛世蓝筹混合
基金主代码	550003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 4 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	409,514,085.71 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司，追求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为混合型基金，其战略性资产配置以股票为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整，以规避市场风险。
业绩比较基准	中信标普 50 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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	tianqingl.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(2017年1月1日至2017年6月30日)
本期已实现收益	25,263,763.06
本期利润	90,620,882.22
加权平均基金份额本期利润	0.3319
本期基金份额净值增长率	16.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.1499
期末基金资产净值	940,971,946.55
期末基金份额净值	2.298

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。

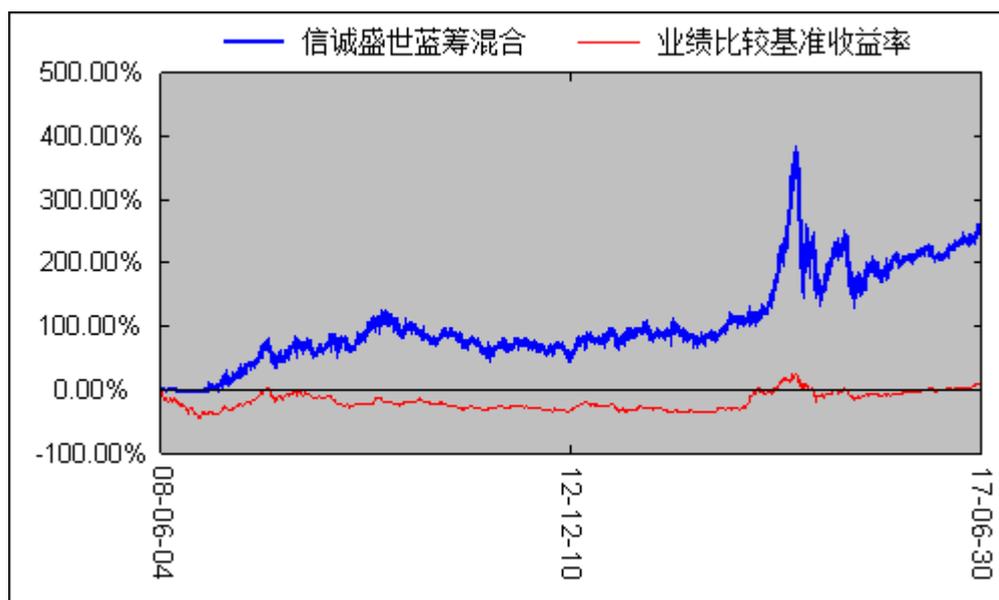
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	5.27%	0.61%	4.59%	0.70%	0.68%	-0.09%
过去三个月	8.19%	0.55%	9.91%	0.60%	-1.72%	-0.05%
过去六个月	16.64%	0.50%	14.59%	0.52%	2.05%	-0.02%
过去一年	19.10%	0.61%	21.52%	0.55%	-2.42%	0.06%
过去三年	89.62%	1.89%	70.82%	1.40%	18.80%	0.49%
自基金合同生效起至今	259.88%	1.52%	12.10%	1.38%	247.78%	0.14%

#### 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:1、本基金建仓期自 2008 年 6 月 4 日至 2008 年 12 月 3 日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自 2015 年 10 月 1 日起, 本基金的业绩比较基准由“中信标普 50 指数收益率\*80%+中信全债指数收益率\*20%”变更为“中信标普 50 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%”。

## § 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 70 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、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昊	本基金基金经理，信诚新机遇混合基金（LOF）基金经理	2015年11月18日	-	10	经济学硕士，CFA。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司，担任助理研究员。2010年11月加入信诚基金管理有限公司，担任研究员。现任信诚盛世蓝筹混合基金、信诚新机遇混合基金（LOF）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《信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

整体公平交易制度执行情况良好,未发现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

2017 年初我国经济运行总体好于市场预期,A 股市场稳步向上,但随着市场利率水平持续上行以及资本市场监管趋严,上证综指在尝试突破 3300 点未果后出现较大幅度调整,市场风险偏好快速下降;5 月中下旬随着国内市场利率预期见顶,人民币相对美元持续升值,以及监管层对于资本市场的相关政策进一步完善,市场风险偏好得到修复,A 股市场持续回升。2017 年上半年,上证综指上涨 2.9%,沪深 300 指数上涨 10.8%,中小板指上涨 7.3%,创业板指下跌 7.3%;市场结构化差异显著,权重股表现好于小盘股、价值股表现好于成长股,其中表现较好的板块有保险、家用电器、食品饮料、银行和电子等,而表现较差的板块是农林牧渔、纺织服装、传媒、商业贸易和国防军工等。

本基金在 2017 年一季度重点配置了银行、家电、医药等板块,二季度重点增持保险、券商、新能源汽车、白酒等板块,取得了我们的预期收益率,上半年业绩跑赢了基准。我们会总结经验教训,进一步完善投资分析框架,自上而下寻找成功概率高的投资方向,争取在未来的投资中,给投资者带来相对稳定的长期收益。

#### 4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 16.64%,同期业绩比较基准收益率为 14.59%,基金超越业绩比较基准 2.05%。

### 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 2017 年下半年,国内经济显示出了非常强的韧性,房地产销售在四季度可能迎来去年限购政策启动带来的低基数,汽车去库存接近尾声并将迎来下半年旺季,对于 PPP 的政策规范也使得政府未来在基建投资有更充裕的施展空间,我们预计经济总体运行平稳,GDP 增速较上半年小幅回落。

年初以来随着金融体系监管加强,我们观察到市场利率上行,表外融资受到压缩,对资本市场形成一定冲击;对于下半年我们认为经济去杠杆仍会是长期趋势,但市场利率进一步上行空间有限,资金整体维持紧平衡。长期来看,国内机构资产端仍有配置权益类资产的长期需求,另一方面随着 A 股成功纳入 MSCI,我们预计 A 股的国际化将稳步推进,长期来看将有持续的海外资金流入配置 A 股资产;因此我们认为市场资金面长期乐观,但未来增量资金的风险偏好可能边际降低。

5 月中下旬以来市场风险偏好显著修复,但我们认为未来监管的方向不会发生变化,鼓励有价值的企业利用资本市场发展壮大、打击投机炒作会是长期趋势,因此推动市场长期上涨的动力仍是上市公司创造价值的能力,竞争力强、具备持续内生增长的优势企业将获得估值溢价。

目前 A 股估值整体水平较年初变化不大,但各类资产间的估值差异显著收敛,前期被低估的资产估值得到修复,而相对高估的资产估值得到调整,各类资产的估值水平进一步趋于合理,被低估的资产相对有限,因此我们认为长期来看,A 股市场未来的收益将更多的来自企业盈利的增长,估值修复的空间相对有限。

我们认为市场总体向下风险有限,而竞争力强的优势企业将获取大部分的经济增长,市场份额向龙头集中会是一个较长的趋势,我们将沿着消费升级和技术创新两条线索,着重寻找这类结构性的投资机会,积极挖掘能够长期跑赢整体经济的行业,并从中挑选定价合理的公司,为投资人赚取相对稳定的长期收益。

### 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。

基金管理人对其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

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记结算机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

3、本基金收益每年最多分配 12 次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 25%;

4、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;

5、本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

6、基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

7、基金当期收益应先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金于本报告期内进行过一次利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

本基金本报告期内的收益分配情况如下:

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2017/3/24	2017/3/24	5.29	518,536,475.37	13,262,418.14	531,798,893.51	
合计			5.29	518,536,475.37	13,262,418.14	531,798,893.51	

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 531,798,893.51 元。

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

本托管人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:信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日:2017年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款		146,039,862.89	22,710,644.26
结算备付金		4,504,221.56	1,398,595.79
存出保证金		277,022.28	119,778.73
交易性金融资产		792,246,728.35	137,223,314.02
其中:股票投资		782,255,728.35	137,223,314.02
基金投资		-	-
债券投资		9,991,000.00	-
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		262,254.92	28,119,748.06
应收利息		313,996.08	10,274.08
应收股利		-	-
应收申购款		19,538.22	4,642.03
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		943,663,624.30	189,586,996.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		38,128.79	15,956.77
应付管理人报酬		985,447.33	248,749.24
应付托管费		164,241.21	41,458.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		835,208.12	423,083.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		668,652.30	640,019.42
负债合计		2,691,677.75	1,369,267.19
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		409,514,085.71	76,407,958.63
未分配利润		531,457,860.84	111,809,771.15
所有者权益合计		940,971,946.55	188,217,729.78
负债和所有者权益总计		943,663,624.30	189,586,996.97

注：截止本报告期末，基金份额净值 2.298 元，基金份额总额 409,514,085.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
<b>一、收入</b>		98,585,886.86	-17,006,551.59
1. 利息收入		2,015,497.19	172,803.74
其中：存款利息收入		499,880.86	172,803.74

债券利息收入		119,318.36	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,396,297.97	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,430,693.84	-20,889,824.73
其中：股票投资收益		26,414,790.17	-21,114,217.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,015,903.67	224,392.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		65,357,119.16	3,700,051.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,782,576.67	10,417.97
<b>减：二、费用</b>		7,965,004.64	3,173,648.85
1. 管理人报酬		4,541,393.48	1,358,679.28
2. 托管费		756,898.90	226,446.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,473,103.34	1,397,988.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		193,608.92	190,534.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,620,882.22	-20,180,200.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		90,620,882.22	-20,180,200.44

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	76,407,958.63	111,809,771.15	188,217,729.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,620,882.22	90,620,882.22
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）	333,106,127.08	860,826,100.98	1,193,932,228.06
其中：1. 基金申购款	1,009,361,985.34	1,623,304,640.52	2,632,666,625.86
2. 基金赎回款	-676,255,858.26	-762,478,539.54	-1,438,734,397.80
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）	-	-531,798,893.51	-531,798,893.51
五、期末所有者权益（基金净值）	409,514,085.71	531,457,860.84	940,971,946.55
项目	上年度可比期间 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）	80,212,211.92	134,024,952.61	214,237,164.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,180,200.44	-20,180,200.44
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）	546,202.38	223,749.88	769,952.26
其中：1. 基金申购款	6,825,355.41	8,240,415.44	15,065,770.85
2. 基金赎回款	-6,279,153.03	-8,016,665.56	-14,295,818.59
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）	80,758,414.30	114,068,502.05	194,826,916.35

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

基金管理人负责人

陈逸辛

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金(原“信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金”(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]315号文)和《关于信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2008]226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《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年6月4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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》的约定,经与基金托管人协商一致,自2015年8月3日起,本基金名称变更为“信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金”,基金类别变更为“混合型”,同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。

本基金于2008年4月10日至2008年5月30日募集,募集资金总额459,436,930.46元,募集期间认购手续费3,811,349.79元,利息转份额186,147.35元,募集规模为455,811,728.02份。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(2008)CR No. 0044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、《信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金基金合同》和《信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产60%-95%;债券、资产证券化产品与固定收益类资产0%-35%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证资产不超过基金资产净值的3%。本基金投资重点为蓝筹类上市公司股票,80%以上的股票基金资产属于上述投资方向所确定的内容。本基金的业绩比较基准为:中信标普50指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

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》、《信诚盛世蓝筹股票型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

本基金本报告期未发生会计差错。

### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投

资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)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。

(b)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

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

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品(含公开募集证券投资基金)过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为(以下称其他业务),继续按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额,未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至2017年6月30日,本基金没有计提有关增值税费用。

(d)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。

(e)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。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)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。

(h)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

###### 6.4.8.1.1 股票交易

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。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

###### 6.4.8.1.3 债券交易

###### 6.4.8.1.4 债券回购交易

###### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

##### 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 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,541,393.48	1,358,679.28
其中:支付销售机构的客户维护费	250,000.92	248,622.00

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1.5%的年费率每日计提,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×1.5%/当年天数。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	756,898.90	226,446.59

注:支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

###### 6.4.8.2.3 销售服务费

##### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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及上年度可比期间均未投资过本基金。

##### 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

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,本基金的其它关联方在本报告期末及上年度末未持有本基金。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	146,039,862.89	457,649.93	50,371,547.95	165,532.58

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2017年6月30日的相关余额为人民币4,504,221.56元。(2016年6月30日余额为440,195.28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证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.9 期末(2017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
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下新股申购未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下新股申购未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下新股申购未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下新股申购未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下新股申购未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新股申购未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下新股申购未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

## 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

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌股票等流通受限证券。

## 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	782,255,728.35	82.90
	其中：股票	782,255,728.35	82.90
2	固定收益投资	9,991,000.00	1.06
	其中：债券	9,991,000.00	1.06
	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	150,544,084.45	15.95
7	其他各项资产	872,811.50	0.09
8	合计	943,663,624.30	100.00

## 7.2 期末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	21,527,259.00	2.29
C	制造业	341,590,455.70	36.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,172,363.00	0.55
E	建筑业	71,311,498.52	7.58
F	批发和零售业	56,454,177.72	6.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,843,880.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	-
J	金融业	228,506,892.75	24.28
K	房地产业	26,992,028.04	2.87
L	租赁和商务服务业	3,588,608.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	1,755,456.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	16,024,588.00	1.70
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	7,480,882.00	0.80
S	综合	-	-
	合计	782,255,728.35	83.13

## 7.3 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

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	000651	格力电器	1,147,099	47,226,065.83	5.02
2	601607	上海医药	1,626,744	46,980,366.72	4.99
3	601398	工商银行	7,733,473	40,600,733.25	4.31

4	601288	农业银行	11,335,100	39,899,552.00	4.24
5	601988	中国银行	8,698,000	32,182,600.00	3.42
6	601211	国泰君安	1,376,500	28,232,015.00	3.00
7	601318	中国平安	566,400	28,099,104.00	2.99
8	002466	天齐锂业	510,144	27,726,326.40	2.95
9	000858	五粮液	418,768	23,308,626.88	2.48
10	600519	贵州茅台	49,000	23,120,650.00	2.46

#### 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	000651	格力电器	83,304,030.44	44.26
2	601398	工商银行	67,374,790.82	35.80
3	601288	农业银行	64,457,605.00	34.25
4	601607	上海医药	50,902,657.93	27.04
5	601988	中国银行	36,095,517.00	19.18
6	600104	上汽集团	30,819,699.56	16.37
7	601818	光大银行	28,524,074.00	15.15
8	600056	中国医药	27,309,147.49	14.51
9	300197	铁汉生态	26,502,064.70	14.08
10	600518	康美药业	26,490,205.69	14.07
11	601318	中国平安	26,253,765.00	13.95
12	601211	国泰君安	25,945,861.00	13.79
13	002310	东方园林	25,417,282.20	13.50
14	001979	招商蛇口	25,290,409.00	13.44
15	002466	天齐锂业	24,900,221.54	13.23
16	002217	合力泰	23,288,880.93	12.37
17	601117	中国化学	22,312,074.99	11.85
18	600036	招商银行	21,342,450.00	11.34
19	601601	中国太保	20,408,193.00	10.84
20	600519	贵州茅台	20,323,407.00	10.80
21	600109	国金证券	19,954,975.72	10.60
22	000776	广发证券	18,615,963.00	9.89
23	601688	华泰证券	18,448,260.43	9.80
24	000498	山东路桥	18,254,584.40	9.70
25	000858	五粮液	17,091,238.68	9.08
26	002475	立讯精密	16,258,076.88	8.64
27	600741	华域汽车	15,925,333.82	8.46
28	002415	海康威视	15,565,566.76	8.27
29	601328	交通银行	14,039,033.24	7.46

30	000568	泸州老窖	13,851,963.22	7.36
31	600089	特变电工	12,474,370.99	6.63
32	600201	生物股份	11,870,430.72	6.31
33	600196	复星医药	11,833,374.50	6.29
34	000538	云南白药	11,556,634.48	6.14
35	601899	紫金矿业	11,424,113.00	6.07
36	600376	首开股份	11,411,882.00	6.06
37	601699	潞安环能	11,293,406.75	6.00
38	600340	华夏幸福	11,246,618.00	5.98
39	300115	长盈精密	11,100,193.69	5.90
40	600887	伊利股份	10,550,528.00	5.61
41	002241	歌尔股份	10,259,322.75	5.45
42	000423	东阿阿胶	9,579,803.00	5.09
43	601668	中国建筑	9,545,050.00	5.07
44	600153	建发股份	8,906,224.00	4.73
45	600383	金地集团	8,588,762.70	4.56
46	000069	华侨城 A	8,542,890.00	4.54
47	600019	宝钢股份	8,442,254.40	4.49
48	002108	沧州明珠	8,183,425.17	4.35
49	002074	国轩高科	8,156,247.51	4.33
50	600742	一汽富维	8,129,539.68	4.32
51	000792	盐湖股份	7,990,769.44	4.25
52	300070	碧水源	7,777,776.00	4.13
53	600745	中茵股份	7,361,453.11	3.91
54	600373	中文传媒	7,298,486.00	3.88
55	600028	中国石化	7,174,581.54	3.81
56	002271	东方雨虹	6,831,563.47	3.63
57	600048	保利地产	6,063,952.00	3.22
58	000921	海信科龙	4,374,743.48	2.32
59	300219	鸿利智汇	4,290,481.00	2.28
60	603799	华友钴业	4,137,985.00	2.20
61	002812	创新股份	4,065,280.00	2.16
62	002332	仙琚制药	4,022,635.60	2.14
63	002242	九阳股份	3,945,171.42	2.10
64	002027	分众传媒	3,937,462.00	2.09
65	002035	华帝股份	3,920,131.15	2.08
66	600027	华电国际	3,839,478.00	2.04

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	000651	格力电器	50,393,365.60	26.77
2	600518	康美药业	31,351,771.43	16.66
3	601398	工商银行	31,351,768.94	16.66
4	601288	农业银行	30,432,968.00	16.17
5	600036	招商银行	21,260,410.00	11.30
6	601601	中国太保	20,996,814.20	11.16
7	600109	国金证券	20,663,808.32	10.98
8	600340	华夏幸福	18,226,896.94	9.68
9	002415	海康威视	16,191,866.00	8.60
10	601328	交通银行	15,813,046.00	8.40
11	600104	上汽集团	15,169,006.21	8.06
12	600376	首开股份	12,502,532.00	6.64
13	002241	歌尔股份	12,334,194.00	6.55
14	600201	生物股份	11,653,849.25	6.19
15	002475	立讯精密	10,257,886.31	5.45
16	600056	中国医药	9,796,556.46	5.20
17	601607	上海医药	9,610,463.00	5.11
18	300197	铁汉生态	8,746,283.74	4.65
19	000538	云南白药	8,686,759.00	4.62
20	000792	盐湖股份	8,521,813.00	4.53
21	601818	光大银行	8,061,146.43	4.28
22	002310	东方园林	7,969,157.73	4.23
23	601117	中国化学	7,965,390.00	4.23
24	002271	东方雨虹	7,690,832.15	4.09
25	001979	招商蛇口	7,154,220.15	3.80
26	600048	保利地产	6,740,984.00	3.58
27	300115	长盈精密	6,501,715.00	3.45
28	600741	华域汽车	5,486,146.00	2.91
29	600089	特变电工	5,209,708.00	2.77
30	601668	中国建筑	4,891,937.90	2.60
31	601318	中国平安	4,775,408.40	2.54
32	600000	浦发银行	4,622,024.00	2.46
33	002812	创新股份	4,556,365.70	2.42
34	601166	兴业银行	4,445,139.00	2.36
35	601988	中国银行	4,404,992.80	2.34
36	603799	华友钴业	4,145,807.00	2.20
37	000568	泸州老窖	4,069,146.00	2.16
38	002332	仙琚制药	4,001,594.08	2.13
39	600887	伊利股份	3,952,846.00	2.10
40	000887	中鼎股份	3,905,214.00	2.07
41	002217	合力泰	3,792,330.00	2.01

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	1,189,100,523.43
卖出股票收入（成交）总额	635,810,973.09

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

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	9,991,000.00	1.06
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,991,000.00	1.06

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041658059	16 广汇能源 CP002	100,000	9,991,000.00	1.06

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

### 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

### 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

本基金本报告期内未进行权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 国泰君安证券股份有限公司**于 2016 年 12 月 27 日发布《关于收到中国证券监督管理委员会行政监管措施事先告知书的公告》，因为存在以下违规行为：一是在推荐河北润农节水科技股份有限公司（简称企业）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、存货情况的核查不充分，内核机构履职的独立性存在缺陷；二是在持续督导参仙源参业股份有限公司（全国中小企业股份转让系统挂牌公司，简称企业）过程中，企业被立案稽查后，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》；三是在推荐新疆瑞兆源生态农业股份有限公司（简称企业）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。公司在开展推荐业务过程中存在多项违规行为，反映出内部控制制度存在一定缺陷。2017 年 1 月 20 日，国泰君安证券收到中国证监会责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的行政监管措施决定书。

2016 年 7 月 26 日，国泰君安证券收到上海证监局《关于对上海国泰君安证券资产管理有限公司采取责令增加内部合规检查次数的决定》，因公司作为国泰君安新利 6 号集合资产管理计划的资产管理人，投资决策和交易执行环节控制存在不足，在未对投资标的进行充分研究的基础上，根据委托人广州海运（集团）有限公司、中海集团财务有限公司以及中海集团投资有限公司的投资建议，买入“中海发展”（股票代码 600026）和“中海集运”（股票代码 601866），发生相关异常交易。上述行为反映出公司未能切实履行勤勉尽责的资产管理人义务，未能采取有效措施防范利益冲突，违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》（证监会令 93 号）第三条、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2013]28 号）第五十四条的相关规定。

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，上述处罚事项未对国泰君安证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响，并且估值水平已反映了行业和公司经营风险。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。

**7.12.2 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。**

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	277,022.28
2	应收证券清算款	262,254.92
3	应收股利	-
4	应收利息	313,996.08
5	应收申购款	19,538.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	872,811.50

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,704	42,200.54	329,393,769.02	80.44%	80,120,316.69	19.56%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	28,798.92	0.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月4日)基金份额总额	455,811,728.02
本报告期期初基金份额总额	76,407,958.63
本报告期基金总申购份额	1,009,361,985.34
减:本报告期基金总赎回份额	676,255,858.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	409,514,085.71

## § 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

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。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内基金投资策略无改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

为本基金进行审计的会计师事务所是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	
申银万国	1	791,293,167.01	43.56%	736,931.18	43.92%	-
平安证券	1	308,962,915.11	17.01%	281,557.62	16.78%	-
海通证券	1	200,629,944.39	11.05%	182,834.41	10.90%	-
安信证券	1	174,215,950.27	9.59%	158,763.01	9.46%	-
中银国际	1	173,476,989.71	9.55%	161,558.68	9.63%	-
国金证券	1	116,174,291.82	6.40%	108,192.80	6.45%	-
中信证券	1	28,391,890.29	1.56%	26,441.36	1.58%	-
联合证券	1	23,264,911.95	1.28%	21,666.51	1.29%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

2. 报告期内基金租用券商交易单元情况未发生变更。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	-	-	3,105,700,000.00	64.63%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	170,900,000.00	3.56%	-	-
国金证券	-	-	1,186,100,000.00	24.68%	-	-
中信证券	-	-	193,200,000.00	4.02%	-	-

联合证券	-	-	149,800,000.00	3.12%	-	-	
高华证券	-	-	-	-	-	-	
中信浙江	-	-	-	-	-	-	

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170419 至 20170628		75,728,511.93		75,728,511.93	18.49%
	2	20170322 至 20170326		454,372,964.79	430,000,000.00	24,372,964.79	5.95%
	3	20170317 至 20170322, 20170327 至 20170418		189,969,224.92	189,969,224.92		
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:

- (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
- (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
- (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

信诚基金管理有限公司  
2017 年 8 月 29 日