

## 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告

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。

### 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
§ 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 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
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 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
§ 5 托管人报告 .....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	10
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 .....	10
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 .....	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	10
6.1 资产负债表 .....	10
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 .....	13
§ 7 投资组合报告 .....	29
7.1 期末基金资产组合情况 .....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	29
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 .....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	46
§ 8 基金份额持有人信息 .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
§ 9 开放式基金份额变动 .....	49
§ 10 重大事件揭示 .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
§ 12 备查文件目录 .....	55
12.1 备查文件名称 .....	55
12.2 备查文件存放地点 .....	55
12.3 备查文件查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	信诚中证 500 指数分级		
场内简称	信诚 500		
基金主代码	165511		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 02 月 11 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	159,446,277.69 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	2011 年 3 月 14 日		
下属分级基金的基金简称	信诚中证 500 指数 分级 A	信诚中证 500 指数 分级 B	信诚中证 500 指数 分级
下属分级基金的场内简称	中证 500A	中证 500B	信诚 500
下属分级基金的交易代码	150028	150029	165511
报告期末下属分级基金的份额总额	22,028,700.00 份	33,043,051.00 份	104,374,526.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 500 指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。		
投资策略	<p>本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</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%×中证 500 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。		
下属分级基金的风险收益特征	信诚中证 500 A 份	信诚中证 500 B 份	本基金为跟踪指数

	额具有低风险、收益相对稳定的特征。	额具有高风险、高预期收益的特征。	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		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	中国证券报
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

### 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

## § 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	11,283,053.76
本期利润	26,443,396.44

加权平均基金份额本期利润	0.1662
本期加权平均净值利润率	16.18%
本期基金份额净值增长率	18.65%
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	16,733,167.83
期末可供分配基金份额利润	0.1049
期末基金资产净值	164,441,216.81
期末基金份额净值	1.031
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)
基金份额累计净值增长率	30.31%

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。

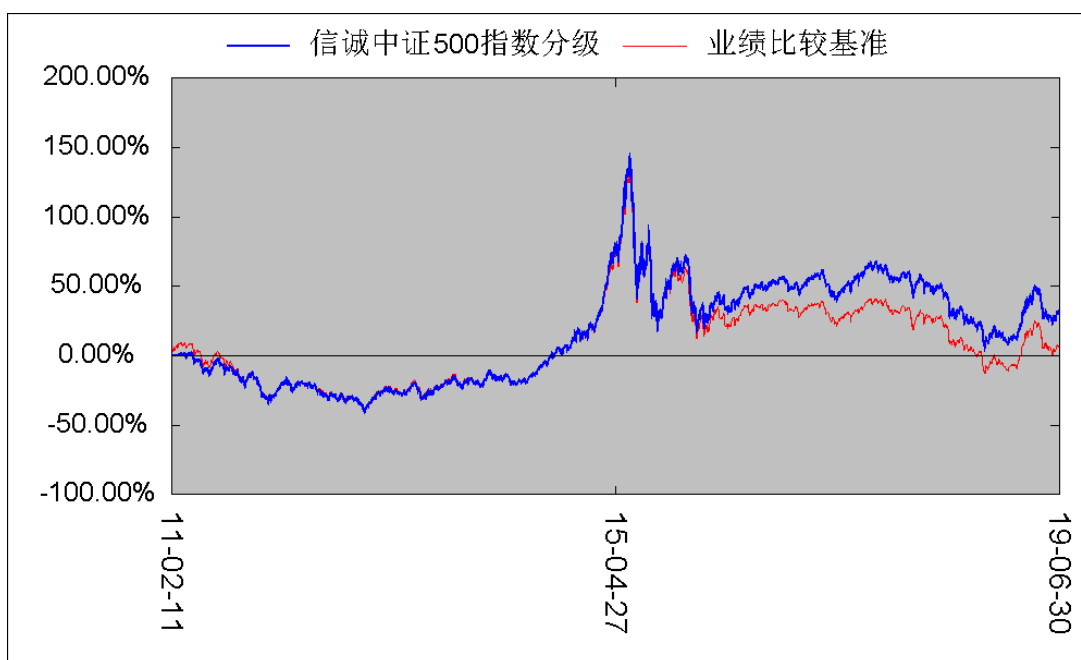
### 3.2 基金净值表现

#### 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	1.78%	1.26%	0.76%	1.32%	1.02%	-0.06%
过去三个月	-8.27%	1.66%	-10.20%	1.72%	1.93%	-0.06%
过去六个月	18.65%	1.61%	17.88%	1.70%	0.77%	-0.09%
过去一年	-2.01%	1.53%	-4.68%	1.60%	2.67%	-0.07%
过去三年	-8.06%	1.21%	-17.95%	1.25%	9.89%	-0.04%
自基金合同生效起至今	30.31%	1.61%	6.17%	1.61%	24.14%	-

注:本基金的业绩比较标准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率。

#### 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:本基金建仓日自 2011 年 2 月 11 日至 2011 年 8 月 10 日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 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、信诚中证基建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、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		
黄稚	本基金基金经理，信诚中证建设工程指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。	2018年07月25日	-	7	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月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任信诚中证 500 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)的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 500 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

回顾 2019 年上半年,在一季度中美贸易摩擦阶段性缓和,宏观经济数据显示出边际改善迹象,北上资金流入,投资者风险偏好有所提升,市场经历了宽松预期上修和增长预期上修驱动的上漲行情。但在二季度,数据显示经济内生动能仍然不足,短期内经济仍存在下行压力,宏观经济数据整体偏弱带来的基本面预期修正,货币政策边际收紧。同时中美贸易摩擦的反复对市场带来较大的冲击,市场风险偏好急速下降,A 股市场在 4 月下旬出现较大幅度回调,整体成交量较前期有所下降。报告期内,上证综指上涨 19.45%,沪深 300 上涨 27.07%,中证 500 上涨 18.77%,其中食品饮料、非银金融、农林牧渔、家用电器、计算机等行业涨幅居前,而建筑装饰、钢铁、传媒、纺织服装等行业涨幅靠后。

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数。报告期内,本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上,采用数量化方法构建指数化投资组合,实现对标的指数的有效跟踪;本基金认真应对投资者日常申购、赎回,根据市场情况、成分股停复牌等合理安排权益仓位和头寸,有效管理跟踪误差。本基金运用股指期货进行多头套保以提高投资效率,同时,积极参与网下新股申购,以提高基金收益。

##### 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 18.65%,同期业绩比较基准收益率为 17.88%,基金超越业绩比较基准 0.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年国内经济平稳放缓,全球经济增速及外需趋缓,国内经济增长传统动能仍然偏弱,宽货币到宽信用的传导仍待解决,短期内包商银行事件对信用环境有一定程度影响。展望下半年经济形势,我国经济处于从高速增长向高质量发展的转型期,经济仍面临下行压力和结构调整压力,3 季度经济基本面和企业盈利或将延续下行。影响下半年经济形势的关键变量是中美贸易摩擦和宏观政策逆周期调节,前者的影响正逐步长期化。如果贸易影响有所加剧,经济下行压力较大,国内宏观政策逆周期调节或将进一步加码,有望带动经济逐步企稳。与此同时,美联储结束加息周期,全球新一轮货币宽松周期开启,国内通胀压力回落,为政策提供进一步宽松的空间,利于市场流动性的改善,对市场可能形成一定支撑。

今年以来 A 股市场估值从底部回归到历史中枢附近,A 股隐含风险溢价也处于中部区间,但盈利支撑相对较弱。展望下半年 A 股市场,在企业盈利出现较为明确的企稳信号之前,中美贸易摩擦和国内宏观政策调整仍是影响估值波动的主要因素,资本市场改革的积极推进为近期市场风险偏好提供了一定支撑,外资重新流入带来资金风险偏好的修复,市场可能仍以宽幅震荡为主;企业盈利企稳过程中,市场将实现从分母端向分子端的过渡。

#### 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

根据基金合同的约定,本基金(包括信诚中证 500 指数分级、信诚中证 500 指数分级 A、信诚中证 500 指数分级 B)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二百人)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:信诚中证 500 指数分级证券投资基金

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)
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,216,313.55	11,564,654.91
结算备付金		1,537,255.98	1,371,564.14
存出保证金		286,533.79	337,956.73
交易性金融资产	6.4.7.2	153,593,480.60	132,075,214.99
其中：股票投资		153,532,480.60	132,075,214.99
基金投资		-	-
债券投资		61,000.00	-
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		-	210,449.00
应收利息	6.4.7.5	2,198.92	2,647.52
应收股利		-	-
应收申购款		90,778.10	80,338.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		165,726,560.94	145,642,825.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 (2019 年 06 月 30 日)</b>	<b>上年度末 (2018 年 12 月 31 日)</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		236,485.87	772,278.63
应付管理人报酬		132,171.58	125,500.82
应付托管费		29,077.73	27,610.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	171,611.69	277,969.25
应交税费		0.14	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	715,997.12	807,938.11
负债合计		1,285,344.13	2,011,296.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	126,079,498.04	130,666,020.38

未分配利润	6.4.7.10	38,361,718.77	12,965,507.95
所有者权益合计		164,441,216.81	143,631,528.33
负债和所有者权益总计		165,726,560.94	145,642,825.31

注：截止本报告期末，基金份额总额 159,446,277.69 份，信诚中证 500 指数分级的基金份额净值 1.031 元，基金份额总额 104,374,526.69 份。下属分级基金：：信诚 500A 的基金份额净值 1.019 元，基金份额总额 22,028,700.00 份；信诚 500B 的基金份额净值 1.039 元，基金份额总额 33,043,051.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

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)
<b>一、收入</b>		28,263,913.19	-38,147,998.88
1. 利息收入		45,351.88	89,241.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,297.14	89,225.79
债券利息收入		54.74	15.95
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）		13,004,161.56	-24,038,893.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,913,532.57	-25,443,272.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	30,983.53	17,292.82
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	-463,972.04	-442,135.15
股利收益	6.4.7.16	1,523,617.50	1,829,221.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,160,342.68	-14,370,745.07
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	54,057.07	172,398.35
<b>减：二、费用</b>		1,820,516.75	4,208,890.05
1. 管理人报酬		805,998.68	1,494,412.85
2. 托管费		177,319.73	328,770.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	565,105.97	2,020,663.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		208.31	30.65
7. 其他费用	6.4.7.20	271,884.06	365,012.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		26,443,396.44	-42,356,888.93

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		26,443,396.44	-42,356,888.93

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

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）	130,666,020.38	12,965,507.95	143,631,528.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	26,443,396.44	26,443,396.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-4,586,522.34	-1,047,185.62	-5,633,707.96
其中：1. 基金申购款	25,589,824.13	7,835,023.73	33,424,847.86
2. 基金赎回款	-30,176,346.47	-8,882,209.35	-39,058,555.82
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）	126,079,498.04	38,361,718.77	164,441,216.81
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）	196,600,263.80	109,647,656.15	306,247,919.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-42,356,888.93	-42,356,888.93
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)	-2,498,731.14	-3,145,200.50	-5,643,931.64
其中：1. 基金申购款	88,120,491.37	44,979,740.84	133,100,232.21
2. 基金赎回款	-90,619,222.51	-48,124,941.34	-138,744,163.85
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）	194,101,532.66	64,145,566.72	258,247,099.38

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

基金管理人负责人

陈逸辛

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

信诚中证 500 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”）《关于核准信诚中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1877 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》及其配套规则和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合

同于 2011 年 2 月 11 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 374, 254, 300. 10 份基金份额。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]第 76 号文审核同意, 本基金信诚 500A 份额 10, 134, 545. 00 份及信诚 500B 为 15, 201, 819. 00 份基金份额于 2011 年 3 月 14 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中, 中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等, 权证投资占基金资产净值的比例为 0 - 3%, 其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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。本基金的业绩比较标准为 95%×中证 500 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 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 (2019 年 06 月 30 日)
活期存款	10,216,313.55
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	10,216,313.55

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2019 年 06 月 30 日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	152,123,672.45	153,532,480.60	1,408,808.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	61,000.00	61,000.00	-
银行间市场	-	-	-
合计	61,000.00	61,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	152,184,672.45	153,593,480.60	1,408,808.15

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2019 年 06 月 30 日)			
	公允价值			
	合同/名义 金额	资产	负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,780,560.00	-	-	-
IC1912	1,780,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,780,560.00	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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 2019 年 06 月 30 日



应收活期存款利息	1,840.77
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	117.18
应收债券利息	3.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.66
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	236.66
合计	2,198.92

注：其他指应收结算保证金利息和中金所清算备付金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	171,611.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	171,611.69

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	362.16
预提上市费	29,752.78
预提审计费	69,424.36
预提信息披露费	561,907.82
应付指数使用费	50,050.00
预提账户维护费	4,500.00
合计	715,997.12

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至2019年06月30日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	161,887,338.06	130,666,020.38
本期申购	3,405,421.01	2,748,605.72
本期赎回(以“-”号填列)	-12,250,439.92	-9,887,362.15
2019年02月01日基金拆分/份额折算前	153,042,319.15	123,527,263.95

基金拆分/份额折算调整	3,174,017.62	-
本期申购	28,888,361.44	22,841,218.41
本期赎回(以“-”号填列)	-25,658,420.52	-20,288,984.32
本期末	159,446,277.69	126,079,498.04

注：1、此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》的规定，信诚中证 500 的份额自基金合同生效日起每一年的运作周期到期日前折算一次。

在信诚中证 500 折算基准日日终，信诚中证 500 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的信诚中证 500 份额数按折算比例相应增减。在报告期内，2019 年 2 月 1 日为信诚 500 的折算基准日。

#### 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	5,598,496.33	7,367,011.62	12,965,507.95
本期利润	11,283,053.76	15,160,342.68	26,443,396.44
本期基金份额交易产生的变动数	-148,382.26	-898,803.36	-1,047,185.62
其中：基金申购款	2,025,484.10	5,809,539.63	7,835,023.73
基金赎回款	-2,173,866.36	-6,708,342.99	-8,882,209.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,733,167.83	21,628,550.94	38,361,718.77

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
活期存款利息收入	39,185.82
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	3,158.91
其他	2,952.41
合计	45,297.14

注：1、其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款的利息收入。

2、其他指申购款利息收入，结算保证金利息收入，中金所存款利息收入。

#### 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 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
卖出股票成交总额	200,608,455.11
减：卖出股票成本总额	188,694,922.54
买卖股票差价收入	11,913,532.57

#### 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 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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	30,983.53
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	30,983.53

**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 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	237,436.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	206,400.00
减：应收利息总额	52.90
买卖债券差价收入	30,983.53

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
股指期货投资收益	-463,972.04

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
股票投资产生的股利收益	1,523,617.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,523,617.50

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
1. 交易性金融资产	15,017,862.68
——股票投资	15,017,862.68

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	142,480.00
——权证投资	-
股指期货	142,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	15,160,342.68

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至2019年06月30日)
基金赎回费收入	54,043.04
转换费收入	14.03
合计	54,057.07

注：1. 本基金的场外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至2019年06月30日)
交易所市场交易费用	564,599.54
银行间市场交易费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
交易费用-股指期货交易费用	506.43
合计	565,105.97

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2019年01月01日至2019年06月30日)
审计费用	69,424.36
信息披露费	61,907.82
银行费用	1,749.10
账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,050.00
基金上市费	29,752.78

合计	271,884.06
----	------------

6.4.7.20 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

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日,本基金并无须作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
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	基金管理人、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。

6.4.10 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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 (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	805,998.68	1,494,412.85
其中:支付销售机构的客户维护费	271,799.15	280,928.69

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 1.00%的费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数

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
----	----	---------

	(2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)	(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	177,319.73	328,770.80

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 0.22%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

#### 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

本基金在本报告期与上年度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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行,本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

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。

#### 6.4.10.5 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 (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	10,216,313.55	39,185.82	18,789,483.65	72,234.36

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 289,353.21 元(2018 年 6 月 30 日:人民币 2,822,703.99 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

本基金在本报告期与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019 年 06 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
601236	红塔证券	2019 年 06 月 26 日	2019 年 07 月 05 日	网下新股申购未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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
113027	华钰转债	2019年 06月18 日	2019年 07月10 日	网下 新债 申购 未上 市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-
113028	环境转债	2019年 06月20 日	2019年 07月08 日	网下 新债 申购 未上 市	100.00	100.00	580	58,000.00	58,000.00	-

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 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

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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于跟踪指数的股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票等,股票资产占基金资产的比例较高。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设。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;公司设立独立的监察稽核部和风险管理部,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。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险,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对风险进行持续监控。

##### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行,本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 (2019 年 06 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
AAA	58,000.00	-
AAA 以下	3,000.00	-
未评级	-	-
合计	61,000.00	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同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**

**6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股



票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。）

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及股票等。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 (2019 年 06 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	10,216,313.55	-	-	-	-	-	10,216,313.55
结算备付金	1,537,255.98	-	-	-	-	-	1,537,255.98
存出保证金	286,533.79	-	-	-	-	-	286,533.79
交易性金融资产	-	-	-	-	61,000.00	153,532,480.60	153,593,480.60

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,198.92	2,198.92
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	90,778.10	90,778.10
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,040,103.32	-	-	-	61,000.00	153,625,457.62	165,726,560.94
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	236,485.87	236,485.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	132,171.58	132,171.58
应付托管费	-	-	-	-	-	29,077.73	29,077.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	171,611.69	171,611.69
应交税费	-	-	-	-	-	0.14	0.14
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	715,997.12	715,997.12
负债总计	-	-	-	-	-	1,285,344.13	1,285,344.13
利率敏感度缺口	12,040,103.32	-	-	-	61,000.00	152,340,113.49	164,441,216.81
上年度末 (2018 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	11,564,654.91	-	-	-	-	-	11,564,654.91
结算备付金	1,371,56	-	-	-	-	-	1,371,56

	4.14						4.14
存出保证金	337,956.73	-	-	-	-	-	337,956.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	132,075,214.99	132,075,214.99
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	210,449.00	210,449.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,647.52	2,647.52
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	80,338.02	80,338.02
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,274,175.78	-	-	-	-	132,368,649.53	145,642,825.31
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	772,278.63	772,278.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	125,500.82	125,500.82
应付托管费	-	-	-	-	-	27,610.17	27,610.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	277,969.25	277,969.25
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	807,938.11	807,938.11
负债总计	-	-	-	-	-	2,011,296.98	2,011,296.98
利率敏感度缺口	13,274,175.78	-	-	-	-	130,357,352.55	143,631,528.33

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负债的公允价值，并按照合约规定的利率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

于本报告期末及上年度末,本基金持有对利率敏感的交易性债券资产的比例较低。因此,市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指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价格风险。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的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%。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。

本基金持有有一定比例的证券交易所上市的股票,因此存在相应的其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末(2019年06月30日)		上年度末(2018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	153,532,480.60	93.37	132,075,214.99	91.95
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	153,532,480.60	93.37	132,075,214.99	91.95

#### 6.4.13.4.3.2 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(2019年06月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	7,375,117.62	6,594,535.26
业绩比较基准中的股票指数下降5%	-7,375,117.62	-6,594,535.26	

#### 6.4.14 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 153,498,610.66 元，第二层次的余额为 94,869.94 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第一层次 131,881,815.19 元，第二层次 193,399.80 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 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，截至资产负债表日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	153,532,480.60	92.64
	其中：股票	153,532,480.60	92.64
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	61,000.00	0.04
	其中：债券	61,000.00	0.04
	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	11,753,569.53	7.09
7	其他各项资产	379,510.81	0.23
8	合计	165,726,560.94	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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	2,233,881.76	1.36
B	采矿业	4,714,873.20	2.87

C	制造业	82,717,066.60	50.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,448,780.40	3.31
E	建筑业	2,772,281.20	1.69
F	批发和零售业	8,847,469.00	5.38
G	交通运输、仓储和邮政业	5,823,058.25	3.54
H	住宿和餐饮业	891,220.00	0.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,864,095.56	8.43
J	金融业	6,891,053.36	4.19
K	房地产业	7,291,634.90	4.43
L	租赁和商务服务业	2,097,936.80	1.28
M	科学研究和技术服务业	88,281.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,104,970.78	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	527,383.00	0.32
Q	卫生和社会工作	714,042.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	5,108,016.29	3.11
S	综合	2,052,719.00	1.25
	合计	153,188,763.10	93.16

#### 7.2.2 报告期末积极投资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	101,899.20	0.06
C	制造业	168,344.60	0.10
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
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	343,717.50	0.21

#### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通基金股票投资。

### 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	300383	光环新网	72,900	1,222,533.00	0.74
2	002340	格林美	257,900	1,214,709.00	0.74
3	600298	安琪酵母	37,400	1,182,962.00	0.72
4	002463	沪电股份	83,400	1,135,908.00	0.69
5	002195	二三四五	280,260	1,090,211.40	0.66
6	002129	中环股份	109,700	1,070,672.00	0.65
7	002299	圣农发展	42,200	1,068,504.00	0.65
8	600872	中炬高新	24,400	1,045,052.00	0.64
9	000860	顺鑫农业	21,960	1,024,434.00	0.62
10	600183	生益科技	66,030	993,751.50	0.60
11	600673	东阳光	126,200	990,670.00	0.60
12	600260	凯乐科技	49,500	989,010.00	0.60
13	600536	中国软件	18,200	976,794.00	0.59
14	000960	锡业股份	86,056	961,245.52	0.58
15	002155	湖南黄金	93,700	943,559.00	0.57
16	600282	南钢股份	265,600	929,600.00	0.57
17	300168	万达信息	70,900	919,573.00	0.56
18	000878	云南铜业	85,200	905,676.00	0.55
19	000997	新大陆	52,700	890,103.00	0.54
20	600315	上海家化	28,500	887,775.00	0.54
21	300450	先导智能	26,200	880,320.00	0.54
22	600507	方大特钢	89,200	872,376.00	0.53
23	600486	扬农化工	15,700	858,790.00	0.52
24	600410	华胜天成	78,500	842,305.00	0.51
25	002221	东华能源	97,300	837,753.00	0.51
26	600885	宏发股份	34,300	833,490.00	0.51
27	600143	金发科技	166,000	813,400.00	0.49
28	000623	吉林敖东	49,400	809,666.00	0.49
29	600598	北大荒	75,312	808,097.76	0.49
30	600739	辽宁成大	55,400	805,516.00	0.49
31	002223	鱼跃医疗	32,650	803,843.00	0.49
32	601966	玲珑轮胎	47,000	799,000.00	0.49
33	002572	索菲亚	43,000	798,080.00	0.49
34	600845	宝信软件	27,690	788,611.20	0.48
35	000717	韶钢松山	176,000	779,680.00	0.47
36	000401	冀东水泥	44,000	774,840.00	0.47

37	002273	水晶光电	66,600	771,228.00	0.47
38	600642	申能股份	126,700	761,467.00	0.46
39	002926	华西证券	72,100	757,050.00	0.46
40	002127	南极电商	67,000	753,080.00	0.46
41	002507	涪陵榨菜	24,400	744,200.00	0.45
42	300088	长信科技	147,000	743,820.00	0.45
43	600699	均胜电子	34,800	743,328.00	0.45
44	600161	天坛生物	29,280	739,320.00	0.45
45	002004	华邦健康	151,800	737,748.00	0.45
46	600037	歌华有线	71,000	727,750.00	0.44
47	300207	欣旺达	62,600	721,152.00	0.44
48	002583	海能达	85,800	719,862.00	0.44
49	300166	东方国信	58,500	718,965.00	0.44
50	000686	东北证券	80,700	710,967.00	0.43
51	000636	风华高科	58,600	709,060.00	0.43
52	002152	广电运通	102,000	698,700.00	0.42
53	601231	环旭电子	57,600	694,080.00	0.42
54	600909	华安证券	105,700	691,278.00	0.42
55	601098	中南传媒	54,600	690,144.00	0.42
56	600373	中文传媒	54,800	688,288.00	0.42
57	300182	捷成股份	155,700	686,637.00	0.42
58	002064	华峰氨纶	136,700	686,234.00	0.42
59	603228	景旺电子	16,780	671,367.80	0.41
60	000999	华润三九	22,800	668,952.00	0.41
61	600879	航天电子	108,400	667,744.00	0.41
62	600195	中牧股份	48,000	664,800.00	0.40
63	002812	恩捷股份	14,100	659,175.00	0.40
64	600801	华新水泥	32,460	657,315.00	0.40
65	600580	卧龙电驱	76,400	642,524.00	0.39
66	002368	太极股份	21,200	642,360.00	0.39
67	603369	今世缘	22,800	635,892.00	0.39
68	600312	平高电气	82,000	630,580.00	0.38
69	600376	首开股份	68,800	614,384.00	0.37
70	002028	思源电气	61,200	609,552.00	0.37
71	600633	浙数文化	65,000	607,750.00	0.37
72	002353	杰瑞股份	25,900	598,290.00	0.36
73	300376	易事特	120,800	595,544.00	0.36
74	000009	中国宝安	103,900	593,269.00	0.36
75	000400	许继电气	65,400	592,524.00	0.36
76	600643	爱建集团	61,662	590,721.96	0.36
77	600563	法拉电子	14,300	588,731.00	0.36



78	300297	蓝盾股份	97,000	584,910.00	0.36
79	600528	中铁工业	50,500	584,285.00	0.36
80	300058	蓝色光标	136,500	582,855.00	0.35
81	000513	丽珠集团	17,500	581,525.00	0.35
82	002038	双鹭药业	24,500	577,220.00	0.35
83	000563	陕国投 A	129,700	575,868.00	0.35
84	600839	四川长虹	194,300	573,185.00	0.35
85	601866	中远海发	209,900	570,928.00	0.35
86	601872	招商轮船	130,500	568,980.00	0.35
87	002635	安洁科技	42,100	567,929.00	0.35
88	000547	航天发展	59,100	564,996.00	0.34
89	603816	顾家家居	17,640	563,068.80	0.34
90	600755	厦门国贸	64,700	558,361.00	0.34
91	600779	水井坊	10,900	553,938.00	0.34
92	603515	欧普照明	17,150	553,087.50	0.34
93	601928	凤凰传媒	68,400	551,988.00	0.34
94	603806	福斯特	15,000	550,950.00	0.34
95	000156	华数传媒	49,700	547,197.00	0.33
96	600820	隧道股份	86,600	546,446.00	0.33
97	600094	大名城	86,300	542,827.00	0.33
98	601128	常熟银行	69,600	537,312.00	0.33
99	002372	伟星新材	30,720	534,528.00	0.33
100	600811	东方集团	142,860	531,439.20	0.32
101	600380	健康元	61,100	528,515.00	0.32
102	000690	宝新能源	81,600	525,504.00	0.32
103	601019	山东出版	67,300	523,594.00	0.32
104	600967	内蒙一机	46,600	521,920.00	0.32
105	002831	裕同科技	27,120	519,890.40	0.32
106	600388	龙净环保	41,900	519,141.00	0.32
107	600466	蓝光发展	83,220	517,628.40	0.31
108	603225	新凤鸣	41,400	517,086.00	0.31
109	000983	西山煤电	85,100	515,706.00	0.31
110	600258	首旅酒店	28,600	514,228.00	0.31
111	601699	潞安环能	64,500	512,130.00	0.31
112	600266	北京城建	63,520	511,971.20	0.31
113	600757	长江传媒	73,609	501,277.29	0.30
114	000089	深圳机场	56,300	500,507.00	0.30
115	002399	海普瑞	23,800	499,562.00	0.30
116	600064	南京高科	46,500	498,015.00	0.30
117	600026	中远海能	76,600	497,134.00	0.30
118	603328	依顿电子	48,300	496,041.00	0.30

119	000541	佛山照明	94,400	494,656.00	0.30
120	600978	宜华生活	129,300	486,168.00	0.30
121	601100	恒立液压	15,400	483,252.00	0.29
122	600648	外高桥	22,600	474,148.00	0.29
123	600511	国药股份	20,300	466,291.00	0.28
124	600056	中国医药	34,553	466,119.97	0.28
125	603883	老百姓	7,825	457,606.00	0.28
126	601000	唐山港	166,000	456,500.00	0.28
127	000732	泰禾集团	27,600	455,400.00	0.28
128	300244	迪安诊断	26,400	448,272.00	0.27
129	600863	内蒙华电	142,500	447,450.00	0.27
130	002233	塔牌集团	38,200	446,176.00	0.27
131	600557	康缘药业	29,877	443,972.22	0.27
132	600062	华润双鹤	34,900	440,089.00	0.27
133	600021	上海电力	50,700	440,076.00	0.27
134	000028	国药一致	10,400	435,032.00	0.26
135	000008	神州高铁	114,900	433,173.00	0.26
136	000031	大悦城	66,700	428,214.00	0.26
137	603766	隆鑫通用	102,100	427,799.00	0.26
138	600823	世茂股份	92,100	424,581.00	0.26
139	600901	江苏租赁	69,400	422,646.00	0.26
140	000980	众泰汽车	100,200	421,842.00	0.26
141	601811	新华文轩	34,500	421,245.00	0.26
142	000528	柳工	62,740	417,848.40	0.25
143	603517	绝味食品	10,600	412,446.00	0.25
144	600120	浙江东方	32,310	411,629.40	0.25
145	002048	宁波华翔	37,700	407,914.00	0.25
146	600827	百联股份	41,400	406,134.00	0.25
147	000598	兴蓉环境	89,100	405,405.00	0.25
148	600348	阳泉煤业	69,500	403,795.00	0.25
149	002405	四维图新	25,000	402,500.00	0.24
150	002317	众生药业	47,200	401,672.00	0.24
151	600993	马应龙	22,400	395,360.00	0.24
152	002434	万里扬	58,200	395,178.00	0.24
153	600008	首创股份	111,000	390,720.00	0.24
154	002128	露天煤业	44,900	388,385.00	0.24
155	601880	大连港	181,900	387,447.00	0.24
156	002244	滨江集团	92,300	383,045.00	0.23
157	600167	联美控股	36,180	382,784.40	0.23
158	603377	东方时尚	24,900	380,472.00	0.23
159	600335	国机汽车	54,900	379,908.00	0.23

160	600754	锦江股份	15,300	376,992.00	0.23
161	600039	四川路桥	102,800	374,192.00	0.23
162	000685	中山公用	43,600	372,344.00	0.23
163	600565	迪马股份	99,500	371,135.00	0.23
164	603233	大参林	8,170	367,650.00	0.22
165	000027	深圳能源	58,800	364,560.00	0.22
166	000090	天健集团	73,580	363,485.20	0.22
167	002382	蓝帆医疗	26,200	362,084.00	0.22
168	600017	日照港	114,500	360,675.00	0.22
169	600582	天地科技	104,200	359,490.00	0.22
170	002332	仙琚制药	53,000	358,280.00	0.22
171	002242	九阳股份	17,200	357,932.00	0.22
172	002444	巨星科技	35,700	356,286.00	0.22
173	600835	上海机电	21,400	355,240.00	0.22
174	600125	铁龙物流	54,585	352,073.25	0.21
175	000519	中兵红箭	45,400	350,942.00	0.21
176	000987	越秀金控	38,900	350,878.00	0.21
177	002285	世联行	77,200	348,172.00	0.21
178	000926	福星股份	49,200	340,464.00	0.21
179	600765	中航重机	36,800	339,664.00	0.21
180	601717	郑煤机	59,359	338,939.89	0.21
181	600329	中新药业	23,600	337,244.00	0.21
182	600639	浦东金桥	20,800	336,336.00	0.20
183	600750	江中药业	25,750	335,007.50	0.20
184	002302	西部建设	29,900	333,086.00	0.20
185	601200	上海环境	24,250	330,042.50	0.20
186	600862	中航高科	36,700	329,933.00	0.20
187	600787	中储股份	57,400	328,902.00	0.20
188	600611	大众交通	70,300	326,895.00	0.20
189	002419	天虹股份	25,000	326,500.00	0.20
190	600053	九鼎投资	14,000	326,200.00	0.20
191	600970	中材国际	50,600	325,358.00	0.20
192	600201	生物股份	20,400	320,076.00	0.19
193	600575	皖江物流	108,800	318,784.00	0.19
194	600597	光明乳业	29,600	318,200.00	0.19
195	002049	紫光国微	7,200	317,592.00	0.19
196	002157	正邦科技	18,800	313,208.00	0.19
197	000066	中国长城	30,100	309,428.00	0.19
198	600317	营口港	109,100	301,116.00	0.18
199	600426	华鲁恒升	20,100	298,686.00	0.18
200	002503	搜于特	104,500	287,375.00	0.17

201	600657	信达地产	69,100	284,692.00	0.17
202	300253	卫宁健康	20,000	283,600.00	0.17
203	002465	海格通信	29,600	282,384.00	0.17
204	002051	中工国际	24,100	276,427.00	0.17
205	603866	桃李面包	6,600	274,890.00	0.17
206	601611	中国核建	35,300	274,634.00	0.17
207	000543	皖能电力	58,100	273,651.00	0.17
208	600895	张江高科	13,300	272,916.00	0.17
209	601001	大同煤业	59,000	269,630.00	0.16
210	002506	协鑫集成	40,200	268,536.00	0.16
211	600694	大商股份	9,600	267,936.00	0.16
212	600763	通策医疗	3,000	265,770.00	0.16
213	600098	广州发展	43,000	264,880.00	0.16
214	000600	建投能源	39,300	263,310.00	0.16
215	600971	恒源煤电	44,880	262,548.00	0.16
216	000750	国海证券	51,200	257,536.00	0.16
217	002439	启明星辰	9,400	252,860.00	0.15
218	300197	铁汉生态	70,100	251,659.00	0.15
219	600350	山东高速	51,800	248,640.00	0.15
220	000975	银泰资源	18,840	248,499.60	0.15
221	000848	承德露露	29,380	244,735.40	0.15
222	002268	卫士通	10,000	244,500.00	0.15
223	002384	东山精密	16,700	243,319.00	0.15
224	000501	鄂武商 A	22,600	242,950.00	0.15
225	002500	山西证券	29,500	238,950.00	0.15
226	603556	海兴电力	17,100	236,322.00	0.14
227	603568	伟明环保	10,664	229,489.28	0.14
228	603198	迎驾贡酒	12,700	227,457.00	0.14
229	600325	华发股份	28,930	225,943.30	0.14
230	000778	新兴铸管	50,700	225,108.00	0.14
231	000723	美锦能源	21,300	222,585.00	0.14
232	600460	士兰微	13,300	220,780.00	0.13
233	002373	千方科技	12,900	220,590.00	0.13
234	600908	无锡银行	39,100	220,524.00	0.13
235	002075	沙钢股份	28,000	219,520.00	0.13
236	000998	隆平高科	15,000	217,200.00	0.13
237	002821	凯莱英	2,200	215,776.00	0.13
238	002375	亚厦股份	36,400	215,124.00	0.13
239	002839	张家港行	38,200	215,066.00	0.13
240	002371	北方华创	3,100	214,675.00	0.13
241	002385	大北农	40,500	214,245.00	0.13

242	601139	深圳燃气	37,600	213,944.00	0.13
243	002807	江阴银行	45,380	212,378.40	0.13
244	601168	西部矿业	33,100	211,178.00	0.13
245	002797	第一创业	33,300	211,122.00	0.13
246	002092	中泰化学	26,300	209,348.00	0.13
247	600584	长电科技	16,100	206,885.00	0.13
248	600497	驰宏锌锗	40,400	205,232.00	0.12
249	000039	中集集团	19,080	203,774.40	0.12
250	600745	闻泰科技	6,100	202,642.00	0.12
251	000060	中金岭南	42,800	200,732.00	0.12
252	600875	东方电气	18,800	199,656.00	0.12
253	600848	上海临港	6,400	199,232.00	0.12
254	600392	盛和资源	18,000	199,080.00	0.12
255	000830	鲁西化工	18,100	196,928.00	0.12
256	002344	海宁皮城	41,900	195,254.00	0.12
257	600718	东软集团	15,100	193,582.00	0.12
258	002818	富森美	15,060	193,219.80	0.12
259	600022	山东钢铁	115,000	192,050.00	0.12
260	600549	厦门钨业	13,400	191,754.00	0.12
261	600166	福田汽车	80,400	190,548.00	0.12
262	600572	康恩贝	29,700	190,080.00	0.12
263	601005	重庆钢铁	92,900	186,729.00	0.11
264	600808	马钢股份	54,500	185,845.00	0.11
265	002416	爱施德	29,100	181,875.00	0.11
266	002191	劲嘉股份	14,600	181,186.00	0.11
267	002078	太阳纸业	26,500	180,465.00	0.11
268	603355	莱克电气	8,300	178,616.00	0.11
269	600567	山鹰纸业	52,500	176,925.00	0.11
270	000581	威孚高科	9,500	176,320.00	0.11
271	000970	中科三环	15,528	176,242.80	0.11
272	002916	深南电路	1,720	175,302.40	0.11
273	600804	鹏博士	23,300	175,216.00	0.11
274	300274	阳光电源	18,700	174,845.00	0.11
275	600959	江苏有线	39,100	173,995.00	0.11
276	601333	广深铁路	53,800	173,774.00	0.11
277	600881	亚泰集团	52,900	171,925.00	0.10
278	002387	维信诺	13,000	169,650.00	0.10
279	600160	巨化股份	23,770	169,004.70	0.10
280	603939	益丰药房	2,400	167,976.00	0.10
281	600521	华海药业	11,900	167,790.00	0.10
282	603000	人民网	9,400	167,602.00	0.10

283	600079	人福医药	15,900	166,950.00	0.10
284	002281	光迅科技	6,300	166,824.00	0.10
285	002074	国轩高科	12,600	165,186.00	0.10
286	002217	合力泰	29,700	164,241.00	0.10
287	002670	国盛金控	12,900	162,540.00	0.10
288	002482	广田集团	33,100	160,866.00	0.10
289	300009	安科生物	10,000	159,000.00	0.10
290	000729	燕京啤酒	23,900	158,696.00	0.10
291	603077	和邦生物	83,500	158,650.00	0.10
292	002110	三钢闽光	16,850	156,705.00	0.10
293	300027	华谊兄弟	31,900	156,629.00	0.10
294	300315	掌趣科技	45,005	155,267.25	0.09
295	000988	华工科技	9,800	155,036.00	0.09
296	002002	鸿达兴业	24,600	152,274.00	0.09
297	000930	中粮生化	20,200	151,904.00	0.09
298	002085	万丰奥威	20,800	151,424.00	0.09
299	600171	上海贝岭	9,300	151,125.00	0.09
300	002131	利欧股份	78,900	150,699.00	0.09
301	002440	闰土股份	12,000	149,520.00	0.09
302	600435	北方导航	16,500	148,335.00	0.09
303	603444	吉比特	700	146,972.00	0.09
304	002607	中公教育	10,700	146,911.00	0.09
305	002174	游族网络	8,700	146,856.00	0.09
306	300001	特锐德	8,100	145,962.00	0.09
307	002589	瑞康医药	19,100	144,969.00	0.09
308	600737	中粮糖业	16,700	144,956.00	0.09
309	002019	亿帆医药	11,800	144,550.00	0.09
310	000932	华菱钢铁	29,400	140,238.00	0.09
311	002690	美亚光电	4,300	140,180.00	0.09
312	601118	海南橡胶	27,200	140,080.00	0.09
313	601718	际华集团	35,800	139,978.00	0.09
314	601106	中国一重	44,500	139,730.00	0.08
315	000559	万向钱潮	23,300	139,334.00	0.08
316	002250	联化科技	12,500	138,625.00	0.08
317	300316	晶盛机电	10,900	138,321.00	0.08
318	603877	太平鸟	8,800	136,576.00	0.08
319	600525	长园集团	21,600	136,512.00	0.08
320	600500	中化国际	18,100	135,207.00	0.08
321	000826	启迪环境	11,400	134,406.00	0.08
322	000883	湖北能源	30,900	134,106.00	0.08
323	600649	城投控股	20,600	133,282.00	0.08

324	000681	视觉中国	6,800	131,784.00	0.08
325	002603	以岭药业	11,200	129,696.00	0.08
326	601179	中国西电	34,800	128,760.00	0.08
327	601678	滨化股份	19,000	128,440.00	0.08
328	000758	中色股份	23,000	126,270.00	0.08
329	000807	云铝股份	26,600	124,754.00	0.08
330	000738	航发控制	9,300	124,620.00	0.08
331	000021	深科技	15,300	124,389.00	0.08
332	300113	顺网科技	7,900	123,872.00	0.08
333	300418	昆仑万维	9,600	123,552.00	0.08
334	002266	浙富控股	25,800	122,550.00	0.07
335	600515	海航基础	24,700	122,265.00	0.07
336	600748	上实发展	14,600	121,034.00	0.07
337	600729	重庆百货	4,000	120,960.00	0.07
338	603501	韦尔股份	2,200	120,802.00	0.07
339	600277	亿利洁能	24,800	120,776.00	0.07
340	600138	中青旅	9,400	119,286.00	0.07
341	600409	三友化工	21,000	118,860.00	0.07
342	002183	怡亚通	24,800	118,296.00	0.07
343	000488	晨鸣纸业	21,800	116,848.00	0.07
344	603885	吉祥航空	8,900	116,590.00	0.07
345	600782	新钢股份	23,300	116,500.00	0.07
346	000877	天山股份	10,000	116,200.00	0.07
347	600418	江淮汽车	22,500	116,100.00	0.07
348	002414	高德红外	6,000	115,200.00	0.07
349	002408	齐翔腾达	14,800	114,700.00	0.07
350	600060	海信电器	13,300	114,646.00	0.07
351	600158	中体产业	11,200	114,576.00	0.07
352	600155	华创阳安	8,500	114,155.00	0.07
353	000887	中鼎股份	11,900	114,121.00	0.07
354	300133	华策影视	16,900	113,737.00	0.07
355	600216	浙江医药	11,000	112,640.00	0.07
356	002176	江特电机	23,100	112,497.00	0.07
357	002407	多氟多	9,500	112,480.00	0.07
358	600777	新潮能源	53,700	111,696.00	0.07
359	000813	德展健康	14,600	111,252.00	0.07
360	300324	旋极信息	19,049	110,293.71	0.07
361	600307	酒钢宏兴	53,900	109,417.00	0.07
362	300010	立思辰	11,600	108,924.00	0.07
363	600478	科力远	19,300	107,887.00	0.07
364	600717	天津港	16,800	107,856.00	0.07

365	600664	哈药股份	25,800	106,812.00	0.06
366	300026	红日药业	30,500	105,225.00	0.06
367	000301	东方盛虹	19,100	104,859.00	0.06
368	002701	奥瑞金	22,400	104,608.00	0.06
369	002212	南洋股份	7,600	104,120.00	0.06
370	300002	神州泰岳	26,000	103,480.00	0.06
371	600316	洪都航空	7,200	103,032.00	0.06
372	002470	金正大	28,300	103,012.00	0.06
373	601958	金钼股份	15,300	102,510.00	0.06
374	002640	跨境通	12,300	102,459.00	0.06
375	002030	达安基因	9,500	101,935.00	0.06
376	002491	通鼎互联	12,600	101,934.00	0.06
377	600073	上海梅林	10,900	100,280.00	0.06
378	300134	大富科技	6,400	99,392.00	0.06
379	600884	杉杉股份	9,300	99,045.00	0.06
380	002056	横店东磁	13,000	98,800.00	0.06
381	603659	璞泰来	2,100	98,742.00	0.06
382	002358	森源电气	9,700	98,455.00	0.06
383	600267	海正药业	9,800	98,000.00	0.06
384	000712	锦龙股份	7,600	97,584.00	0.06
385	600259	广晟有色	2,400	96,720.00	0.06
386	300115	长盈精密	9,200	96,508.00	0.06
387	000727	华东科技	45,900	95,931.00	0.06
388	002665	首航节能	28,200	95,598.00	0.06
389	600499	科达洁能	21,800	95,484.00	0.06
390	600859	王府井	6,200	94,178.00	0.06
391	000078	海王生物	26,900	93,612.00	0.06
392	600291	西水股份	9,200	92,552.00	0.06
393	002505	大康农业	46,300	91,211.00	0.06
394	600751	海航科技	28,400	90,312.00	0.05
395	002426	胜利精密	35,100	89,856.00	0.05
396	000718	苏宁环球	25,700	88,922.00	0.05
397	002424	贵州百灵	9,000	88,920.00	0.05
398	000959	首钢股份	25,200	88,704.00	0.05
399	002573	清新环境	11,000	88,550.00	0.05
400	002672	东江环保	7,800	88,452.00	0.05
401	600645	中源协和	5,100	88,281.00	0.05
402	601326	秦港股份	24,300	88,209.00	0.05
403	600759	洲际油气	22,800	88,008.00	0.05
404	600151	航天机电	16,800	86,520.00	0.05
405	000012	南 玻 A	20,790	86,486.40	0.05



406	000006	深振业 A	15,800	86,110.00	0.05
407	002249	大洋电机	19,800	85,932.00	0.05
408	000158	常山北明	15,800	85,636.00	0.05
409	600770	综艺股份	12,600	84,168.00	0.05
410	002390	信邦制药	15,900	83,793.00	0.05
411	600141	兴发集团	8,100	83,268.00	0.05
412	300459	金科文化	14,600	83,074.00	0.05
413	002366	台海核电	8,800	82,368.00	0.05
414	300055	万邦达	11,500	81,995.00	0.05
415	002280	联络互动	22,200	81,252.00	0.05
416	600338	西藏珠峰	4,620	80,757.60	0.05
417	300287	飞利信	20,300	80,591.00	0.05
418	600169	太原重工	30,100	80,367.00	0.05
419	000564	供销大集	30,700	80,127.00	0.05
420	600393	粤泰股份	17,000	79,050.00	0.05
421	603712	七一二	3,700	78,551.00	0.05
422	002093	国脉科技	8,400	78,036.00	0.05
423	002254	泰和新材	7,200	76,176.00	0.05
424	002431	棕榈股份	19,100	75,445.00	0.05
425	002745	木林森	6,400	75,008.00	0.05
426	300159	新研股份	15,000	74,700.00	0.05
427	002544	杰赛科技	5,700	74,100.00	0.05
428	601311	骆驼股份	6,800	73,780.00	0.04
429	601689	拓普集团	4,800	73,536.00	0.04
430	300199	翰宇药业	7,800	71,526.00	0.04
431	300308	中际旭创	2,100	71,379.00	0.04
432	601016	节能风电	26,800	71,288.00	0.04
433	600623	华谊集团	9,300	71,052.00	0.04
434	600640	号百控股	5,300	70,914.00	0.04
435	300266	兴源环境	15,600	70,824.00	0.04
436	000869	张裕 A	2,200	70,664.00	0.04
437	002709	天赐材料	2,900	70,180.00	0.04
438	000062	深圳华强	5,220	69,373.80	0.04
439	600006	东风汽车	13,000	69,290.00	0.04
440	000990	诚志股份	4,200	68,922.00	0.04
441	603888	新华网	3,450	68,862.00	0.04
442	600874	创业环保	8,300	68,807.00	0.04
443	000937	冀中能源	17,800	68,708.00	0.04
444	600545	卓郎智能	9,500	67,545.00	0.04
445	600458	时代新材	6,500	67,535.00	0.04
446	000426	兴业矿业	12,200	65,514.00	0.04

447	002815	崇达技术	4,200	65,478.00	0.04
448	600058	五矿发展	7,700	65,065.00	0.04
449	603056	德邦股份	4,600	64,768.00	0.04
450	600869	智慧能源	14,300	64,636.00	0.04
451	600416	湘电股份	10,700	64,414.00	0.04
452	000537	广宇发展	9,300	64,356.00	0.04
453	601127	小康股份	4,800	62,880.00	0.04
454	000061	农产品	11,500	62,330.00	0.04
455	002489	浙江永强	18,200	60,788.00	0.04
456	300257	开山股份	5,400	59,832.00	0.04
457	600126	杭钢股份	12,900	58,824.00	0.04
458	002920	德赛西威	2,600	58,240.00	0.04
459	000536	华映科技	23,100	58,212.00	0.04
460	002517	恺英网络	18,200	58,058.00	0.04
461	601801	皖新传媒	9,600	57,696.00	0.04
462	002118	紫鑫药业	8,500	57,290.00	0.03
463	600707	彩虹股份	11,400	57,114.00	0.03
464	002437	誉衡药业	14,200	56,090.00	0.03
465	600996	贵广网络	5,200	56,056.00	0.03
466	002948	青岛银行	8,700	55,941.00	0.03
467	002681	奋达科技	13,100	55,544.00	0.03
468	002251	步步高	6,900	54,993.00	0.03
469	601003	柳钢股份	9,400	54,426.00	0.03
470	000766	通化金马	8,000	54,400.00	0.03
471	600428	中远海特	14,400	53,280.00	0.03
472	601869	长飞光纤	1,400	52,500.00	0.03
473	002512	达华智能	11,600	52,432.00	0.03
474	000552	靖远煤电	19,100	51,761.00	0.03
475	002707	众信旅游	8,500	51,595.00	0.03
476	002509	天广中茂	25,000	51,500.00	0.03
477	000829	天音控股	8,700	50,634.00	0.03
478	002936	郑州银行	9,800	49,784.00	0.03
479	601615	明阳智能	4,400	47,696.00	0.03
480	601777	力帆股份	11,000	47,190.00	0.03
481	600903	贵州燃气	3,600	46,908.00	0.03
482	000587	金洲慈航	17,800	45,924.00	0.03
483	600939	重庆建工	9,100	44,499.00	0.03
484	000025	特力A	2,030	41,046.60	0.02
485	601969	海南矿业	6,600	38,808.00	0.02
486	002699	美盛文化	6,300	37,800.00	0.02
487	600985	淮北矿业	3,100	35,154.00	0.02

488	600280	中央商场	9,600	34,464.00	0.02
489	601068	中铝国际	4,900	33,810.00	0.02
490	603868	飞科电器	800	31,320.00	0.02
491	603486	科沃斯	980	29,645.00	0.02
492	000761	本钢板材	6,400	27,520.00	0.02
493	603650	彤程新材	1,100	24,024.00	0.01
494	603569	长久物流	1,900	22,021.00	0.01
495	600917	重庆燃气	3,100	21,576.00	0.01
496	603025	大豪科技	1,900	19,456.00	0.01

### 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	600968	海油发展	28,704	101,899.20	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.05
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
6	603863	松炆资源	1,241	28,642.28	0.02
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02

### 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	000750	国海证券	1,484,466.50	1.03
2	002299	圣农发展	1,440,893.50	1.00
3	600580	卧龙电驱	1,346,203.66	0.94
4	002465	海格通信	1,270,623.00	0.88
5	002221	东华能源	1,236,312.00	0.86
6	002831	裕同科技	1,201,964.00	0.84
7	000860	顺鑫农业	1,180,932.09	0.82
8	300146	汤臣倍健	1,092,024.00	0.76
9	600536	中国软件	1,079,913.00	0.75
10	300182	捷成股份	1,078,811.00	0.75
11	000519	中兵红箭	1,066,709.59	0.74
12	000060	中金岭南	1,032,752.00	0.72
13	300383	光环新网	1,016,747.00	0.71
14	300316	晶盛机电	988,299.90	0.69
15	000636	风华高科	956,061.00	0.67
16	600315	上海家化	950,600.92	0.66

17	002463	沪电股份	946,769.00	0.66
18	600195	中牧股份	945,472.00	0.66
19	603025	大豪科技	935,304.00	0.65
20	000401	冀东水泥	934,436.00	0.65

注:买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002410	广联达	1,923,700.00	1.34
2	000519	中兵红箭	1,483,452.42	1.03
3	000860	顺鑫农业	1,477,448.00	1.03
4	300146	汤臣倍健	1,424,096.00	0.99
5	603077	和邦生物	1,348,900.00	0.94
6	000970	中科三环	1,230,868.81	0.86
7	300315	掌趣科技	1,212,815.00	0.84
8	000750	国海证券	1,205,902.00	0.84
9	002191	劲嘉股份	1,205,390.00	0.84
10	600600	青岛啤酒	1,203,275.00	0.84
11	603899	晨光文具	1,192,399.23	0.83
12	600875	东方电气	1,172,456.39	0.82
13	601168	西部矿业	1,160,263.00	0.81
14	600808	马钢股份	1,155,756.00	0.80
15	000656	金科股份	1,152,385.00	0.80
16	000975	银泰资源	1,146,429.99	0.80
17	002373	千方科技	1,115,223.00	0.78
18	600655	豫园股份	1,108,649.00	0.77
19	002465	海格通信	1,103,215.00	0.77
20	002074	国轩高科	1,088,687.43	0.76

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	195,134,325.47
卖出股票收入(成交)总额	200,608,455.11

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	61,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,000.00	0.04

#### 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	113028	环境转债	580	58,000.00	0.04
2	113027	华钰转债	30	3,000.00	0.00

本基金本报告期末仅持有上述债券投资。

#### 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

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
IC1912	IC1912	2	1,882,000.00	101,440.00	-
公允价值变动总额合计(元)				101,440.00	
股指期货投资本期收益(元)				-463,972.04	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				142,480.00	

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

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

本报告期内, 本基金指数投资的前十名证券的发行主体及积极投资的前五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, 没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	286,533.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,198.92
5	应收申购款	90,778.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	379,510.81

##### 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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

###### 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	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	网下新股申购未上市

##### 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
信诚中证 500 指数分级 A	580	37,980.52	14,640,615.00	66.46%	7,388,085.00	33.54%
信诚中证 500 指数分级 B	4455	7,417.07	823,668.00	2.49%	32,219,383.00	97.51%
信诚中证 500 指数分级	15107	6,909.02	2,452,019.30	2.35%	101,922,507.39	97.65%
合计	20142	7,916.11	17,916,302.30	11.24%	141,529,975.39	88.76%

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

信诚中证 500 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	上海东证期货有限公司—东证盈享债券多策略三号资产管理计划	5,577,273.00	25.32%
2	董智力	2,301,000.00	10.45%
3	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	2,222,471.00	10.09%
4	上海东证期货—兴业银行—东证期货创新投量化对冲 1 号集合资产管理	1,990,210.00	9.03%
5	中国银河证券股份有限公司	1,722,729.00	7.82%
6	周云鹤	948,396.00	4.31%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	666,535.00	3.03%
8	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001 深	613,000.00	2.78%
9	北京城建集团有限责任公司企业年金计划—中信银行股份有限公司	500,000.00	2.27%
10	人保资产汇悦股票型养老金产品—交通银行股份有限公司	499,800.00	2.27%

信诚中证 500 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	王晓刚	834,100.00	2.52%
2	郑智	523,016.00	1.58%
3	张钢	510,000.00	1.54%
4	陈胜华	500,000.00	1.51%
5	杨东宁	485,613.00	1.47%
6	梁森泉	467,983.00	1.42%
7	云南云达工程造价咨询有限公司	432,871.00	1.31%
8	广州市广百股份有限公司	384,000.00	1.16%
9	林伟	380,973.00	1.15%
10	杨胜华	345,247.00	1.04%

## 信诚中证 500 指数分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	杨丽	2,674,371.76	2.56%
2	李汝波	1,449,878.62	1.39%
3	车亚丽	1,358,236.31	1.30%
4	柴奇志	1,325,536.19	1.27%
5	幸福人寿保险股份有限公司-分红	1,307,566.00	1.25%
6	徐清华	864,873.90	0.83%
7	杜秀华	786,974.96	0.75%
8	李建兵	775,309.25	0.74%
9	池航钊	591,409.17	0.57%
10	杨海峰	561,433.45	0.54%

## 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	信诚中证 500 指数分级 A	-	-
	信诚中证 500 指数分级 B	-	-
	信诚中证 500 指数分级	276,862.12	0.27%
	合计	276,862.12	0.17%

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 研究部门负责人持有	信诚中证 500 指数分级 A	0
	信诚中证 500 指数分级 B	0
	信诚中证 500 指数分级	0



本开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚中证 500 指数分级 A	0
	信诚中证 500 指数分级 B	0
	信诚中证 500 指数分级	0
	合计	0

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的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

#### 8.5 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	信诚中证 500 指数分级 A	信诚中证 500 指数分级 B	信诚中证 500 指数分级
基金合同生效日(2011年02月11日)基金份额总额	10,134,545.00	15,201,819.00	348,917,936.10
本报告期初基金份额总额	21,462,632.00	32,193,949.00	108,230,757.06
本报告期基金总申购份额	-	-	32,293,782.45
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	37,908,860.44
本报告期基金拆分变动份额	566,068.00	849,102.00	1,758,847.62
本报告期末基金份额总额	22,028,700.00	33,043,051.00	104,374,526.69

注:1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换变动份额以及因份额折算产生的份额。

2. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定,本基金以 2019 年 2 月 1 日为份额折算基准日,对本基金实施定期份额折算。

3. 本报告期因折算导致的份额拆分变动情况,详见本管理人届时发布的折算结果公告。

### § 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	16,865,055.58	4.28%	15,369.31	4.67%	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	15,190,483.82	3.86%	14,147.02	4.30%	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	88,909.96	0.02%	63.24	0.02%	本期新增
天风证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	本期新增
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
金通证券	1	-	-	-	-	本期新增
华泰证券	2	44,024,702.92	11.18%	40,119.33	12.19%	-
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	37,269,403.62	9.47%	26,509.54	8.05%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	本期新增
高盛高华	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	14,621,869.43	3.71%	13,324.85	4.05%	-
东兴证券	1	51,158,016.06	12.99%	46,620.36	14.16%	-
东吴证券	2	61,152,460.56	15.53%	56,949.94	17.30%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	147,247,214.13	37.40%	111,693.35	33.94%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	6,085,493.45	1.55%	4,328.62	1.32%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	本期新增
安信证券	3	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	本期退租
申银万国	-	-	-	-	-	本期退租
申银万国	-	-	-	-	-	本期退租

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	37,213.60	7.37%	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	283,373.87	56.13%	-	-	-	-
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	23,000.00	4.56%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	161,248.96	31.94%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

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。

#### 10.8 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	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2018 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》及公司网站(www.citicprufunds.com)	2019 年 01 月 02 日
2	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年第四季度报告	同上	2019 年 01 月 22 日
3	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	同上	2019 年 01 月 29 日
4	中信保诚基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	同上	2019 年 01 月 29 日
5	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之中证 500A 份额年约定收益率设定的公告	同上	2019 年 02 月 02 日
6	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间中证 500A 份额停复牌的公告	同上	2019 年 02 月 11 日
7	中信保诚基金管理有限公司关于中证 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	同上	2019 年 02 月 12 日
8	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	同上	2019 年 02 月 12 日
9	信诚中证 500 指数分级证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 02 月 27 日
10	信诚中证 500 指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停直销机构跨系统转托管(场外转场内)业务的公告	同上	2019 年 03 月 06 日
11	信诚中证 500 指数分级证券投资基	同上	2019 年 03 月 07 日

	金恢复代销机构场外大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停办理基金跨系统转托管（场外转场内）业务的公告		
12	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过东海证券办理定投业务最低限额的公告	同上	2019 年 03 月 11 日
13	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定期定额投资最低金额和赎回、转换转出及持有最低份额限制的业务的公告	同上	2018 年 03 月 21 日
14	信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书(2019 年第 1 次更新)	同上	2019 年 03 月 26 日
15	信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书摘要(2019 年第 1 次更新)	同上	2019 年 03 月 26 日
16	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告	同上	2019 年 03 月 28 日
17	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要	同上	2019 年 03 月 28 日
18	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金在中投证券开通定期定额投资业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2019 年 03 月 29 日
19	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第一季度报告	同上	2019 年 04 月 18 日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加辉腾汇富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2019 年 05 月 20 日
21	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购定投费率优惠活动的公告	同上	2019 年 05 月 28 日
22	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	同上	2019 年 06 月 17 日

## § 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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件名称

- 1、信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理公司营业执照
- 3、信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证 500 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

中信保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.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2019 年 08 月 26 日