

信诚中小盘混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 3 月 27 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚中小盘混合型证券投资基金
基金简称	信诚中小盘混合
基金主代码	550009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 02 月 10 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,475,226.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过重点投资于具有较高成长性或具有价值优势的中小盘股票,追求高于业绩比较基准的超额收益,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金的资产配置策略基于 MVSR 分析框架来制定。MVSR 分析框架包括四个部分:M-宏观经济情况,V-估值水平,S-市场情况,R-风险状况。对上述四个部分,本基金将进行最近三个月和未来 12 个月的分析和预测,从而得出乐观、中性、谨慎和悲观的看法,在这些分析的基础上,得出对市场、行业的整体判断和指数运行空间的判断,并根据这些判断来决定本基金的大类资产配置比例和行业配置策略。</p> <p>2、股票投资策略:本基金通过重点投资中小盘股票,以期把握中小企业两类投资机会:高速成长预期所带来的上升动量以及由于低关注度所带来的价格回归。本基金的股票投资将以“自下而上”的精选策略为主,同时结合“自上而下”的分析对公司成长性进行逻辑性判断,以甄别具有较高成长性抑或具有价值优势的中小盘股票。通过广泛深入的实地调研和细致严谨的案头</p>

	分析, 本基金将根据对中小盘股票的成长性及其可持续性、行业前景及行业地位, 结合估值水平, 进行股票组合的构建。
业绩比较基准	40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。
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		中信保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@citicprufunds.com.cn	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	田国立

注: 本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.4 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-9,676,102.26	1,710,786.08	-16,337,720.40
本期利润	-15,173,705.72	4,120,009.55	-22,926,632.07
加权平均基金份额本期利润	-0.4862	0.1141	-0.5264
本期加权平均净值利润率	-34.39%	7.71%	-34.14%
本期基金份额净值增长率	-30.98%	7.75%	-28.76%

3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	2,334,421.97	18,977,729.67	18,283,031.27
期末可供分配基金份额利润	0.0850	0.5721	0.4592
期末基金资产净值	29,809,648.08	52,148,856.63	58,095,857.49
期末基金份额净值	1.085	1.572	1.459
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	22.97%	78.17%	65.36%

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。

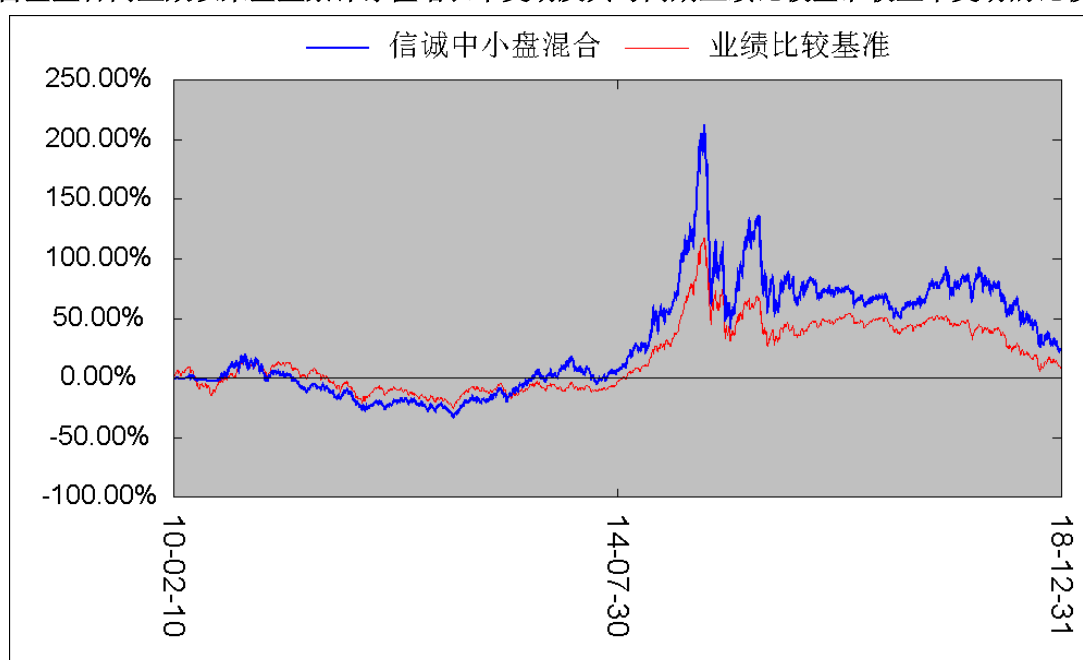
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	-15.89%	1.73%	-8.97%	1.39%	-6.92%	0.34%
过去六个月	-23.43%	1.65%	-14.30%	1.21%	-9.13%	0.44%
过去一年	-30.98%	1.66%	-24.80%	1.13%	-6.18%	0.53%
过去三年	-47.02%	1.65%	-34.03%	1.11%	-12.99%	0.54%
过去五年	14.33%	1.98%	17.85%	1.34%	-3.52%	0.64%
自基金合同生效起至今	22.97%	1.69%	8.98%	1.27%	13.99%	0.42%

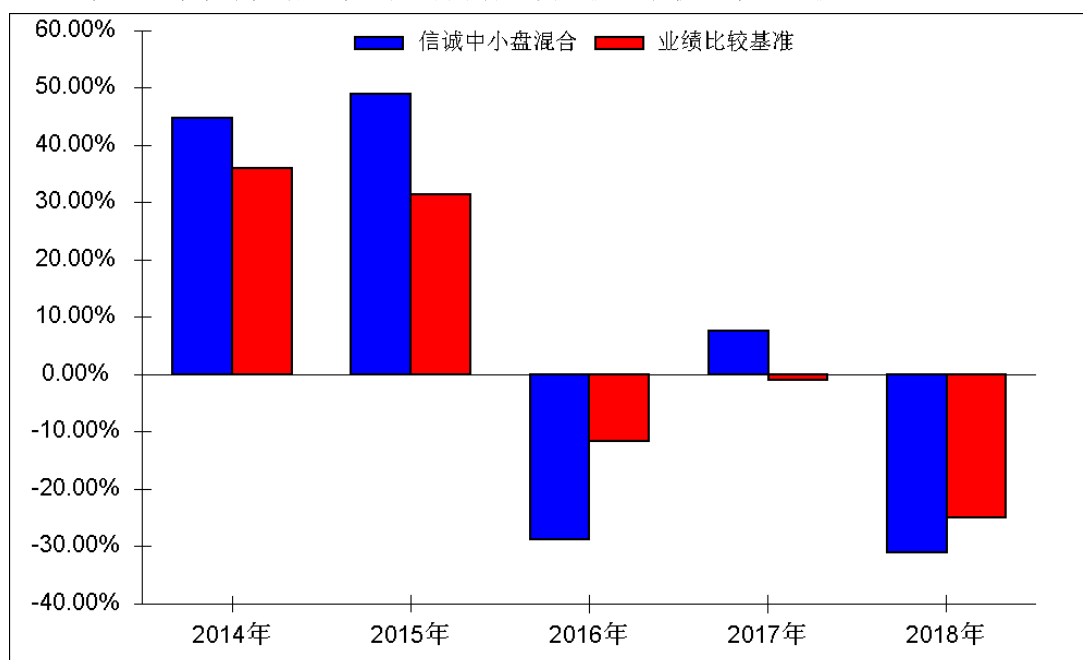
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金建仓期自 2010 年 2 月 10 日至 2010 年 8 月 9 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“天相中盘指数收益率*40%+天相小盘指数收益率*40%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“天相中盘指数收益率*40%+天相小盘指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*20%”。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018 年	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2017 年	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2016 年	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	-	-	-	-	本基金最近三年未进行利润分配

本基金在过去三年未进行过利润分配。

§ 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

本基金管理人中信保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%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网

站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2018 年 12 月 31 日,本基金管理人管理的运作中基金为 65 只,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、中信保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、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、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)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保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、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、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、中信保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(LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金。

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		
郑伟	本基金基金经理,信诚深度价值混合基金(LOF)、信诚新兴产业混合基金基金经理	2014 年 04 月 23 日	-	13	经济学硕士。曾任职于华泰资产管理有限公司,担任研究员。2009 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司,历任研究员、专户投资经理。现任信诚新兴产业混合基金、信诚中小盘混合基金、信诚深度价值混合基金(LOF)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

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《信诚中小盘混合型证券投资基金基金合同》、《信诚中小盘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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 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

2018 年市场在各种利空因素影响下基本呈单边下跌态势。全年上证指数下跌超过 24%,中小板指数下跌超过 37%,创业板指数下跌超过 28%。而以上证 50 为代表的大盘股表现最好,全年仅下跌 19.8% 左右。

年内影响资本市场的各种因素交织在一起,金融去杠杆力度过大、过猛导致企业融资环境紧张、信用风险加剧;贸易摩擦带来的不确定性,对企业正常经营环境带来较大冲击。总体来看,由于各种风险因素不断出现,2018 年资本市场投资的主要逻辑是避险。

本基金由于在年初配置了包括安防、LED、新能源汽车行业，以及 TMT 行业等，在各种利空影响下这些板块年内下跌较多，给基金净值带来较多的负贡献。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内, 本基金份额净值增长率为-30.98%, 同期业绩比较基准收益率为-24.8%, 基金落后业绩比较基准 6.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2019 年贸易摩擦出现阶段性缓和, 中央政治局会议及中央经济工作会议定调明年经济工作。政策往宽松方向走是比较确定的, 货币环境有望进一步宽松, 财政政策也会继续发力, 地产调控政策边上会有所放松, 但政策效力受制于地方政府债务约束及货币传递机制, 同时也不会过度宽松, 导致资产价格大起大落。外部矛盾方面, 贸易冲突对市场的长期短期逻辑都会有很大影响, 贸易冲突的节奏及进展也会对国内产业政策及其他政策的力度。从估值看, 目前市场估值仍处于历史极低的水平。预计 2019 年市场总体保持震荡格局, 存在较多的结构性投资机会。

我们看好半导体、TMT、光伏、大消费及医药等行业的投资机会, 我们将在这些行业积极挖掘优质的投资标的, 优化行业配置, 争取为持有人创造收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 年公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用, 组织业务部门不断补充和完善公司的各项规章制度; 开展对公司运作和基金业务的日常监察和内部审计; 做好信息披露和对外文稿的合规审查; 开展法律咨询和合规培训工作; 及时向监管部门报送各项数据和材料。现将公司 2018 年度的监察稽核工作总结如下:

1、制度建设和完善

组织各业务部门对相关业务制度进行梳理, 新增制度 3 项, 修订制度 4 项, 并协助相关部门对 9 项制度草案提出修改意见。上述制度主要包括投资、风控、财务、行政、产品、运营、监察稽核、子公司等业务范畴。

2、内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作

完成季度常规审计 4 次, 内部合规检查 20 次, 离任审查 1 人次; 协助普华永道会计师事务所和毕马威会计师事务所开展基金和公司 2017 年度审计、2018 年度预审计和 IT 审计工作; 配合监管机构完成多项自查工作; 配合股东联合审计等。

3、合规监察工作

按时完成并向上海证监局和公司董事提交各项监察稽核定期项目报告; 定期为新入司同事开展合规培训; 在基金募集、投资过程中的进行合规检查与提示; 对董事、高级管理人员、基金经理任免情况进行备案等。

4、信息披露及文档的合规检查

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。

5、合规培训和法务工作

组织员工法规培训、新员工培训及部门内部培训, 针对监管新规及时编制《新规速递》进行点评, 对基金与行政合同进行检查修订。

6、向监管部门的数据报送和日常联络, 包括监管系统信息维护、材料数据报送及与监管机构的日常沟通。

7、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严格控制。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、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、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。

基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理, 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备估值业务所需的专业胜任能力, 具有基金从业人员资格。

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, 可申请召开估值决策委员会临时会议, 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

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, 基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额(具体日期以本基金分红公告为准);

3. 在符合有关基金分红条件的前提下, 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收益分配基准日可供分配利润的 25%(收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);

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权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准); 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;

7. 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

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 2018 年 5 月 23 日起至 2018 年 12 月 28 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, 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, 本基金未实施利润分配。

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 审计报告

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	毕马威华振审字第 1900179 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	信诚中小盘混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的第 1 页至第 36 页的信诚中小盘混合型证券投资基金 (以下简称“信诚中小盘基金”) 财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了信诚中小盘基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值

	变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信诚中小盘基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>信诚中小盘基金管理人中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括信诚中小盘基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估信诚中小盘基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非信诚中小盘基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督信诚中小盘基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，

	<p>则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对信诚中小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致信诚中小盘基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠 叶凯韵
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
审计报告日期	2019年03月27日

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金2018年12月31日的资产负债表,2018年1月1日至2018年12月31日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出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 信诚中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,577,582.65	10,760,909.23
结算备付金		243,991.91	96,304.78
存出保证金		36,980.87	42,840.62
交易性金融资产	7.4.7.2	21,119,747.72	37,351,173.98
其中：股票投资		21,119,747.72	37,233,148.78
基金投资		-	-
债券投资		-	118,025.20
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	3,000,000.00	-
应收证券清算款		163,636.37	1,749,569.55
应收利息	7.4.7.5	1,770.29	1,974.87
应收股利		-	-
应收申购款		3,259.56	2,978,512.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		33,146,969.37	52,981,285.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 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		2,704,842.78	-
应付赎回款		578.39	12,496.52
应付管理人报酬		39,112.16	62,569.60
应付托管费		6,518.69	10,428.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	106,769.27	121,932.50
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	479,500.00	625,002.18
负债合计		3,337,321.29	832,429.05
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	27,475,226.11	33,171,126.96
未分配利润	7.4.7.10	2,334,421.97	18,977,729.67
所有者权益合计		29,809,648.08	52,148,856.63
负债和所有者权益总计		33,146,969.37	52,981,285.68

注：截止本报告期末，基金份额净值为 1.085 元，基金份额总额为 27,475,226.11 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
一、收入		-13,447,080.49	6,686,251.05
1. 利息收入		59,839.65	71,490.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	59,735.05	71,463.67
债券利息收入		104.60	27.24
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）		-8,014,476.82	4,196,800.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,246,078.95	3,811,618.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,810.68	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	206,791.45	385,182.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,497,603.46	2,409,223.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,160.14	8,735.84
减：二、费用		1,726,625.23	2,566,241.50
1. 管理人报酬		662,566.93	802,048.22
2. 托管费		110,427.81	133,674.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	893,229.06	1,434,156.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.36	-
7. 其他费用	7.4.7.19	60,401.07	196,361.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,173,705.72	4,120,009.55
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,173,705.72	4,120,009.55
-------------------	--	----------------	--------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 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）	33,171,126.96	18,977,729.67	52,148,856.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-15,173,705.72	-15,173,705.72
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)	-5,695,900.85	-1,469,601.98	-7,165,502.83
其中：1. 基金申购款	3,262,084.74	1,346,478.09	4,608,562.83
2. 基金赎回款	-8,957,985.59	-2,816,080.07	-11,774,065.66
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）	27,475,226.11	2,334,421.97	29,809,648.08
项目	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 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）	39,812,826.22	18,283,031.27	58,095,857.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	4,120,009.55	4,120,009.55
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)	-6,641,699.26	-3,425,311.15	-10,067,010.41
其中：1. 基金申购款	5,422,026.29	2,742,706.13	8,164,732.42
2. 基金赎回款	-12,063,725.55	-6,168,017.28	-18,231,742.83
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）	33,171,126.96	18,977,729.67	52,148,856.63

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：

张翔燕

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中小盘混合型证券投资基金（原“信诚中小盘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”）《关于核准信诚中小盘股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]1357号文）批准，由中信保诚基金管理有限公司（原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》等相关法规和《信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2010 年 2 月 10 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集资金总额

人民币 603,918,903.05 元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保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《信诚中小盘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“信诚中小盘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。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》,经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准,公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”,并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

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《信诚中小盘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“信诚中小盘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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中小盘混合型证券投资基金基金合同》和《信诚中小盘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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60% - 95%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的 0 - 40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证不超过基金资产净值的 3%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于中小盘股票。本基金的业绩比较标准为 $40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

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。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2019 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。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的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《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]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》、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[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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。对资管产品在2018年1月1日以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 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。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东

英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
中信保诚人寿保险有限公司（“中信保诚人寿”）	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	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度均没有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年 12月31日)	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年12 月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	662,566.93	802,048.22
其中：支付销售机构的客户维护费	179,583.80	229,801.53

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 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×1.50%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年 12月31日)	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年12 月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	110,427.81	133,674.68

注：支付基金托管人中国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

7.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
基金合同生效日(2010 年 02 月 10 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,388,867.63	2,474,834.98
报告期间申购/买入总份额	-	1,914,032.65
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	4,388,867.63	-
报告期末持有的基金份额	-	4,388,867.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	13.23%

注: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。

7.4.8.4.2 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

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,本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)		上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 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
建设银行	8,577,582.65	54,850.30	10,760,909.23	64,196.28

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 2018 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 243,991.91 元。(2017 年 12 月 31 日余额为 96,304.78 元)。

7.4.8.6 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未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 21,119,747.72 元，无属于第二层次及第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次人民币 37,305,673.98 元，第二层次的余额为人民币 45,500.00 元，无属于第三层次的余额）。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2017 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 除以上事项外，截至本报告期末本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

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	21,119,747.72	63.72
	其中：股票	21,119,747.72	63.72
	基金投资	-	-
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	3,000,000.00	9.05
	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	8,821,574.56	26.61
7	其他各项资产	205,647.09	0.62
8	合计	33,146,969.37	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,043,227.59	30.34
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	736,092.00	2.47
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	7,189,037.13	24.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,409,851.00	8.08
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	1,741,540.00	5.84
S	综合	-	-
	合计	21,119,747.72	70.85

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 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

8.3.1 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	300450	先导智能	31,637	915,574.78	3.07
2	300383	光环新网	69,411	879,437.37	2.95
3	300098	高新兴	129,327	874,250.52	2.93
4	300451	创业软件	45,600	873,240.00	2.93
5	000681	视觉中国	37,400	872,168.00	2.93
6	300144	宋城演艺	40,720	869,372.00	2.92
7	002174	游族网络	46,600	866,294.00	2.91
8	300349	金卡智能	52,777	849,709.70	2.85
9	300316	晶盛机电	83,684	838,513.68	2.81
10	300036	超图软件	45,738	838,377.54	2.81

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	300166	东方国信	4,681,401.00	8.98
2	300463	迈克生物	4,096,066.00	7.85
3	300383	光环新网	3,797,778.00	7.28
4	300003	乐普医疗	3,785,622.00	7.26
5	000681	视觉中国	3,612,903.00	6.93
6	300558	贝达药业	3,568,771.00	6.84
7	002475	立讯精密	3,558,024.76	6.82
8	002236	大华股份	3,475,369.00	6.66
9	300059	东方财富	3,447,450.07	6.61
10	300271	华宇软件	3,415,194.27	6.55
11	300287	飞利信	3,350,147.40	6.42
12	002152	广电运通	3,241,923.25	6.22
13	603799	华友钴业	3,149,612.00	6.04
14	300145	中金环境	3,104,868.76	5.95
15	300618	寒锐钴业	3,056,498.00	5.86
16	002179	中航光电	2,967,640.13	5.69
17	600498	烽火通信	2,899,366.00	5.56
18	002223	鱼跃医疗	2,849,901.00	5.46
19	002410	广联达	2,849,006.43	5.46
20	600276	恒瑞医药	2,815,191.00	5.40
21	600585	海螺水泥	2,802,365.00	5.37
22	300367	东方网力	2,700,109.00	5.18
23	000066	中国长城	2,569,175.00	4.93
24	000513	丽珠集团	2,559,306.00	4.91
25	000977	浪潮信息	2,521,003.00	4.83
26	002727	一心堂	2,469,055.00	4.73
27	600038	中直股份	2,448,130.00	4.69
28	300144	宋城演艺	2,442,854.72	4.68
29	600845	宝信软件	2,421,558.40	4.64
30	300047	天源迪科	2,363,118.00	4.53
31	002343	慈文传媒	2,319,980.54	4.45
32	300418	昆仑万维	2,303,179.00	4.42
33	000002	万科 A	2,241,966.00	4.30
34	002439	启明星辰	2,229,309.00	4.27
35	600803	新奥股份	2,213,098.75	4.24
36	300324	旋极信息	2,212,313.00	4.24
37	000028	国药一致	2,201,409.00	4.22
38	002156	通富微电	2,173,847.40	4.17
39	300037	新宙邦	2,156,539.00	4.14

40	300088	长信科技	2,139,570.89	4.10
41	002019	亿帆医药	2,124,339.40	4.07
42	000528	柳工	2,109,765.00	4.05
43	600196	复星医药	2,109,036.80	4.04
44	002353	杰瑞股份	2,074,383.74	3.98
45	600256	广汇能源	2,052,168.00	3.94
46	300451	创业软件	2,035,601.00	3.90
47	002340	格林美	2,034,002.00	3.90
48	300316	晶盛机电	2,026,637.90	3.89
49	300253	卫宁健康	1,979,346.00	3.80
50	000069	华侨城 A	1,892,270.00	3.63
51	002007	华兰生物	1,884,577.00	3.61
52	002065	东华软件	1,879,149.00	3.60
53	002456	欧菲科技	1,877,300.99	3.60
54	300323	华灿光电	1,862,626.00	3.57
55	002050	三花智控	1,789,345.00	3.43
56	000661	长春高新	1,779,194.00	3.41
57	300182	捷成股份	1,746,182.00	3.35
58	300219	鸿利智汇	1,675,485.00	3.21
59	600183	生益科技	1,666,117.00	3.19
60	002023	海特高新	1,662,863.56	3.19
61	002142	宁波银行	1,615,929.00	3.10
62	300207	欣旺达	1,604,849.00	3.08
63	600588	用友网络	1,596,762.00	3.06
64	603883	老百姓	1,591,399.00	3.05
65	000333	美的集团	1,577,800.00	3.03
66	002146	荣盛发展	1,563,216.00	3.00
67	300097	智云股份	1,555,520.92	2.98
68	002396	星网锐捷	1,552,481.00	2.98
69	002624	完美世界	1,552,022.00	2.98
70	603111	康尼机电	1,550,875.00	2.97
71	300054	鼎龙股份	1,548,015.00	2.97
72	000651	格力电器	1,541,591.00	2.96
73	002013	中航机电	1,510,791.25	2.90
74	002262	恩华药业	1,507,748.00	2.89
75	300098	高新兴	1,501,754.00	2.88
76	002460	赣锋锂业	1,493,087.00	2.86
77	300070	碧水源	1,491,762.80	2.86
78	002466	天齐锂业	1,477,613.00	2.83
79	002078	太阳纸业	1,467,024.00	2.81
80	300349	金卡智能	1,465,652.52	2.81

81	300369	绿盟科技	1,461,999.00	2.80
82	600338	西藏珠峰	1,459,983.00	2.80
83	002383	合众思壮	1,457,292.00	2.79
84	603010	万盛股份	1,457,114.36	2.79
85	002472	双环传动	1,455,461.00	2.79
86	600172	黄河旋风	1,420,365.00	2.72
87	300178	腾邦国际	1,419,624.60	2.72
88	002717	岭南股份	1,418,975.00	2.72
89	600867	通化东宝	1,412,322.00	2.71
90	002382	蓝帆医疗	1,407,881.00	2.70
91	300024	机器人	1,404,053.00	2.69
92	600138	中青旅	1,402,281.44	2.69
93	300326	凯利泰	1,387,769.00	2.66
94	002422	科伦药业	1,358,191.00	2.60
95	600525	长园集团	1,335,436.00	2.56
96	601678	滨化股份	1,334,393.00	2.56
97	300357	我武生物	1,323,001.00	2.54
98	002202	金风科技	1,320,867.00	2.53
99	000768	中航飞机	1,316,760.00	2.53
100	300136	信维通信	1,316,209.00	2.52
101	002153	石基信息	1,305,061.00	2.50
102	002117	东港股份	1,283,593.00	2.46
103	300310	宜通世纪	1,281,382.00	2.46
104	000938	紫光股份	1,279,547.00	2.45
105	600271	航天信息	1,271,394.00	2.44
106	300058	蓝色光标	1,270,746.00	2.44
107	300244	迪安诊断	1,266,465.00	2.43
108	300450	先导智能	1,256,863.56	2.41
109	002174	游族网络	1,244,397.00	2.39
110	600491	龙元建设	1,238,155.00	2.37
111	300124	汇川技术	1,203,935.00	2.31
112	300408	三环集团	1,186,064.00	2.27
113	601699	潞安环能	1,160,877.00	2.23
114	603986	兆易创新	1,148,767.20	2.20
115	600373	中文传媒	1,140,307.00	2.19
116	600703	三安光电	1,130,744.00	2.17
117	300226	上海钢联	1,121,571.00	2.15
118	600499	科达洁能	1,115,172.00	2.14
119	002463	沪电股份	1,105,356.00	2.12
120	300607	拓斯达	1,103,543.00	2.12
121	300036	超图软件	1,082,212.00	2.08

122	300567	精测电子	1,079,296.00	2.07
123	600388	龙净环保	1,075,072.50	2.06
124	000921	海信科龙	1,074,779.00	2.06
125	002573	清新环境	1,074,166.00	2.06
126	600282	南钢股份	1,068,535.00	2.05
127	600487	亨通光电	1,066,471.00	2.05
128	002572	索菲亚	1,065,515.00	2.04
129	002405	四维图新	1,047,151.00	2.01

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。

8.4.2 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	002236	大华股份	4,980,375.00	9.55
2	300166	东方国信	4,526,783.78	8.68
3	603799	华友钴业	4,457,346.00	8.55
4	600276	恒瑞医药	4,046,748.24	7.76
5	300463	迈克生物	3,825,744.00	7.34
6	002475	立讯精密	3,569,605.18	6.85
7	300271	华宇软件	3,276,815.00	6.28
8	300059	东方财富	3,275,240.40	6.28
9	300287	飞利信	3,145,801.10	6.03
10	300145	中金环境	3,132,465.64	6.01
11	600183	生益科技	2,921,064.38	5.60
12	002410	广联达	2,914,578.84	5.59
13	600585	海螺水泥	2,911,430.00	5.58
14	002152	广电运通	2,895,506.91	5.55
15	300618	寒锐钴业	2,892,792.85	5.55
16	300003	乐普医疗	2,869,149.00	5.50
17	300383	光环新网	2,833,301.77	5.43
18	600703	三安光电	2,763,456.00	5.30
19	002179	中航光电	2,743,031.80	5.26
20	002223	鱼跃医疗	2,601,916.00	4.99
21	000681	视觉中国	2,594,307.41	4.97
22	300316	晶盛机电	2,518,039.08	4.83
23	600498	烽火通信	2,501,228.44	4.80
24	300367	东方网力	2,481,994.20	4.76
25	600031	三一重工	2,475,000.00	4.75
26	000066	中国长城	2,453,641.58	4.71
27	600172	黄河旋风	2,438,297.04	4.68
28	300418	昆仑万维	2,422,673.00	4.65

29	000977	浪潮信息	2,402,004.22	4.61
30	002343	慈文传媒	2,336,762.00	4.48
31	000513	丽珠集团	2,329,035.12	4.47
32	002353	杰瑞股份	2,303,185.00	4.42
33	600845	宝信软件	2,291,749.02	4.39
34	000528	柳工	2,246,847.00	4.31
35	000568	泸州老窖	2,215,187.00	4.25
36	300047	天源迪科	2,200,626.00	4.22
37	600519	贵州茅台	2,176,443.96	4.17
38	600256	广汇能源	2,169,094.00	4.16
39	300088	长信科技	2,130,685.00	4.09
40	300253	卫宁健康	2,083,879.00	4.00
41	600803	新奥股份	2,073,406.00	3.98
42	300037	新宙邦	2,058,703.00	3.95
43	002008	大族激光	2,055,730.79	3.94
44	300558	贝达药业	2,051,120.75	3.93
45	000028	国药一致	2,036,638.17	3.91
46	002456	欧菲科技	2,033,376.84	3.90
47	002019	亿帆医药	2,025,017.00	3.88
48	002156	通富微电	1,977,686.80	3.79
49	600196	复星医药	1,897,935.20	3.64
50	300324	旋极信息	1,896,276.60	3.64
51	002340	格林美	1,893,498.00	3.63
52	002007	华兰生物	1,876,518.00	3.60
53	000661	长春高新	1,873,413.00	3.59
54	300207	欣旺达	1,871,607.00	3.59
55	000858	五粮液	1,848,162.96	3.54
56	002065	东华软件	1,846,155.00	3.54
57	300144	宋城演艺	1,811,209.10	3.47
58	000069	华侨城 A	1,784,191.00	3.42
59	002146	荣盛发展	1,760,982.95	3.38
60	300323	华灿光电	1,738,360.00	3.33
61	002050	三花智控	1,722,718.00	3.30
62	002466	天齐锂业	1,720,200.00	3.30
63	002142	宁波银行	1,719,561.00	3.30
64	000651	格力电器	1,697,798.00	3.26
65	002023	海特高新	1,693,601.67	3.25
66	002460	赣锋锂业	1,690,856.00	3.24
67	600138	中青旅	1,681,894.11	3.23
68	000333	美的集团	1,681,119.00	3.22
69	000002	万科 A	1,662,234.30	3.19

70	600566	济川药业	1,646,965.00	3.16
71	002078	太阳纸业	1,645,263.00	3.15
72	002013	中航机电	1,623,723.75	3.11
73	002624	完美世界	1,593,853.48	3.06
74	002091	江苏国泰	1,587,411.00	3.04
75	300182	捷成股份	1,569,832.00	3.01
76	002185	华天科技	1,562,712.68	3.00
77	300054	鼎龙股份	1,554,422.00	2.98
78	300369	绿盟科技	1,553,446.00	2.98
79	300070	碧水源	1,545,198.20	2.96
80	601666	平煤股份	1,543,662.00	2.96
81	300219	鸿利智汇	1,536,631.00	2.95
82	603883	老百姓	1,526,609.00	2.93
83	600038	中直股份	1,493,215.00	2.86
84	600525	长园集团	1,479,154.08	2.84
85	002262	恩华药业	1,463,803.00	2.81
86	600588	用友网络	1,463,358.00	2.81
87	002126	银轮股份	1,461,185.01	2.80
88	600338	西藏珠峰	1,459,826.00	2.80
89	300024	机器人	1,456,267.00	2.79
90	002217	合力泰	1,449,810.18	2.78
91	002439	启明星辰	1,441,321.00	2.76
92	603010	万盛股份	1,433,337.00	2.75
93	600997	开滦股份	1,431,381.00	2.74
94	603111	康尼机电	1,406,937.00	2.70
95	300326	凯利泰	1,366,886.00	2.62
96	600499	科达洁能	1,364,810.00	2.62
97	600271	航天信息	1,347,441.00	2.58
98	300136	信维通信	1,345,389.00	2.58
99	300244	迪安诊断	1,343,180.00	2.58
100	002717	岭南股份	1,334,772.10	2.56
101	000768	中航飞机	1,330,596.00	2.55
102	600584	长电科技	1,327,124.05	2.54
103	002422	科伦药业	1,326,234.00	2.54
104	002202	金风科技	1,323,132.22	2.54
105	300349	金卡智能	1,323,073.88	2.54
106	300451	创业软件	1,293,323.00	2.48
107	300097	智云股份	1,274,622.00	2.44
108	601678	滨化股份	1,264,836.24	2.43
109	002727	一心堂	1,259,141.00	2.41
110	002153	石基信息	1,257,171.00	2.41

111	002430	杭氧股份	1,242,163.98	2.38
112	002117	东港股份	1,240,519.00	2.38
113	300178	腾邦国际	1,238,406.00	2.37
114	002463	沪电股份	1,233,766.00	2.37
115	300124	汇川技术	1,214,380.00	2.33
116	300357	我武生物	1,212,246.00	2.32
117	601699	潞安环能	1,192,115.00	2.29
118	600491	龙元建设	1,187,802.00	2.28
119	002472	双环传动	1,182,034.40	2.27
120	300058	蓝色光标	1,178,321.00	2.26
121	300310	宜通世纪	1,173,480.00	2.25
122	300408	三环集团	1,168,649.00	2.24
123	000938	紫光股份	1,154,910.00	2.21
124	002382	蓝帆医疗	1,152,198.00	2.21
125	300296	利亚德	1,140,209.91	2.19
126	002383	合众思壮	1,137,706.00	2.18
127	600373	中文传媒	1,124,896.00	2.16
128	002709	天赐材料	1,115,293.00	2.14
129	002180	纳思达	1,101,954.63	2.11
130	300009	安科生物	1,093,157.80	2.10
131	002405	四维图新	1,073,366.00	2.06
132	600718	东软集团	1,061,018.00	2.03
133	002572	索菲亚	1,060,712.00	2.03

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。

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	301,938,927.35
卖出股票收入(成交)总额	304,317,671.20

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

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

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

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

本基金投资范围不包括股指期货投资。

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

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明**

报告期内,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。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	36,980.87
2	应收证券清算款	163,636.37
3	应收股利	-
4	应收利息	1,770.29
5	应收申购款	3,259.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,647.09

8.12.4 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。

8.12.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 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不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息**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
2227	12,337.33	-	-	27,475,226.11	100.00%

9.2 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	179,674.51	0.65%

9.3 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

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	0

注：本基金基金经理于本报告期末未持有本开放式基金份额。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚中小盘混合
基金合同生效日(2010年02月10日)基金份额总额	603,918,903.05
本报告期期初基金份额总额	33,171,126.96
本报告期基金总申购份额	3,262,084.74
减:本报告期基金总赎回份额	8,957,985.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	27,475,226.11

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1. 报告期内基金管理人的专门基金托管部门无重大人事变动。
2. 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 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毕马威华振会计师事务所的报酬为人民币 25,000.00 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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	20,762,550.60	3.42%	18,920.96	3.54%	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	75,968,650.75	12.53%	70,750.09	13.22%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	10,938,261.92	1.80%	10,186.85	1.90%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	16,046,685.71	2.65%	14,623.29	2.73%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	13,337,487.24	2.20%	12,421.40	2.32%	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	本期新增 1 个交易单元
天风证券	3	57,658,718.71	9.51%	43,145.99	8.06%	本期新增 1 个交易单元
申银万国	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	24,416,342.83	4.03%	22,738.92	4.25%	-
华泰证券	2	90,571,142.97	14.94%	82,579.10	15.43%	本期新增 1

						个交易单元, 华泰证券已吸收合并联合证券华泰证券已吸收合并联合证券
华融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	14,223,937.13	2.35%	13,246.90	2.48%	-
宏源证券	3	19,075,735.82	3.15%	17,383.66	3.25%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	34,915,165.53	5.76%	24,834.84	4.64%	本期新增
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	9,543,869.00	1.57%	8,697.37	1.63%	-
东兴证券	1	48,170,408.63	7.95%	43,897.80	8.20%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	82,213,479.76	13.56%	74,921.31	14.00%	本期新增 1 个交易单元
大通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	69,444,979.71	11.45%	63,285.46	11.83%	-
长城证券	2	18,969,182.24	3.13%	13,492.54	2.52%	本期新增 1 个交易单元
财通证券	2	-	-	-	-	本期新增
安信证券	3	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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	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				的比例
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	3,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	119,033.20	36.68%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	205,512.20	63.32%	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

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

12.1 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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2019 年 3 月 8 日发布《中信保诚基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，经中信保诚基金管理有限公司第三届董事会第二十三次会议审议通过,自 2019 年 3 月 6 日起吕涛先生不再担任公司总经理职务,同日起由公司董事长张翔燕女士代为履行公司总经理职责。

中信保诚基金管理有限公司
2019 年 03 月 28 日