

信诚中小盘混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 06 月 30 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 08 月 26 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 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	27,162,291.42 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,本基金会进行最近三个月和未来 12 个月的分析 and 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:高速增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。</p>
业绩比较基准	$40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。
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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	2,844,060.62
本期利润	7,015,753.17
加权平均基金份额本期利润	0.2557
本期基金份额净值增长率	23.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配利润	9,326,743.49
期末可供分配基金份额利润	0.3434
期末基金资产净值	36,489,034.91
期末基金份额净值	1.343

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。

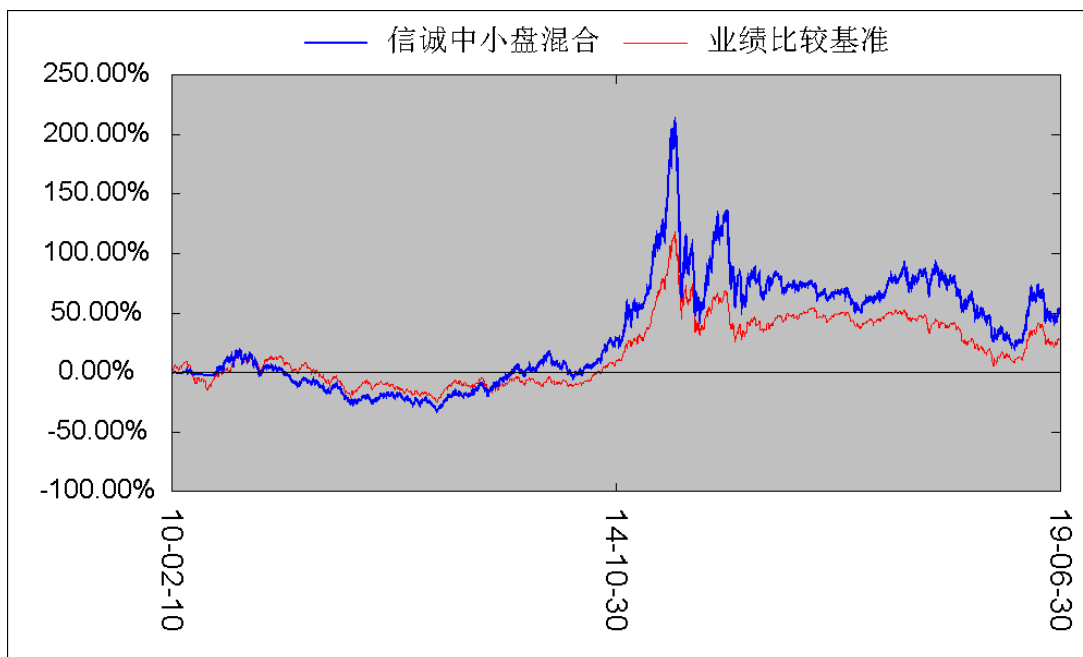
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.63%	1.58%	1.91%	1.04%	1.72%	0.54%
过去三个月	-7.44%	2.07%	-6.05%	1.37%	-1.39%	0.70%
过去六个月	23.78%	1.96%	16.79%	1.35%	6.99%	0.61%
过去一年	-5.22%	1.81%	0.09%	1.29%	-5.31%	0.52%
过去三年	-16.17%	1.47%	-11.05%	0.98%	-5.12%	0.49%
自基金合同生效起至今	52.22%	1.70%	27.27%	1.28%	24.95%	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%”。

§ 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 2019 年 6 月 30 日, 本基金管理人管理的运作中基金为 67 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、中信保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、信诚中证建设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、信诚智慧货币市场基金、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、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长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		
郑伟	本基金基金经理, 信诚新兴产业混合基金的基金经理。	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

2019 年上半年市场先扬后抑,1 月初最低点 2440 点,4 月初到了上半年行情的最高点 3288 点;5 月之后在中美贸易摩擦等因素影响下市场回调较大。其中以大盘蓝筹股为代表的极少数资产股价表现较好,成长类资产股价波动较大。

一季度货币信贷数据超出预期,经济数据表现较好;进入二季度,制造业投资持续不振,外需也在各种不利因素影响下有所下滑。周期性较强的行业如煤炭、钢铁、石油加工等行业盈利有较大压力。而市场经过下跌之后估值水平在历史平均水平的位置,股票资产的性价比相对较好。

上半年我们通过加强行业研究,积极精选投资标的,配置了半导体、计算机、通信、光伏、新能源汽车等板块,取得了一定投资收益。

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 23.78%,同期业绩比较基准收益率为 16.79%,基金超越业绩比较基准 6.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年来看,宏观经济下行的压力依然较大;但同时我们看到经济增长中新动能的因素在增强,以 5G 为先导的通信产业投资增长较快,科技基建成为细分领域增长的亮点。货币政策环境相对宽松,逆周期调节的宏观政策有望持续发力。减税等财政政策的效果在上市公司业绩层面也逐渐体现出来。外部环境的不确定性存在,但存在阶段性缓和的可能性;而且大国之间的摩擦也将长期存在,市场对此的预期也在不断修正。从全市场估值来看,目前的估值水平还是有一定吸引力的,结构性的投资机会不少。综合来看,我们对市场保持谨慎乐观的态度。

我们将继续沿着科技创新的大背景深入研究细分行业的投资机会,在以 5G 为驱动的信息产业变革中寻找优秀的投资标的,积极挖掘电子、通信产业中受益未来需求成长潜力大的优秀上市公司。同时看好新能源汽车、云计算、军工、医药、新消费等行业的投资机会。通过配置优质的成长股标的,力争为持有人创造收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金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。

4.8 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,本基金自 2018 年 5 月 23 日起至 2019 年 6 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合规守信、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: 信诚中小盘混合型证券投资基金

报告截止日: 2019 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 (2019 年 06 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
资产:			
银行存款	6.4.7.1	5,262,917.43	8,577,582.65
结算备付金		71,720.72	243,991.91
存出保证金		30,608.46	36,980.87
交易性金融资产	6.4.7.2	32,895,560.35	21,119,747.72
其中: 股票投资		32,845,370.27	21,119,747.72
基金投资		-	-
债券投资		50,190.08	-
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	-	3,000,000.00
应收证券清算款		-	163,636.37
应收利息	6.4.7.5	912.96	1,770.29
应收股利		-	-
应收申购款		2,864.30	3,259.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		38,264,584.22	33,146,969.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2019 年 06 月 30 日)	上年度末 (2018 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		731,235.83	2,704,842.78
应付赎回款		509,374.46	578.39
应付管理人报酬		44,025.60	39,112.16
应付托管费		7,337.59	6,518.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	64,824.26	106,769.27
应交税费		0.36	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	418,751.21	479,500.00
负债合计		1,775,549.31	3,337,321.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	27,162,291.42	27,475,226.11
未分配利润	6.4.7.10	9,326,743.49	2,334,421.97
所有者权益合计		36,489,034.91	29,809,648.08
负债和所有者权益总计		38,264,584.22	33,146,969.37

注：截止本报告期末，基金份额净值为 1.343 元，基金份额总额为 27,162,291.42 份。

6.2 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：2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 (2019 年 01 月 01 日 至 2019 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日)
一、收入		7,689,499.17	-3,834,760.91
1. 利息收入		21,084.75	29,251.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,615.77	29,147.05
债券利息收入		79.39	104.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		389.59	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,490,293.80	-871,766.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,358,997.79	-1,088,088.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-16.01	24,810.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	131,312.02	191,511.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,171,692.55	-2,994,084.24

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	6,428.07	1,837.70
减：二、费用		673,746.00	983,706.41
1. 管理人报酬		266,066.70	372,758.05
2. 托管费		44,344.40	62,126.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	340,889.48	530,832.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.20	0.36
7. 其他费用	6.4.7.20	22,445.22	17,989.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,015,753.17	-4,818,467.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,015,753.17	-4,818,467.32

6.3 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：2019年01月01日-2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至2019年06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）	27,475,226.11	2,334,421.97	29,809,648.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	7,015,753.17	7,015,753.17
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)	-312,934.69	-23,431.65	-336,366.34
其中：1. 基金申购款	3,955,254.84	1,539,030.25	5,494,285.09
2. 基金赎回款	-4,268,189.53	-1,562,461.90	-5,830,651.43
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）	27,162,291.42	9,326,743.49	36,489,034.91
项目	上年度可比期间 (2018年01月01日至2018年06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）	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)	-	-4,818,467.32	-4,818,467.32
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)	-1,357,860.37	-900,731.20	-2,258,591.57

其中：1. 基金申购款	1,709,621.86	953,028.88	2,662,650.74
2. 基金赎回款	-3,067,482.23	-1,853,760.08	-4,921,242.31
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）	31,813,266.59	13,258,531.15	45,071,797.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

唐世春

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%×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。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)
----	---	--

当期发生的基金应支付的管理费	266,066.70	372,758.05
其中：支付销售机构的客户维护费	83,768.24	99,120.38

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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至 2019年06月30日)	上年度可比期间 (2018年01月01日至2018年 06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	44,344.40	62,126.29

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 (2019年01月01日至 2019年06月30日)	上年度可比期间 (2018年01月01日至 2018年06月30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
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	4,388,867.63
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	-	13.80%

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。本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 (2019年01月01日至2019年06月 30日)		上年度可比期间 (2018年01月01日至2018年06月 30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	5,262,917.43	18,688.18	8,677,307.86	26,406.48

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 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 71,720.72 元。（2018 年 6 月 30 日余额为 370,526.75 元）。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 2019 年 6 月 30 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 32,895,560.35 元，无属于第二层次及第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第一层次人民币 21,119,747.72 元，无属于第二层次及第三层次的余额）。

(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 2019 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2018 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（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。

§ 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	32,845,370.27	85.84
	其中：股票	32,845,370.27	85.84
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	50,190.08	0.13
	其中：债券	50,190.08	0.13
	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	5,334,638.15	13.94
7	其他各项资产	34,385.72	0.09
8	合计	38,264,584.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	21,090,135.68	57.80
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	11,755,234.59	32.22
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	32,845,370.27	90.01

7.2.2 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。

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	300316	晶盛机电	135,284	1,716,753.96	4.70
2	002129	中环股份	171,225	1,671,156.00	4.58
3	002371	北方华创	18,300	1,267,275.00	3.47
4	000063	中兴通讯	34,400	1,119,032.00	3.07
5	002439	启明星辰	41,567	1,118,152.30	3.06
6	300394	天孚通信	38,900	1,074,418.00	2.94
7	300450	先导智能	31,637	1,063,003.20	2.91
8	600745	闻泰科技	31,166	1,035,334.52	2.84
9	603986	兆易创新	11,800	1,023,060.00	2.80
10	300451	创业慧康	68,399	1,022,565.05	2.80

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	300383	光环新网	3,263,805.00	10.95
2	300059	东方财富	2,821,902.00	9.47
3	600501	航天晨光	2,760,065.00	9.26
4	600458	时代新材	2,342,412.77	7.86
5	600498	烽火通信	2,214,286.00	7.43
6	300113	顺网科技	2,112,260.00	7.09
7	000977	浪潮信息	1,914,993.12	6.42
8	600118	中国卫星	1,909,641.00	6.41
9	300170	汉得信息	1,897,930.00	6.37
10	300408	三环集团	1,819,546.00	6.10
11	002129	中环股份	1,676,505.00	5.62
12	002123	梦网集团	1,656,807.96	5.56
13	600703	三安光电	1,614,725.00	5.42
14	002191	劲嘉股份	1,436,493.00	4.82
15	000938	紫光股份	1,414,190.00	4.74
16	600999	招商证券	1,398,021.89	4.69
17	002916	深南电路	1,360,543.00	4.56
18	002236	大华股份	1,321,388.00	4.43
19	002407	多氟多	1,287,604.00	4.32
20	300558	贝达药业	1,250,667.75	4.20

21	600273	嘉化能源	1,205,377.00	4.04
22	300348	长亮科技	1,184,231.50	3.97
23	300377	赢时胜	1,180,733.00	3.96
24	002230	科大讯飞	1,164,588.00	3.91
25	300166	东方国信	1,164,534.00	3.91
26	601222	林洋能源	1,163,583.00	3.90
27	600718	东软集团	1,162,849.00	3.90
28	603986	兆易创新	1,146,598.00	3.85
29	600570	恒生电子	1,125,034.90	3.77
30	002180	纳思达	1,123,795.00	3.77
31	000681	视觉中国	1,083,291.00	3.63
32	300604	长川科技	1,070,804.00	3.59
33	300394	天孚通信	1,065,323.00	3.57
34	002548	金新农	1,061,226.00	3.56
35	002465	海格通信	1,040,110.00	3.49
36	601788	光大证券	1,036,697.00	3.48
37	300367	东方网力	1,015,178.00	3.41
38	603083	剑桥科技	1,013,856.00	3.40
39	600745	闻泰科技	1,013,850.00	3.40
40	002368	太极股份	1,000,755.00	3.36
41	002281	光迅科技	976,204.00	3.27
42	000063	中兴通讯	972,149.00	3.26
43	002126	银轮股份	970,917.00	3.26
44	002396	星网锐捷	950,976.00	3.19
45	002409	雅克科技	932,330.00	3.13
46	002925	盈趣科技	919,764.00	3.09
47	603328	依顿电子	904,893.00	3.04
48	601012	隆基股份	892,142.00	2.99
49	600438	通威股份	890,736.00	2.99
50	300133	华策影视	884,996.00	2.97
51	603605	珀莱雅	882,997.00	2.96
52	300324	旋极信息	882,855.00	2.96
53	300168	万达信息	870,829.00	2.92
54	300119	瑞普生物	870,251.00	2.92
55	600895	张江高科	865,058.68	2.90
56	600728	佳都科技	848,505.00	2.85
57	300684	中石科技	844,402.00	2.83
58	002049	紫光国微	836,395.24	2.81
59	300054	鼎龙股份	832,766.00	2.79
60	300017	网宿科技	824,009.00	2.76
61	002373	千方科技	821,566.60	2.76

62	300578	会畅通讯	817,469.60	2.74
63	300061	康旗股份	815,843.40	2.74
64	603160	汇顶科技	803,250.00	2.69
65	300395	菲利华	799,526.00	2.68
66	603019	中科曙光	790,744.00	2.65
67	000581	威孚高科	779,319.00	2.61
68	002384	东山精密	773,144.00	2.59
69	002920	德赛西威	770,828.00	2.59
70	600372	中航电子	769,479.00	2.58
71	002383	合众思壮	766,998.00	2.57
72	002518	科士达	766,400.00	2.57
73	000671	阳光城	765,312.00	2.57
74	600048	保利地产	765,180.00	2.57
75	300630	普利制药	762,046.00	2.56
76	600256	广汇能源	752,028.00	2.52
77	600990	四创电子	749,073.00	2.51
78	002371	北方华创	742,996.00	2.49
79	300033	同花顺	741,352.00	2.49
80	300498	温氏股份	735,026.00	2.47
81	300590	移为通信	730,294.00	2.45
82	603636	南威软件	711,218.00	2.39
83	300496	中科创达	697,038.00	2.34
84	600422	昆药集团	676,096.00	2.27
85	601633	长城汽车	672,839.00	2.26
86	002341	新纶科技	652,942.00	2.19
87	002456	欧菲光	641,945.00	2.15
88	002095	生意宝	633,441.37	2.12
89	300207	欣旺达	622,428.00	2.09
90	002322	理工环科	616,602.00	2.07
91	002422	科伦药业	613,597.00	2.06
92	603678	火炬电子	609,074.00	2.04
93	002285	世联行	608,791.00	2.04
94	002174	游族网络	602,420.00	2.02
95	002555	三七互娱	601,990.00	2.02

买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300383	光环新网	3,153,947.48	10.58
2	600501	航天晨光	2,900,838.08	9.73

3	600458	时代新材	2,422,301.52	8.13
4	300170	汉得信息	2,298,630.00	7.71
5	300059	东方财富	2,266,345.00	7.60
6	600498	烽火通信	2,209,756.00	7.41
7	000681	视觉中国	2,073,691.20	6.96
8	002916	深南电路	2,060,599.04	6.91
9	600118	中国卫星	2,054,096.84	6.89
10	300408	三环集团	1,834,873.00	6.16
11	300558	贝达药业	1,822,742.00	6.11
12	002123	梦网集团	1,780,972.00	5.97
13	002409	雅克科技	1,772,830.00	5.95
14	300017	网宿科技	1,707,240.00	5.73
15	002396	星网锐捷	1,642,018.00	5.51
16	600703	三安光电	1,551,830.00	5.21
17	600999	招商证券	1,539,428.08	5.16
18	600038	中直股份	1,493,516.00	5.01
19	002174	游族网络	1,446,256.00	4.85
20	000938	紫光股份	1,435,687.00	4.82
21	002191	劲嘉股份	1,408,050.00	4.72
22	000671	阳光城	1,354,679.00	4.54
23	600048	保利地产	1,329,916.00	4.46
24	300308	中际旭创	1,290,135.00	4.33
25	300377	赢时胜	1,277,180.34	4.28
26	002407	多氟多	1,272,164.00	4.27
27	000977	浪潮信息	1,226,178.00	4.11
28	002373	千方科技	1,214,701.80	4.07
29	603160	汇顶科技	1,182,470.50	3.97
30	601222	林洋能源	1,174,093.00	3.94
31	603019	中科曙光	1,165,389.00	3.91
32	002180	纳思达	1,150,411.26	3.86
33	600728	佳都科技	1,146,999.80	3.85
34	300456	耐威科技	1,130,599.00	3.79
35	600273	嘉化能源	1,116,332.00	3.74
36	300604	长川科技	1,105,161.00	3.71
37	002236	大华股份	1,094,905.00	3.67
38	600570	恒生电子	1,086,326.00	3.64
39	300113	顺网科技	1,086,021.00	3.64
40	300166	东方国信	1,079,662.84	3.62
41	300349	金卡智能	1,058,066.73	3.55
42	601788	光大证券	1,043,985.00	3.50
43	300119	瑞普生物	1,042,946.00	3.50

44	600718	东软集团	1,010,800.00	3.39
45	002548	金新农	995,346.00	3.34
46	002230	科大讯飞	990,720.00	3.32
47	002281	光迅科技	988,120.00	3.31
48	002126	银轮股份	979,481.12	3.29
49	300578	会畅通讯	956,585.00	3.21
50	300630	普利制药	945,275.00	3.17
51	002415	海康威视	921,374.40	3.09
52	002465	海格通信	905,392.00	3.04
53	300367	东方网力	903,824.00	3.03
54	300168	万达信息	903,332.82	3.03
55	300054	鼎龙股份	902,407.00	3.03
56	002727	一心堂	895,896.00	3.01
57	603328	依顿电子	895,839.00	3.01
58	300324	旋极信息	878,750.00	2.95
59	002925	盈趣科技	876,042.00	2.94
60	600895	张江高科	872,460.00	2.93
61	002383	合众思壮	869,872.00	2.92
62	300133	华策影视	859,130.00	2.88
63	603605	珀莱雅	850,863.00	2.85
64	002322	理工环科	835,404.00	2.80
65	300684	中石科技	797,766.00	2.68
66	300144	宋城演艺	779,449.20	2.61
67	000581	威孚高科	771,106.00	2.59
68	601633	长城汽车	764,568.00	2.56
69	002384	东山精密	749,291.00	2.51
70	300061	康旗股份	747,759.70	2.51
71	002518	科士达	739,141.00	2.48
72	300482	万孚生物	732,922.40	2.46
73	600256	广汇能源	731,260.00	2.45
74	300003	乐普医疗	722,453.00	2.42
75	300498	温氏股份	715,868.00	2.40
76	300036	超图软件	714,302.80	2.40
77	600422	昆药集团	702,619.00	2.36
78	603678	火炬电子	697,450.00	2.34
79	603636	南威软件	689,241.00	2.31
80	002095	生意宝	684,874.00	2.30
81	002456	欧菲光	654,038.00	2.19
82	300348	长亮科技	648,276.00	2.17
83	600641	万业企业	639,995.00	2.15
84	002341	新纶科技	611,442.00	2.05

85	002422	科伦药业	609,103.00	2.04
86	000002	万 科 A	602,454.00	2.02
87	600584	长电科技	599,804.00	2.01

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	117,193,428.08
卖出股票收入(成交)总额	112,993,505.79

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	50,190.08	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,190.08	0.14

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	128061	启明转债	452	50,190.08	0.14

本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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**

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 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

本基金投资的前十名股票中,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,608.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	912.96
5	应收申购款	2,864.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,385.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

2148	12,645.39	-	-	27,162,291.42	100.00%
------	-----------	---	---	---------------	---------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	62,397.95	0.23%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有 本开放式基金	0~10
本基金基金经理持 有本开放式基金	0

期末本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 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	27,475,226.11
本报告期基金总申购份额	3,955,254.84
减:本报告期基金总赎回份额	4,268,189.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,162,291.42

§ 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

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：

吕涛先生于 2019 年 3 月 6 日离任公司总经理职务，同日起公司董事长张翔燕女士代为履行总经理职务；唐世春先生于 2019 年 6 月 3 日新任公司总经理职务，同日起，唐世春先生离任公司副总经理职务、张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述事项已按监管要求备案并公告。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	17,304,014.82	7.52%	16,115.21	7.77%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	本期新增
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	本期新增
银河证券	2	6,522,055.68	2.83%	6,074.07	2.93%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	2,526,939.72	1.10%	2,353.29	1.13%	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	本期新增
天风证券	3	51,826,980.03	22.52%	47,508.87	22.90%	-

申万宏源	4	68,028,685.91	29.55%	61,994.84	29.88%	本期新增
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	30,649,315.56	13.31%	28,544.10	13.76%	-
金通证券	1	-	-	-	-	本期新增
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	本期新增
红塔证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	本期新增
国信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	1,107,217.00	0.48%	809.73	0.39%	本期新增
高盛高华	1	-	-	-	-	本期新增
方正证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	34,639,784.62	15.05%	31,567.33	15.22%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	17,581,940.53	7.64%	12,506.00	6.03%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	本期新增
安信证券	3	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	本期退租
宏源证券	3	-	-	-	-	本期退租
申银万国	1	-	-	-	-	本期退租
中信金通	1	-	-	-	-	本期退租

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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		购成交总额的比例		权证成交总额的比例
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	53,627.22	35.18%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	98,800.00	64.82%	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

高盛高华	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-

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 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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中信保诚基金管理有限公司
2019 年 08 月 26 日