

信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11

6.2	利润表	12
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4	报表附注	14
§ 7	投资组合报告	31
7.1	期末基金资产组合情况	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
§ 8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末上市基金前十名持有人	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	47
§ 9	开放式基金份额变动	47
§ 10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	51
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12	备查文件目录	53
12.1	备查文件名称	53
12.2	备查文件存放地点	53
12.3	备查文件查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金		
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	274,587,416.37 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	89,272,597.00 份	89,272,597.00 份	96,042,222.37 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	<p>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%,年跟踪误差不得超过 4%。</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲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。</p>		
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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张翔燕	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

§ 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	12,844,654.77
本期利润	50,067,503.75
加权平均基金份额本期利润	0.1432
本期加权平均净值利润率	11.97%
本期基金份额净值增长率	13.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-72,906,582.43

期末可供分配基金份额利润	-0.2655
期末基金资产净值	354,732,267.14
期末基金份额净值	1.292
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	40.48%

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。

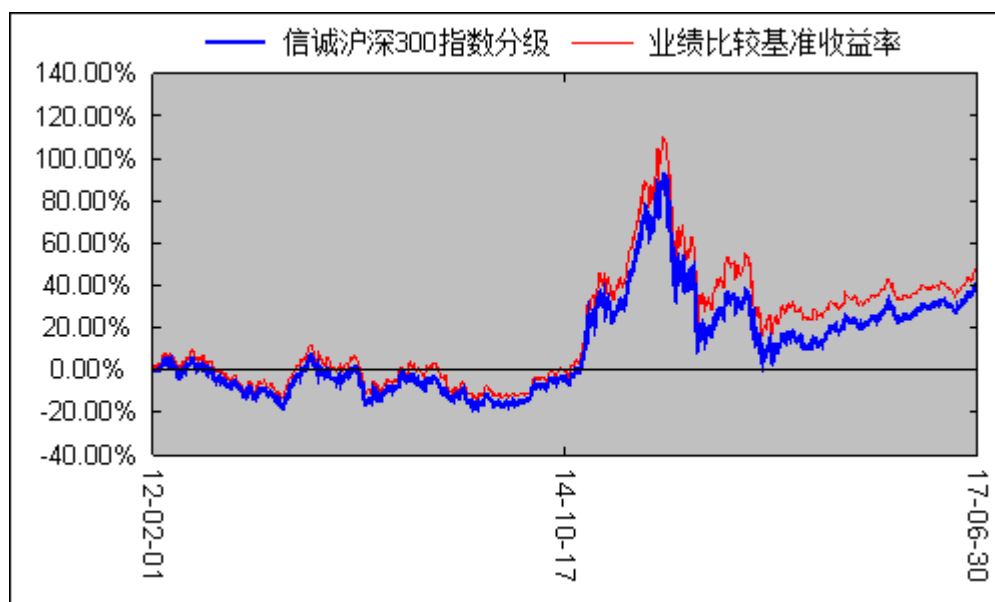
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	5.47%	0.61%	4.73%	0.64%	0.74%	-0.03%
过去三个月	7.31%	0.58%	5.80%	0.59%	1.51%	-0.01%
过去六个月	13.23%	0.53%	10.24%	0.54%	2.99%	-0.01%
过去一年	22.16%	0.63%	15.46%	0.63%	6.70%	0.00%
过去三年	64.67%	1.67%	66.04%	1.66%	-1.37%	0.01%
自基金合同生效起至今	40.48%	1.48%	47.28%	1.47%	-6.80%	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：本基金建仓期自2012年2月1日至2012年8月1日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 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		
提云	本基金基金经理,信诚至利灵活配置混合基	2016 年 3 月 2 日	-	17	复旦大学经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司,担任

涛	<p>金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至优灵活配置混合基金、信诚至鑫灵活配置混合基金、信诚至瑞灵活配置混合基金、信诚至选灵活配置混合基金、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 (LOF)、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放混合基金的基金经理, 信诚基金管理有限公司数量投资总监</p>			<p>研究部分析师; 于上海申银万国证券研究所, 历任宏观策略部副总监、金融工程部总监; 于平安资产管理有限责任公司, 担任量化投研部总经理; 于中信证券股份有限公司, 担任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、信诚至利灵活配置混合基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至优灵活配置混合基金、信诚至鑫灵活配置混合基金、信诚至瑞灵活配置混合基金、信诚至选灵活配置混合基金、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 (LOF)、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放混合基金的基金经理。</p>
杨旭	<p>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、信诚中证建筑工程指数型基金 (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、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信</p>	2015 年 1 月 15 日	-	<p>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、信诚中证建筑工程指数型基金 (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、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金的基金经理。</p>

	诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金的基金经理。				
黄稚	本基金基金经理助理, 信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金的基金经理助理。	2016 年 7 月 1 日	-	5	理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司, 担任资产管理部产品经理; 于平安证券有限责任公司, 担任产品经理。2015 年 6 月加入信诚基金, 担任金融工程师。现任信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金的基金经理助理。

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、二级市场对同一证券交易时的公平; 公司同时不断完善和改进公平交易分析系统, 在事后加以了严格的行为监控, 分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好, 未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年, 宏观经济稳中向好, 金融市场总体稳定。宏观经济, 经济运行整体平稳。PPI 涨幅呈逐季回落趋势, CPI 涨幅继续保持较低水平; 固定资产投资虽有回落, 但投资结构继续改善, 制造业投资和民间投资稳步增长; 制造业 PMI 虽然各月有所波动, 上半年保持在 50 荣枯线上方, 说明企业对市场持续看好; 金融市场, 在去杠杆、脱虚向实、加强监管, 同时又注意防范系统性金融风险的基调下, 总体运行平稳。

债券市场和股票市场表现不尽相同。受到加强监管、货币政策趋紧、经济基本面向好等多重因素的影响, 债券收益率整体震荡上行。在“春节后上调公开市场回购利率和 SLF 利率—2 月份紧缩措施略有放松—季度 MPA 考核—4、5 月份进一步加强监管—6 月中旬公开市场维持适当流动性”等因素影响下, 上

半年债券收益率呈整体震荡上行。股票市场,上半年市场股票市场结构继续分化,随着市场越来越关注上市公司的业绩和股票估值,大小盘呈现明显的结构分化。虽然一季度小盘股有所反弹,但是,小盘股整体呈下跌态势,中证 1000 指数从 2016 年年底的 8490 点下跌一度下跌到 6 月初的 6927 点,虽然到 6 月 30 日反弹到 7465 点,但仍下跌 12.1%。另一方面,大盘蓝筹虽然有过回调,但整体呈上涨趋势,特别是低估值行业龙头表现突出。沪深 300 指数从 2016 年年底的 3310 点涨到 6 月底的 3666 点,上涨 10.8%。

本基金上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,以提高基金净值。

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 13.23%,同期业绩比较基准收益率为 10.24%,基金超越业绩比较基准 2.99%。

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,预计经济运行整体平稳。一方面,外部经济的复苏,有助于拉动出口增长;另一方面,国内的投资将继续保持适当的规模,消费也将稳步增长,而通胀压力较小,经济结构也正逐步调整。预计股票市场仍将震荡上行。估值合适但有确定性盈利增长的大盘蓝筹股是长期投资机会;具有真实成长性的中盘股和高成长的小盘股票也可能受到市场青睐。另外,一些市场热点也可能有阶段性表现。

下半年,我们继续及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差,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。

4.7 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。

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。

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:信诚沪深 300 指数分级证券投资基金

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
资产:			
银行存款	6.4.7.1	21,526,476.89	25,804,595.50
结算备付金		6,939,235.98	16,136,521.07
存出保证金		4,875,040.25	8,790,946.31
交易性金融资产	6.4.7.2	322,046,629.15	489,654,644.07
其中:股票投资		312,056,629.15	469,716,644.07
基金投资		-	-
债券投资		9,990,000.00	19,938,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		219,360.08	-

应收利息	6.4.7.5	210,249.56	194,590.27
应收股利		-	-
应收申购款		531,872.26	104,302.12
递延所得税资产			
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		356,348,864.17	540,685,599.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		407,425.92	52,657.03
应付管理人报酬		286,829.76	432,540.31
应付托管费		63,102.54	95,158.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	154,810.07	394,437.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	704,428.74	700,198.40
负债合计		1,616,597.03	1,674,991.86
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	252,357,462.86	434,152,170.13
未分配利润	6.4.7.10	102,374,804.28	104,858,437.35
所有者权益合计		354,732,267.14	539,010,607.48
负债和所有者权益总计		356,348,864.17	540,685,599.34

注:截至本报告期末,基金份额总额 274,587,416.37 份。信诚沪深 300 指数分级份额净值 1.292 元,基金份额总额 96,042,222.37 份。下属分级基金:信诚沪深 300 指数分级 A 的基金份额净值 1.024 元,基金份额总额 89,272,597.00 份;信诚沪深 300 指数分级 B 的基金份额净值 1.560 元,基金份额总额 89,272,597.00 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: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	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		53,574,104.92	-221,432,508.32
1. 利息收入		266,755.09	340,934.86

其中：存款利息收入	6.4.7.11	137,728.46	340,630.93
债券利息收入		129,026.63	303.93
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）		15,668,748.92	-234,957,284.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,152,941.05	-238,558,968.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-15,166.33	105,173.10
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,975,755.00	-552,453.00
股利收益	6.4.7.16	2,555,219.20	4,048,963.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	37,222,848.98	11,446,411.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	415,751.93	1,737,430.11
减：二、费用		3,506,601.17	7,310,975.00
1. 管理人报酬		2,086,943.94	3,312,924.99
2. 托管费		459,127.65	728,843.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	595,872.74	2,901,165.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	364,656.84	368,041.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,067,503.75	-228,743,483.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,067,503.75	-228,743,483.32

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：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)	434,152,170.13	104,858,437.35	539,010,607.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,067,503.75	50,067,503.75
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)	-181,794,707.27	-52,551,136.82	-234,345,844.09
其中: 1. 基金申购款	75,388,134.78	23,793,220.21	99,181,354.99
2. 基金赎回款	-257,182,842.05	-76,344,357.03	-333,527,199.08
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)	252,357,462.86	102,374,804.28	354,732,267.14
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)	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

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 刘卓
 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 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 1 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	21,526,476.89
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	21,526,476.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	290,923,168.46	312,056,629.15	21,133,460.69	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	9,997,750.00	9,990,000.00	-7,750.00
	合计	9,997,750.00	9,990,000.00	-7,750.00
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	300,920,918.46	322,046,629.15	21,125,710.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,381,535.00	-	-	-
IF1709	12,170,535.00	-	-	-
IF1712	8,211,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,381,535.00	-	-	-

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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,985.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	194,065.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,003.89
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11,194.57
合计	210,249.56

注：其他指应收期货清算备付金利息、应收证券结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	154,810.07
银行间市场应付交易费用	-
合计	154,810.07

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,526.49
预提审计费	74,383.76
预提信息披露费	548,765.71
基金上市费	29,752.78
应付指数使用费	50,000.00
合计	704,428.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	472,378,082.98	434,152,170.13
本期申购	82,032,556.96	75,388,134.78
本期赎回（以“-”号填列）	-279,823,223.57	-257,182,842.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	274,587,416.37	252,357,462.86

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金合同规定，投资者可申购、赎回信诚沪深 300 份额，信诚沪深 300 A 份额与信诚沪深 300 B 份额只可在深交所上市交易，因此上表不再单独列示信诚沪深 300 A 份额与信诚沪深 300 B 份额的情况。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-143,972,985.49	248,831,422.84	104,858,437.35
本期利润	12,844,654.77	37,222,848.98	50,067,503.75
本期基金份额交易	58,221,748.29	-110,772,885.11	-52,551,136.82

产生的变动数			
其中：基金申购款	-23,432,900.31	47,226,120.52	23,793,220.21
基金赎回款	81,654,648.60	-157,999,005.63	-76,344,357.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-72,906,582.43	175,281,386.71	102,374,804.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
活期存款利息收入		74,405.52
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		2,006.49
其他		61,316.45
合计		137,728.46

注：其他包括期货清算备付金利息收入、结算保证金利息收入及申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
卖出股票成交总额		266,639,249.05
减：卖出股票成本总额		255,486,308.00
买卖股票差价收入		11,152,941.05

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入		-15,166.33
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		-15,166.33

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		10,553,434.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		10,457,750.00

减：应收利息总额	110,851.29
买卖债券差价收入	-15,166.33

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	1,975,755.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,555,219.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,555,219.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	35,262,963.98
——股票投资	35,213,213.98
——债券投资	49,750.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,959,885.00
——权证投资	-
股指期货	1,959,885.00
3. 其他	-
合计	37,222,848.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	415,665.13
转换费收入	86.80
合计	415,751.93

注：1、本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

2、根据 2012 年 7 月下发的《关于降低证券、期货市场监管费手续费标准等问题的通知》(发改价格[2012]2119 号)规定,自 2012 年 1 月 1 日期对股票交易监管费用按交易额的 0.04% 调整为 0.02%;对基金和债券免收交易监管费;其他指中登公司退还的 2012 年 1 月至 2012 年 8 月期间多收的交易监管费。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	592,219.63
银行间市场交易费用	175.00
股指期货交易费用	3,478.11
合计	595,872.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,000.00

银行费用	2,754.59
债券帐户维护费	9,000.00
基金上市费	29,752.78
合计	364,656.84

6.4.7.21 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末,本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 权证交易

6.4.10.1.3 债券交易

6.4.10.1.4 债券回购交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	2,086,943.94	3,312,924.99
其中:支付销售机构的客户维护费	181,902.31	246,392.93

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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	459,127.65	728,843.56

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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		上年度末	
	2017 年 6 月 30 日		2016 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	-	-	1,724,653.00	0.83%

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。本基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		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
中国建设银行	21,526,476.89	74,405.52	30,439,392.33	211,118.72

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 0.00 元。（2016 年 6 月 30 日余额为 0 元）

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

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。

6.4.12 期末 (2017 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	-
6.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 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

600050	中国联通	2017-04-05	筹划重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	326,773	1,764,362.07	2,440,994.31	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	276,632	2,158,528.36	1,717,884.72	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68	-	-	44,549	2,079,557.41	1,366,763.32	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项停牌	22.29	-	-	59,587	925,997.85	1,328,194.23	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	355,815	1,178,653.01	1,280,934.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	74,767	1,490,159.96	1,090,850.53	-
000100	TCL 集团	2017-04-21	筹划重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	266,710	1,103,852.92	914,815.30	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	64,675	976,311.92	913,211.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项停牌	20.24	-	-	36,140	772,014.87	731,473.60	-
002129	中环股份	2016-04-25	筹划重大事项	8.27	-	-	87,857	988,904.22	726,577.39	-
601727	上海电气	2017-06-22	中国证监会并购重组委审核公司资产重组事项	7.57	2017-07-03	7.54	94,804	842,499.13	717,666.28	-
002426	胜利精密	2017-01-16	筹划发行股份购买资产停牌	7.68	-	-	85,500	771,938.96	656,640.00	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大资产重组停牌	5.35	2017-07-26	5.89	117,263	740,726.06	627,357.05	-
000503	海虹控股	2017-05-11	筹划重大资产重组	24.93	-	-	24,201	1,000,647.88	603,330.93	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大资产重组	10.57	-	-	46,986	531,320.07	496,642.02	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	15,500	482,439.11	477,710.00	-
600654	*ST 中安	2016-12-14	重大资产重组	13.48	-	-	34,100	628,168.00	459,668.00	-

600666	奥瑞德	2017-04-27	重大资产重组	17.40	-	-	25,760	488,127.65	448,224.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	发行股份购买资产停牌	5.16	-	-	73,900	409,621.91	381,324.00	-
601608	中信重工	2017-04-19	发行股份购买资产停牌	5.54	2017-07-26	5.26	47,800	271,916.22	264,812.00	-

注:截至本报告批准报出日,“中国重工”“乐视网”“中国神华”“国电电力”“信威集团”“同方股份”“上海莱士”“中环股份”“胜利精密”“海虹控股”“江苏有线”“*ST 中安”“奥瑞德”“招商轮船”仍未发布复牌公告。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。此外,对于基金投资的股指期货等场内金融衍生品,管理人会对衍生品的流动性、交割日等予以关注。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,526,476.89	-	-	-	-	-	21,526,476.89
结算备付金	6,939,235.98	-	-	-	-	-	6,939,235.98
存出保证金	4,875,040.25	-	-	-	-	-	4,875,040.25
交易性金融资产	-	9,990,000.00	-	-	-	312,056,629.15	322,046,629.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	219,360.08	219,360.08

应收利息	-	-	-	-	-	210,249.56	210,249.56
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	531,872.26	531,872.26
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,340,753.12	9,990,000.00	-	-	-	313,018,111.05	356,348,864.17
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	407,425.92	407,425.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	286,829.76	286,829.76
应付托管费	-	-	-	-	-	63,102.54	63,102.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	154,810.07	154,810.07
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	704,428.74	704,428.74
负债总计	-	-	-	-	-	1,616,597.03	1,616,597.03
利率敏感度缺口	33,340,753.12	9,990,000.00	-	-	-	311,401,514.02	354,732,267.14
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	25,804,595.50	-	-	-	-	-	25,804,595.50
结算备付金	16,136,521.07	-	-	-	-	-	16,136,521.07
存出保证金	8,790,946.31	-	-	-	-	-	8,790,946.31
交易性金融资产	-	-	19,938,000.00	-	-	469,716,644.07	489,654,644.07
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	194,590.27	194,590.27
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	104,302.12	104,302.12
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	50,732,062.88	-	19,938,000.00	-	-	470,015,536.46	540,685,599.34
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	52,657.03	52,657.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	432,540.31	432,540.31
应付托管费	-	-	-	-	-	95,158.87	95,158.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	394,437.25	394,437.25

应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	700,198.40	700,198.40
负债总计	-	-	-	-	1,674,991.86	1,674,991.86
利率敏感度缺口	50,732,062.88	-	19,938,000.00	-	468,340,544.60	539,010,607.48

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	2,388.18	29,082.00
市场利率上升 25 个基点	-2,387.04	-28,997.39	

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。特别是针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	312,056,629.15	87.97	469,716,644.07	87.14
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	312,056,629.15	87.97	469,716,644.07	87.14

注：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。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	16,545,040.14	25,800,649.30
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-16,545,040.14	-25,800,649.30	

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
	2. -		
假设	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	-	-	-

6.4.14 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	312,056,629.15	87.57
	其中：股票	312,056,629.15	87.57
2	固定收益投资	9,990,000.00	2.80
	其中：债券	9,990,000.00	2.80
	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	28,465,712.87	7.99
7	其他各项资产	5,836,522.15	1.64
8	合计	356,348,864.17	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	752,749.29	0.21
B	采矿业	9,971,020.04	2.81
C	制造业	111,447,317.64	31.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,395,077.44	2.37
E	建筑业	14,265,820.07	4.02
F	批发和零售业	6,676,211.81	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	9,109,586.19	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,859,326.41	4.75
J	金融业	105,742,572.02	29.81
K	房地产业	16,435,547.61	4.63
L	租赁和商务服务业	2,723,358.54	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,547,362.25	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	615,400.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	3,596,751.95	1.01
S	综合	905,642.50	0.26
	合计	310,043,743.76	87.40

7.2.2 积极投资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	-	-
C	制造业	1,545,577.77	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	467,307.62	0.13
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	-	-
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	2,012,885.39	0.57

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	319,575	15,854,115.75	4.47
2	600036	招商银行	311,715	7,453,105.65	2.10
3	600519	贵州茅台	14,815	6,990,457.75	1.97
4	601166	兴业银行	376,527	6,348,245.22	1.79
5	600016	民生银行	715,047	5,877,686.34	1.66
6	000651	格力电器	141,850	5,839,964.50	1.65
7	000333	美的集团	133,377	5,740,546.08	1.62
8	601328	交通银行	829,974	5,112,639.84	1.44
9	000002	万科A	201,178	5,023,414.66	1.42
10	600000	浦发银行	340,133	4,302,682.45	1.21
11	601668	中国建筑	442,524	4,283,632.32	1.21
12	601288	农业银行	1,151,474	4,053,188.48	1.14
13	600030	中信证券	232,376	3,955,039.52	1.11
14	600887	伊利股份	179,159	3,868,042.81	1.09
15	600837	海通证券	238,647	3,543,907.95	1.00
16	002415	海康威视	108,698	3,510,945.40	0.99
17	601398	工商银行	651,569	3,420,737.25	0.96
18	601169	北京银行	367,459	3,369,599.03	0.95
19	600104	上汽集团	103,346	3,208,893.30	0.90
20	601601	中国太保	92,697	3,139,647.39	0.89

21	000858	五 粮 液	55,951	3,114,232.66	0.88
22	600900	长江电力	194,513	2,991,609.94	0.84
23	000725	京东方 A	700,506	2,914,104.96	0.82
24	601766	中国中车	286,507	2,899,450.84	0.82
25	601211	国泰君安	132,900	2,725,779.00	0.77
26	600276	恒瑞医药	49,824	2,520,596.16	0.71
27	600050	中国联通	326,773	2,440,994.31	0.69
28	000001	平安银行	259,060	2,432,573.40	0.69
29	601988	中国银行	636,671	2,355,682.70	0.66
30	600048	保利地产	210,110	2,094,796.70	0.59
31	601818	光大银行	479,819	1,943,266.95	0.55
32	601390	中国中铁	220,007	1,907,460.69	0.54
33	600518	康美药业	87,485	1,901,923.90	0.54
34	600028	中国石化	309,781	1,837,001.33	0.52
35	600015	华夏银行	193,865	1,787,435.30	0.50
36	600019	宝钢股份	261,015	1,751,410.65	0.49
37	601688	华泰证券	96,233	1,722,570.70	0.49
38	601989	中国重工	276,632	1,717,884.72	0.48
39	000063	中兴通讯	70,191	1,666,334.34	0.47
40	002450	康得新	72,896	1,641,617.92	0.46
41	601186	中国铁建	135,625	1,631,568.75	0.46
42	002304	洋河股份	17,785	1,543,915.85	0.44
43	000776	广发证券	87,376	1,507,236.00	0.42
44	001979	招商蛇口	69,907	1,493,213.52	0.42
45	601006	大秦铁路	175,509	1,472,520.51	0.42
46	000538	云南白药	15,351	1,440,691.35	0.41
47	600703	三安光电	72,169	1,421,729.30	0.40
48	300104	乐视网	44,549	1,366,763.32	0.39
49	600690	青岛海尔	89,874	1,352,603.70	0.38
50	600585	海螺水泥	58,977	1,340,547.21	0.38
51	601088	中国神华	59,587	1,328,194.23	0.37
52	601628	中国人寿	49,083	1,324,259.34	0.37
53	600795	国电电力	355,815	1,280,934.00	0.36
54	600958	东方证券	91,767	1,276,478.97	0.36
55	601336	新华保险	24,580	1,263,412.00	0.36
56	002024	苏宁云商	109,744	1,234,620.00	0.35
57	601009	南京银行	109,726	1,230,028.46	0.35
58	601901	方正证券	121,292	1,204,429.56	0.34
59	600340	华夏幸福	34,829	1,169,557.82	0.33
60	600999	招商证券	67,504	1,162,418.88	0.33
61	600309	万华化学	40,278	1,153,561.92	0.33

62	002230	科大讯飞	28,597	1,141,020.30	0.32
63	002142	宁波银行	58,981	1,138,333.30	0.32
64	600089	特变电工	110,113	1,137,467.29	0.32
65	600741	华域汽车	46,484	1,126,772.16	0.32
66	000423	东阿阿胶	15,400	1,107,106.00	0.31
67	601857	中国石油	143,140	1,100,746.60	0.31
68	600485	信威集团	74,767	1,090,850.53	0.31
69	600660	福耀玻璃	41,293	1,075,269.72	0.30
70	601985	中国核电	137,638	1,074,952.78	0.30
71	601669	中国电建	135,400	1,072,368.00	0.30
72	600009	上海机场	28,381	1,058,895.11	0.30
73	601899	紫金矿业	305,800	1,048,894.00	0.30
74	000568	泸州老窖	20,707	1,047,360.06	0.30
75	002241	歌尔股份	54,080	1,042,662.40	0.29
76	300070	碧水源	55,467	1,034,459.55	0.29
77	601377	兴业证券	138,117	1,026,209.31	0.29
78	002456	欧菲光	56,077	1,018,919.09	0.29
79	000166	申万宏源	177,384	993,350.40	0.28
80	601607	上海医药	34,025	982,642.00	0.28
81	300072	三聚环保	26,400	978,120.00	0.28
82	002236	大华股份	42,748	975,081.88	0.27
83	000069	华侨城A	96,905	974,864.30	0.27
84	002736	国信证券	72,525	960,956.25	0.27
85	002466	天齐锂业	17,600	956,560.00	0.27
86	600886	国投电力	119,988	947,905.20	0.27
87	000338	潍柴动力	71,472	943,430.40	0.27
88	000783	长江证券	97,935	927,444.45	0.26
89	600196	复星医药	29,687	920,000.13	0.26
90	600031	三一重工	113,021	918,860.73	0.26
91	600068	葛洲坝	81,441	915,396.84	0.26
92	000100	TCL 集团	266,710	914,815.30	0.26
93	600100	同方股份	64,675	913,211.00	0.26
94	300059	东方财富	75,910	912,438.20	0.26
95	600029	南方航空	103,487	900,336.90	0.25
96	600010	包钢股份	401,212	878,654.28	0.25
97	601600	中国铝业	193,848	876,192.96	0.25
98	002008	大族激光	25,135	870,676.40	0.25
99	601888	中国国旅	28,756	866,705.84	0.24
100	600066	宇通客车	39,139	859,883.83	0.24
101	601788	光大证券	57,594	859,878.42	0.24
102	600637	东方明珠	39,033	845,845.11	0.24

103	600606	绿地控股	107,700	842,214.00	0.24
104	000625	长安汽车	57,508	829,265.36	0.23
105	601099	太平洋	203,870	819,557.40	0.23
106	002594	比亚迪	16,223	810,338.85	0.23
107	000839	中信国安	80,850	807,691.50	0.23
108	601933	永辉超市	112,674	797,731.92	0.22
109	601555	东吴证券	70,688	793,826.24	0.22
110	600535	天士力	19,082	792,666.28	0.22
111	601618	中国中冶	157,582	789,485.82	0.22
112	600893	航发动力	28,767	785,339.10	0.22
113	000413	东旭光电	69,036	774,583.92	0.22
114	600522	中天科技	63,300	762,765.00	0.22
115	600383	金地集团	66,484	762,571.48	0.21
116	600406	国电南瑞	42,945	757,979.25	0.21
117	300124	汇川技术	29,455	752,280.70	0.21
118	000768	中航飞机	40,785	752,075.40	0.21
119	600705	中航资本	132,056	746,116.40	0.21
120	600816	安信信托	54,560	741,470.40	0.21
121	002475	立讯精密	25,332	740,707.68	0.21
122	600111	北方稀土	65,197	738,682.01	0.21
123	002673	西部证券	51,611	733,908.42	0.21
124	600109	国金证券	62,431	731,691.32	0.21
125	002252	上海莱士	36,140	731,473.60	0.21
126	000963	华东医药	14,508	721,047.60	0.20
127	601727	上海电气	94,804	717,666.28	0.20
128	601800	中国交建	45,005	715,129.45	0.20
129	002739	万达电影	14,000	713,580.00	0.20
130	002202	金风科技	46,066	712,641.02	0.20
131	000895	双汇发展	29,114	691,457.50	0.19
132	600271	航天信息	33,418	689,747.52	0.19
133	600570	恒生电子	14,770	689,463.60	0.19
134	601018	宁波港	118,204	667,852.60	0.19
135	600023	浙能电力	122,010	666,174.60	0.19
136	600739	辽宁成大	36,590	659,717.70	0.19
137	002426	胜利精密	85,500	656,640.00	0.19
138	600177	雅戈尔	64,293	650,645.16	0.18
139	600352	浙江龙盛	68,064	648,649.92	0.18
140	600674	川投能源	65,802	646,175.64	0.18
141	601992	金隅股份	99,800	645,706.00	0.18
142	600547	山东黄金	22,210	642,535.30	0.18
143	000623	吉林敖东	27,835	637,143.15	0.18

144	000728	国元证券	52,087	636,503.14	0.18
145	300024	机器人	32,624	636,168.00	0.18
146	601225	陕西煤业	89,697	634,157.79	0.18
147	600221	海航控股	196,650	633,213.00	0.18
148	601919	中远海控	117,263	627,357.05	0.18
149	002508	老板电器	14,155	615,459.40	0.17
150	600018	上港集团	97,068	615,411.12	0.17
151	002044	美年健康	36,200	615,400.00	0.17
152	002065	东华软件	28,158	613,562.82	0.17
153	000793	华闻传媒	60,301	610,246.12	0.17
154	002007	华兰生物	16,657	607,980.50	0.17
155	000503	海虹控股	24,201	603,330.93	0.17
156	600804	鹏博士	33,795	599,861.25	0.17
157	600115	东方航空	87,983	598,284.40	0.17
158	601998	中信银行	93,930	590,819.70	0.17
159	000157	中联重科	131,410	590,030.90	0.17
160	600415	小商品城	81,403	589,357.72	0.17
161	603993	洛阳钼业	116,191	587,926.46	0.17
162	000540	中天金融	84,300	585,885.00	0.17
163	601111	中国国航	59,558	580,690.50	0.16
164	600208	新湖中宝	128,578	578,601.00	0.16
165	600085	同仁堂	16,376	572,504.96	0.16
166	600820	隧道股份	56,400	569,640.00	0.16
167	601198	东兴证券	33,000	568,920.00	0.16
168	002465	海格通信	51,354	551,541.96	0.16
169	600153	建发股份	42,423	548,529.39	0.15
170	600436	片仔癀	8,900	543,256.00	0.15
171	000826	启迪桑德	15,320	538,038.40	0.15
172	000630	铜陵有色	188,855	536,348.20	0.15
173	002310	东方园林	32,000	535,040.00	0.15
174	000709	河钢股份	127,006	532,155.14	0.15
175	600157	永泰能源	148,627	530,598.39	0.15
176	600362	江西铜业	31,005	522,744.30	0.15
177	300017	网宿科技	43,151	520,832.57	0.15
178	000009	中国宝安	64,298	520,170.82	0.15
179	000060	中金岭南	46,284	518,380.80	0.15
180	600489	中金黄金	51,586	517,407.58	0.15
181	600061	国投安信	33,186	516,042.30	0.15
182	601229	上海银行	20,200	515,908.00	0.15
183	002081	金螳螂	46,792	513,776.16	0.14
184	002146	荣盛发展	52,018	513,417.66	0.14

185	600663	陆家嘴	21,616	511,002.24	0.14
186	000876	新希望	62,082	510,314.04	0.14
187	600170	上海建工	133,172	508,717.04	0.14
188	002027	分众传媒	36,600	503,616.00	0.14
189	600959	江苏有线	46,986	496,642.02	0.14
190	601155	新城控股	26,700	495,018.00	0.14
191	601216	君正集团	100,938	493,586.82	0.14
192	600118	中国卫星	17,701	492,795.84	0.14
193	002074	国轩高科	15,500	489,025.00	0.14
194	600332	白云山	16,826	488,627.04	0.14
195	000750	国海证券	88,302	485,661.00	0.14
196	600297	广汇汽车	64,160	483,124.80	0.14
197	600682	南京新百	13,000	479,700.00	0.14
198	002500	山西证券	49,982	478,827.56	0.13
199	002049	紫光国芯	15,500	477,710.00	0.13
200	600008	首创股份	72,066	474,194.28	0.13
201	600369	西南证券	84,408	473,528.88	0.13
202	300315	掌趣科技	58,000	473,280.00	0.13
203	601633	长城汽车	35,607	473,217.03	0.13
204	000425	徐工机械	123,917	464,688.75	0.13
205	600150	中国船舶	20,316	464,626.92	0.13
206	601333	广深铁路	100,173	452,781.96	0.13
207	300144	宋城演艺	21,426	447,160.62	0.13
208	000559	万向钱潮	40,530	430,428.60	0.12
209	000792	盐湖股份	41,075	429,233.75	0.12
210	600688	上海石化	64,536	426,582.96	0.12
211	002195	二三四五	59,540	425,711.00	0.12
212	000686	东北证券	42,004	422,140.20	0.12
213	601117	中国化学	59,600	416,604.00	0.12
214	000402	金融街	35,249	413,118.28	0.12
215	000983	西山煤电	47,100	413,067.00	0.12
216	300027	华谊兄弟	50,490	408,464.10	0.12
217	600718	东软集团	26,256	408,280.80	0.12
218	600583	海油工程	65,109	406,280.16	0.11
219	300033	同花顺	6,500	404,365.00	0.11
220	600498	烽火通信	15,814	400,884.90	0.11
221	600256	广汇能源	94,705	392,078.70	0.11
222	600649	城投控股	37,259	391,592.09	0.11
223	600373	中文传媒	16,619	390,712.69	0.11
224	002411	必康股份	13,500	390,420.00	0.11
225	600827	百联股份	23,963	389,398.75	0.11

226	000917	电广传媒	34,265	387,194.50	0.11
227	002183	怡亚通	44,800	386,624.00	0.11
228	002385	大北农	61,344	385,853.76	0.11
229	600895	张江高科	22,836	385,471.68	0.11
230	300168	万达信息	26,300	382,665.00	0.11
231	601872	招商轮船	73,900	381,324.00	0.11
232	600704	物产中大	52,085	379,699.65	0.11
233	600588	用友网络	22,087	378,129.44	0.11
234	000415	渤海金控	56,026	377,054.98	0.11
235	600074	保千里	28,700	367,647.00	0.10
236	600919	江苏银行	39,300	365,097.00	0.10
237	000008	神州高铁	49,500	360,360.00	0.10
238	600060	海信电器	23,701	359,544.17	0.10
239	002470	金正大	47,484	357,554.52	0.10
240	600376	首开股份	31,200	356,928.00	0.10
241	601718	际华集团	39,400	346,326.00	0.10
242	601866	中远海发	95,854	345,074.40	0.10
243	601997	贵阳银行	21,400	338,334.00	0.10
244	002558	巨人网络	7,320	338,330.40	0.10
245	002602	世纪华通	9,300	337,218.00	0.10
246	000959	首钢股份	48,000	335,520.00	0.09
247	002352	顺丰控股	6,300	334,908.00	0.09
248	600909	华安证券	32,800	330,952.00	0.09
249	002174	游族网络	10,400	330,304.00	0.09
250	600038	中直股份	7,076	323,868.52	0.09
251	002555	三七互娱	12,600	322,182.00	0.09
252	600977	中国电影	16,900	316,368.00	0.09
253	000977	浪潮信息	18,100	313,492.00	0.09
254	600021	上海电力	25,900	313,131.00	0.09
255	000627	天茂集团	38,700	312,696.00	0.09
256	600037	歌华有线	21,000	305,760.00	0.09
257	002152	广电运通	36,750	305,392.50	0.09
258	600737	中粮糖业	31,200	294,528.00	0.08
259	000671	阳光城	48,900	284,598.00	0.08
260	002714	牧原股份	10,400	283,088.00	0.08
261	600372	中航电子	16,075	279,222.75	0.08
262	002131	利欧股份	84,700	278,663.00	0.08
263	600549	厦门钨业	12,900	277,221.00	0.08
264	600685	中船防务	10,000	273,800.00	0.08
265	601118	海南橡胶	47,546	270,061.28	0.08
266	000718	苏宁环球	45,900	268,974.00	0.08

267	000938	紫光股份	4,400	268,928.00	0.08
268	000738	航发控制	13,692	267,952.44	0.08
269	002292	奥飞娱乐	15,846	267,797.40	0.08
270	600482	中国动力	10,500	265,545.00	0.07
271	600446	金证股份	15,100	265,458.00	0.07
272	601608	中信重工	47,800	264,812.00	0.07
273	601877	正泰电器	12,900	259,161.00	0.07
274	000156	华数传媒	17,302	257,972.82	0.07
275	601375	中原证券	24,200	243,452.00	0.07
276	601021	春秋航空	7,228	243,077.64	0.07
277	002424	贵州百灵	12,800	241,408.00	0.07
278	300133	华策影视	21,162	237,014.40	0.07
279	601881	中国银河	19,500	231,270.00	0.07
280	000961	中南建设	33,600	219,072.00	0.06
281	002153	石基信息	9,633	218,958.09	0.06
282	300251	光线传媒	26,280	215,233.20	0.06
283	601958	金铂股份	29,138	208,919.46	0.06
284	002299	圣农发展	13,423	199,600.01	0.06
285	600233	圆通速递	10,100	197,859.00	0.06
286	601163	三角轮胎	7,200	189,360.00	0.05
287	601611	中国核建	15,700	187,929.00	0.05
288	600926	杭州银行	12,400	184,140.00	0.05
289	600871	石化油服	54,000	180,360.00	0.05
290	601966	玲珑轮胎	7,400	165,982.00	0.05
291	603858	步长制药	2,300	164,772.00	0.05
292	603160	汇顶科技	1,500	150,450.00	0.04
293	000555	神州信息	8,600	143,620.00	0.04
294	600188	兖州煤业	11,671	142,853.04	0.04
295	002797	第一创业	11,980	110,335.80	0.03
296	601127	小康股份	5,500	109,725.00	0.03
297	002839	张家港行	6,300	99,036.00	0.03
298	002831	裕同科技	1,300	97,500.00	0.03
299	002841	视源股份	1,300	96,486.00	0.03

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	002129	中环股份	87,857	726,577.39	0.20
2	600654	*ST 中安	34,100	459,668.00	0.13
3	600666	奥瑞德	25,760	448,224.00	0.13
4	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01

5	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
6	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
7	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
8	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
9	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
10	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
11	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
12	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
13	603933	睿能科技	857	17,311.40	-
14	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	-
15	300669	沪宁股份	841	14,650.22	-
16	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	-
17	603286	日盈电子	890	13,528.00	-
18	300672	国科微	1,257	10,659.36	-
19	603331	百达精工	999	9,620.37	-
20	300671	富满电子	942	7,639.62	-
21	603617	君禾股份	832	7,429.76	-

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	2,145,037.00	0.40
2	600019	宝钢股份	1,270,169.80	0.24
3	600519	贵州茅台	1,041,522.00	0.19
4	600036	招商银行	1,036,730.27	0.19
5	601166	兴业银行	1,029,031.00	0.19
6	002415	海康威视	1,004,469.00	0.19
7	600016	民生银行	951,698.00	0.18
8	600104	上汽集团	904,156.00	0.17
9	601328	交通银行	818,195.00	0.15
10	601766	中国中车	780,746.30	0.14
11	000333	美的集团	765,257.97	0.14
12	600522	中天科技	752,911.00	0.14
13	000651	格力电器	730,850.00	0.14
14	601992	金隅股份	705,999.00	0.13
15	600000	浦发银行	689,874.00	0.13
16	000002	万科 A	661,445.60	0.12
17	002508	老板电器	655,430.05	0.12
18	601288	农业银行	628,069.00	0.12
19	601668	中国建筑	609,197.00	0.11

20	002044	美年健康	608,021.00	0.11
----	--------	------	------------	------

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	10,897,538.43	2.02
2	601166	兴业银行	6,181,108.00	1.15
3	600016	民生银行	5,402,826.00	1.00
4	600036	招商银行	5,361,969.34	0.99
5	600519	贵州茅台	5,173,582.70	0.96
6	601328	交通银行	4,418,271.00	0.82
7	000333	美的集团	3,897,298.94	0.72
8	000651	格力电器	3,765,418.02	0.70
9	600000	浦发银行	3,708,906.89	0.69
10	000002	万科 A	3,633,468.65	0.67
11	601668	中国建筑	3,546,466.72	0.66
12	601288	农业银行	3,383,527.00	0.63
13	600030	中信证券	3,353,604.87	0.62
14	600837	海通证券	3,266,796.11	0.61
15	601169	北京银行	3,084,205.84	0.57
16	600887	伊利股份	2,948,367.00	0.55
17	601398	工商银行	2,739,882.00	0.51
18	600104	上汽集团	2,651,100.00	0.49
19	601766	中国中车	2,608,365.00	0.48
20	601601	中国太保	2,341,475.47	0.43

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	62,613,079.10
卖出股票收入(成交)总额	266,639,249.05

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	9,990,000.00	2.82
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	9,990,000.00	2.82

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	160018	16 附息国债 18	100,000	9,990,000.00	2.82

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

金额单位：人民币元

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

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

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。

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
IF1709	IF1709	12	13,070,880.00	900,345.00	-
IF1712	IF1712	8	8,651,520.00	440,520.00	-
公允价值变动总额合计(元)				1,340,865.00	
股指期货投资本期收益(元)				1,975,755.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				1,959,885.00	

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

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

7.12.1 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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,875,040.25
2	应收证券清算款	219,360.08
3	应收股利	-
4	应收利息	210,249.56
5	应收申购款	531,872.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,836,522.15

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 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	002129	中环股份	726,577.39	0.20	筹划重大事项
2	600654	*ST 中安	459,668.00	0.13	重大资产重组停牌
3	600666	奥瑞德	448,224.00	0.13	重大资产重组停牌

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

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	794	112,434.00	79,213,955.00	88.73%	10,058,642.00	11.27%
信诚沪深 300 指数分级 B	6,603	13,520.01	6,360,618.00	7.12%	82,911,979.00	92.88%
信诚沪深 300 指数分级	4,610	20,833.45	68,578,458.99	71.40%	27,463,763.38	28.60%
合计	12,007	22,868.94	154,153,031.99	56.14%	120,434,384.38	43.86%

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	中荷人寿保险有限公司一分红险	19,790,374.00	22.17%
2	民生加银资产—民生银行—民生加银资管共赢绝对收益 1 号专项	7,532,135.00	8.44%
3	中国银河证券股份有限公司	5,892,711.00	6.60%
4	中国人寿保险(集团)公司	5,777,267.00	6.47%
5	德邦基金—浙商银行—百年人寿保险—百年人寿保	4,779,475.00	5.35%

	险股份有限公司		
6	富国基金—建设银行—易方达资产管理有限公司	4,613,192.00	5.17%
7	富国基金—民生银行—中国民生银行股份有限公司	4,498,240.00	5.04%
8	富国基金—广发银行—中信证券股份有限公司	4,268,799.00	4.78%
9	富国基金—招商银行—富国基金招商银行—量化对冲 4 号混合型	3,022,286.00	3.39%
10	工银瑞信基金—农业银行—中油财务有限责任公司	3,000,000.00	3.36%

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	宋伟铭	2,220,079.00	2.49%
2	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	2.19%
3	中泰证券股份有限公司	1,600,000.00	1.79%
4	金兆玮	1,344,573.00	1.51%
5	许敏哲	1,314,700.00	1.47%
6	高初先	1,003,800.00	1.12%
7	田杰	1,000,000.00	1.12%
8	张俊	914,793.00	1.02%
9	王晓刚	877,700.00	0.98%
10	吴丽娟	850,500.00	0.95%

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	286,465.01	0.30%
	合计	286,465.01	0.10%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	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	10~50
	合计	10~50
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	-
	信诚沪深 300 指数分级 B	-
	信诚沪深 300 指数分级	-
	合计	-

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。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 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	207,499,584.00	207,499,584.00	57,378,914.98
本报告期基金总申购份额	-	-	82,032,556.96
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	279,823,223.57
本报告期基金拆分变动份额	-118,226,987.00	-118,226,987.00	236,453,974.00
本报告期期末基金份额总额	89,272,597.00	89,272,597.00	96,042,222.37

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§ 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	
中信证券	1	73,522,850.29	22.81%	67,000.94	22.47%	-
平安证券	2	71,340,226.45	22.13%	65,853.32	22.09%	-
广发证券	1	63,327,195.19	19.65%	58,979.01	19.78%	-
西南证券	2	56,857,933.24	17.64%	52,952.96	17.76%	-
兴业证券	2	39,264,585.06	12.18%	36,566.19	12.27%	本期减少一个交易席位
申银万国	1	17,632,234.19	5.47%	16,421.24	5.51%	-
东吴证券	2	372,889.07	0.12%	347.27	0.12%	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	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	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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	-	-	-	-	-
中银国际	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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	932,144.00	100.00%	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第四季度报告	同上	2017-01-20
3	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2017-02-21
4	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-02-23
5	信诚基金管理有限公司关于在网上直销与直销柜台渠道开展旗下指定指数基金之间转换费率优惠活动的公告	同上	2017-03-06
6	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（2017 年第 1 次更新）	同上	2017-03-16
7	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书摘要（2017 年第 1 次更新）	同上	2017-03-16
8	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2017-03-28
9	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告	同上	2017-03-31
10	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要	同上	2017-03-31
11	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-07
12	关于旗下部分基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-17
13	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳金斧子投资咨询有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-20
14	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年第一季度报告	同上	2017-04-21
15	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-04-22
16	信诚基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017-04-25
17	信诚基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017-04-26

18	信诚基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017-04-27
19	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-27
20	信诚基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017-04-28
21	信诚基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017-04-29
22	信诚基金管理有限公司关于调整旗下 9 只指数基金的场外单笔最低申购限额、单笔最低赎回份额和最低保留份额的公告	同上	2017-06-09
23	关于旗下 9 只指数基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并调整场外单笔最低申购限额、单笔最低赎回份额和最低保留份额的公告	同上	2017-06-09
24	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-06-30

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- | |
|---|
| <ol style="list-style-type: none">1、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金相关批准文件2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程3、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同4、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书5、本报告期内按照规定披露的各项公告 |
|---|

12.2 备查文件存放地点

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

12.3 备查文件查阅方式

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

信诚基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日