

信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 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：2018 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚中证 500 指数分级		
场内简称	信诚 500		
基金主代码	165511		
交易代码	-	-	-
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	240,506,011.62 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	21,052,316.00 份	31,578,475.00 份	187,875,220.62 份

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。

2.2 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	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%。 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。		
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 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	信诚中证 500 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	田青
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

注: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(2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-27,986,143.86
本期利润	-42,356,888.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1688
本期基金份额净值增长率	-14.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2667
期末基金资产净值	258,247,099.38
期末基金份额净值	1.074

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。

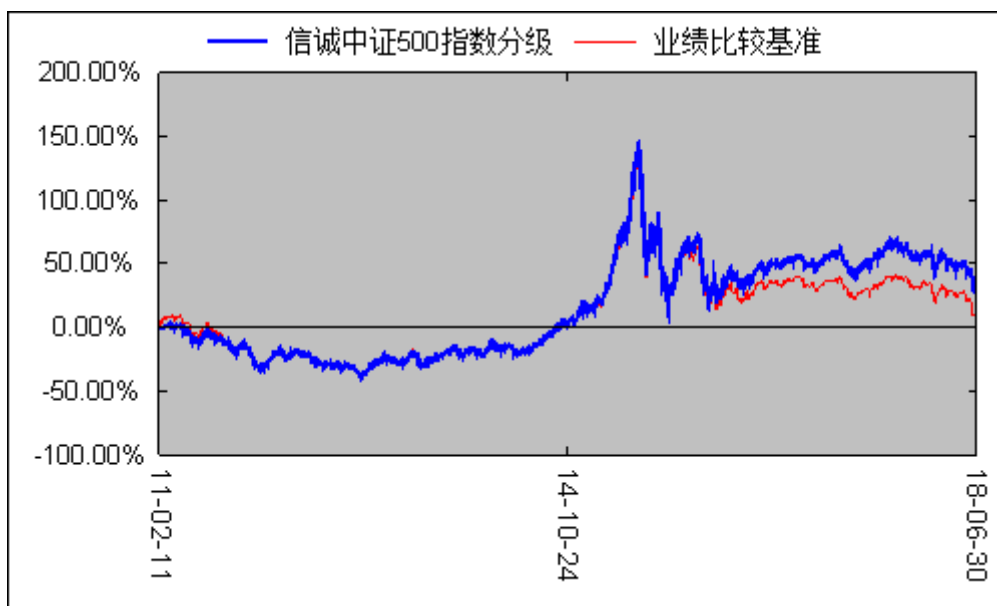
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-8.21%	1.81%	-8.86%	1.77%	0.65%	0.04%
过去三个月	-12.75%	1.33%	-13.96%	1.31%	1.21%	0.02%
过去六个月	-14.61%	1.35%	-15.70%	1.37%	1.09%	-0.02%
过去一年	-11.49%	1.14%	-14.19%	1.16%	2.70%	-0.02%
过去三年	-29.20%	1.86%	-39.37%	1.80%	10.17%	0.06%
自基金合同生效起至今	32.99%	1.62%	11.38%	1.62%	21.61%	-

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 2006 年 11 月 27 日至 2007 年 5 月 26 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自 2015 年 10 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率*80%+中信国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”变更为“中信标普 300 指数收益率*80%+中证国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2018 年 6 月 30 日,本基金管理人管理的运作中基金为 64 只,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚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、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型

证券投资基金 (LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金 (LOF)、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至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、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚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、信诚新丰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。

截至 2018 年 6 月 30 日, 本基金管理人管理的处于清算期中的基金为 10 只, 分别为信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚至盛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		
杨旭	本基金基金经理, 兼任量化投资副总监, 信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证建筑工程指数型基金 (LOF)、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置	2015 年 01 月 15 日	-	5	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司, 担任数量分析师; 于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司, 担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司, 历任助理投资经理、专户投资经理。现任量化投资副总监, 信诚中证 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指

	混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金、中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。				数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证建筑工程指数型基金 (LOF)、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金、中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。
黄稚	本基金基金经理助理, 兼任信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金的基金经理助理。	2016 年 07 月 01 日	-	6	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, 担任金融工程师。现任信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金的基金经理助理。

注: 1. 黄稚女士于 2018 年 7 月 25 日增聘为本基金的基金经理。截至本报告披露日, 本基金由杨旭先生与黄稚女士共同管理。

2. 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。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年上半年,受美联储加息、中美贸易冲突加剧等事件影响,国内股票市场波动有所加大,整体出现较大幅度回调。上半年上证综指下跌-13.90%,与内需相关的行业的如食品饮料、家用电器、医药生物、休闲服务等行业涨幅较高。

报告期内,本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上,利用数量化方法构建投资组合进行指数化投资,实现对标的指数的有效跟踪。利用股指期货多头套保进行应对申赎的现金管理和基金仓位管理,有效管理跟踪误差。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值。

4.4.2 报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-14.61%,同期业绩比较基准收益率为-15.70%,基金超越业绩比较基准 1.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受国内外环境影响,国内宏观经济面临较大挑战。2 季度实际 GDP 增长 6.7%,较 1 季度回落 0.1%,在结构上出口贡献下降,消费贡献上升;1-6 月固定资产投资累计同比 6.0%,环比回落 0.1%,基建投资持续大幅回落是拖累固定资产投资;上半年社会融资规模呈下降态势,表外融资剧烈萎缩,6 月社融同比增速创历史新低。中美贸易冲突持续升级,7 月初中美对 340 亿美元商品互相加征 25%关税正式生效。货币政策整体稳健中性,二季度操作上较为友好。

展望下半年,在国内经济面临压力较大的情况下,近期宏观政策出现缓和迹象,去杠杆节奏和力度有所放缓,信用紧张局面得到阶段性缓解。下半年宏观政策对于股票市场影响加大,后续密切关注政策变化以及中美贸易冲突进展。A 股市场仍面临较大波动性,预计维持震荡格局下的结构性行情。

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、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、

投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。基金管理人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,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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两百人)的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内,本基金未实施利润分配。

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：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2018 年 06 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
资 产：			
银行存款		18,789,483.65	17,445,489.30
结算备付金		2,822,703.99	2,005,172.07
存出保证金		1,188,940.47	581,985.08
交易性金融资产		237,051,362.24	288,063,202.99
其中：股票投资		237,051,362.24	287,985,702.99
基金投资		-	-
债券投资		-	77,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	545,766.80
应收利息		6,442.04	3,986.60
应收股利		-	-
应收申购款		151,561.14	110,733.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		260,010,493.53	308,756,335.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2018 年 06 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,886.52	568,076.13
应付赎回款		169,487.59	299,923.60
应付管理人报酬		229,120.23	259,778.60
应付托管费		50,406.44	57,151.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		607,964.74	422,273.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债		703,528.63	901,212.81
负债合计		1,763,394.15	2,508,416.03
所有者权益：			
实收基金		194,101,532.66	196,600,263.80
未分配利润		64,145,566.72	109,647,656.15
所有者权益合计		258,247,099.38	306,247,919.95
负债和所有者权益总计		260,010,493.53	308,756,335.98

注：截止本报告期末，基金份额总额 240,506,011.62 份，信诚中证 500 指数分级的基金份额净值 1.074 元，基金份额总额 187,875,220.62 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 21,052,316.00 份；信诚 500B 的基金份额净值 1.111 元，基金份额总额 31,578,475.00 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：2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日)
一、收入		-38,147,998.88	4,134,258.92
1. 利息收入		89,241.74	94,112.63
其中：存款利息收入		89,225.79	71,246.88
债券利息收入		15.95	22,865.75
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）		-24,038,893.90	4,133,510.28
其中：股票投资收益		-25,443,272.80	2,470,975.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益		17,292.82	-26,870.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-442,135.15	117,706.67
股利收益		1,829,221.23	1,571,697.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-14,370,745.07	-175,777.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		172,398.35	82,413.90
减：二、费用		4,208,890.05	2,274,094.29
1. 管理人报酬		1,494,412.85	1,253,173.52
2. 托管费		328,770.80	275,698.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,020,663.17	385,341.24
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		30.65	-
7. 其他费用		365,012.58	359,881.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,356,888.93	1,860,164.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,356,888.93	1,860,164.63

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：2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (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
项目	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 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）	177,311,280.77	86,548,639.47	263,859,920.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,860,164.63	1,860,164.63
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）	-10,180,978.36	-4,307,849.39	-14,488,827.75
其中：1. 基金申购款	37,089,888.42	20,267,957.97	57,357,846.39
2. 基金赎回款	-47,270,866.78	-24,575,807.36	-71,846,674.14
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）	167,130,302.41	84,100,954.71	251,231,257.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吕涛
基金管理人负责人

陈逸辛
主管会计工作负责人

刘卓
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚中证 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。

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%，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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

主要税项说明

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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）运营基金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。对基金在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、债券收入免征增值税。

(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) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(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（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(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，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h) 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费率计算缴纳教育费附加、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、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

6.4.8.1.2 权证交易

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

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 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日)
当期发生的基金应支付的管理费	1,494,412.85	1,253,173.52
其中：支付销售机构的客户维护费	280,928.69	348,257.89

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% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日)
当期发生的基金应支付的托管费	328,770.80	275,698.16

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：

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

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金在本报告期及上年度可比期间未发生销售服务费

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在报告期及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。

6.4.8.4 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

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。

6.4.8.4.2 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（2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2017 年 01 月 01 日至 2017 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	18,789,483.65	72,234.36	15,386,761.20	48,730.03

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 2,822,703.99 元(2017 年 6 月 30 日：人民币 138,523.09 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

本基金在本报告期内与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末（2018 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

证券类别	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
股票	603105	芯能科技	2018 年 06 月 29 日	2018 年 07 月 09 日	网下新股申购未上市	4.83	4.83	3,410	-	16,470.30	-
股票	603693	江苏新能	2018 年 06 月 29 日	2018 年 07 月 09 日	网下新股申购未上市	9.00	9.00	5,384	-	48,456.00	-

			月 25 日	月 03 日	申 购 未 上 市						
股 票	603706	东 方 环宇	2018 年 06 月 29 日	2018 年 07 月 09 日	网 下 新 股 申 购 未 上 市	13.09	13.09	1,765		23,103.85	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票名 称	停牌日 期	停牌原 因	期末估 值单价	复牌日 期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300324	旋极信 息	2018 年 05 月 30 日	筹划重 大资产 重组	8.37	-	-	284,049	3,145,596.05	2,377,490.13	-
600811	东方集 团	2018 年 05 月 30 日	筹划重 大资产 重组	4.30	-	-	436,960	1,928,540.94	1,878,928.00	-
600335	国机汽 车	2018 年 04 月 04 日	筹划重 大资产 重组	10.43	-	-	149,300	1,690,368.71	1,557,199.00	-
000426	兴业矿 业	2018 年 06 月 19 日	筹划重 大资产 重组	7.21	2018 年 08 月 27 日	6.47	193,600	1,725,895.59	1,395,856.00	-
002408	齐翔腾 达	2018 年 06 月 19 日	筹划重 大资产 重组	12.28	-	-	89,400	1,048,159.71	1,097,832.00	-
000939	*ST 凯迪	2017 年 11 月 16 日	筹划重 大资产 重组	4.99	2018 年 07 月 02 日	4.74	218,300	1,146,684.80	1,089,317.00	-
002051	中工国 际	2018 年 04 月 09 日	筹划重 大资产 重组	12.79	-	-	84,932	1,394,904.47	1,086,280.28	-
002426	胜利精 密	2018 年 06 月 19 日	重大事 项停牌	3.60	2018 年 07 月 03 日	3.26	297,000	1,173,769.00	1,069,200.00	-
002573	清新环 境	2018 年 06 月 19 日	刊登重 要公告	11.55	-	-	91,900	1,294,486.01	1,061,445.00	-
600687	刚泰控 股	2018 年 06 月 11 日	刊登重 要公告	9.09	2018 年 08 月 20 日	8.18	98,200	1,175,216.50	892,638.00	-

000669	金 鸿 控 股	2018 年 05 月 18 日	筹划重 大资产 重组	7.25	2018 年 08 月 06 日	6.53	101,080	793,373.00	732,830.00	-
300266	兴 源 环 境	2018 年 02 月 05 日	控股股 东部分 质押股 票触及 平仓线	16.67	2018 年 07 月 02 日	17.99	40,930	1,074,251.02	682,303.10	-
002431	棕 榈 股 份	2018 年 05 月 30 日	刊登重 要公告	6.71	-	-	99,550	737,005.56	667,980.50	-
300146	汤 臣 倍 健	2018 年 01 月 31 日	筹划重 大资产 重组	15.40	2018 年 07 月 31 日	16.50	38,200	572,683.59	588,280.00	-
002359	北 讯 集 团	2018 年 05 月 21 日	刊登重 要公告	19.58	2018 年 08 月 21 日	17.62	18,100	467,076.07	354,398.00	-
002699	美 盛 文 化	2018 年 02 月 05 日	筹划重 大投资 事项	18.76	2018 年 07 月 02 日	16.88	16,700	311,381.79	313,292.00	-
600086	东 方 金 钰	2018 年 01 月 19 日	筹划重 大投资 事项	10.04	-	-	26,700	286,007.54	268,068.00	-
000566	海 南 海 药	2017 年 11 月 22 日	筹划重 大投资 事项	12.89	2018 年 07 月 09 日	11.60	20,004	322,646.58	257,851.56	-
600751	海 航 科 技	2018 年 01 月 12 日	筹划重 大投资 事项	6.49	-	-	32,000	262,518.70	207,680.00	-
600750	江 中 药 业	2018 年 05 月 02 日	筹划重 大投资 事项	17.75	2018 年 08 月 01 日	16.12	7,280	146,332.96	129,220.00	-
002147	新 光 圆 成	2018 年 01 月 18 日	筹划重 大投资 事项	14.76	-	-	1,820	23,457.92	26,863.20	-

注:本基金截至 2018 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。2、截至本报告批准报出日,“旋极信息”、“棕榈股份”、“东方集团”、“中工国际”、“东方金钰”、“海航科技”、“新光圆成”“国机汽车”“齐翔腾达”“清新环境”仍未发布复牌公告。

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 2018 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 219,228,380.32 元，第二层次的余额为 17,822,981.92 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 262,801,656.16 元，第二层次 25,261,546.83 元，无属于第三层次的余额）。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2017 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括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	237,051,362.24	91.17
	其中：股票	237,051,362.24	91.17
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	21,612,187.64	8.31
7	其他各项资产	1,346,943.65	0.52
8	合计	260,010,493.53	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,340,217.92	0.52
B	采矿业	10,584,214.50	4.10
C	制造业	132,655,478.47	51.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,109,371.00	2.37
E	建筑业	3,353,062.78	1.30
F	批发和零售业	15,006,076.93	5.81
G	交通运输、仓储和邮政业	7,026,183.45	2.72
H	住宿和餐饮业	1,510,883.00	0.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,121,497.44	9.34
J	金融业	4,762,397.80	1.84
K	房地产业	11,632,516.26	4.50
L	租赁和商务服务业	7,411,856.95	2.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,634,282.80	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	758,499.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	5,519,193.21	2.14
S	综合	459,243.00	0.18
	合计	234,884,974.51	90.95

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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	191,454.74	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,893,706.85	0.73
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	-	-
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	81,226.14	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,166,387.73	0.84

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002195	二三四五	618,540	2,647,351.20	1.03
2	002439	启明星辰	121,492	2,578,060.24	1.00
3	000661	长春高新	11,100	2,527,470.00	0.98
4	002373	千方科技	193,300	2,522,565.00	0.98
5	600410	华胜天成	278,600	2,437,750.00	0.94
6	300182	捷成股份	319,700	2,423,326.00	0.94
7	300324	旋极信息	284,049	2,377,490.13	0.92
8	300113	顺网科技	136,300	2,372,983.00	0.92
9	600584	长电科技	139,400	2,361,436.00	0.91
10	000636	风华高科	147,900	2,348,652.00	0.91

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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000939	凯迪生态	218,300	1,089,317.00	0.42
2	000669	金鸿控股	101,080	732,830.00	0.28
3	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
4	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
5	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	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	000997	新 大 陆	6,546,687.54	2.14
2	300287	飞利信	6,127,207.54	2.00
3	002195	二三四五	5,432,605.85	1.77
4	300182	捷成股份	5,407,013.00	1.77
5	002491	通鼎互联	5,229,192.16	1.71
6	002373	千方科技	5,127,981.24	1.67
7	300297	蓝盾股份	4,947,650.32	1.62
8	300324	旋极信息	4,880,487.95	1.59
9	600410	华胜天成	4,878,416.40	1.59
10	600516	方大炭素	4,264,895.00	1.39
11	600499	科达洁能	4,230,815.27	1.38
12	000960	锡业股份	4,195,155.52	1.37
13	600884	杉杉股份	4,156,972.36	1.36
14	000050	深天马 A	4,026,108.58	1.31
15	002745	木林森	4,020,867.00	1.31
16	000039	中集集团	3,887,941.07	1.27
17	603025	大豪科技	3,826,972.87	1.25
18	600584	长电科技	3,811,961.00	1.24
19	002179	中航光电	3,770,497.00	1.23
20	600737	中粮糖业	3,765,307.64	1.23

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	000997	新 大 陆	6,868,826.67	2.24
2	300287	飞利信	5,205,315.98	1.70
3	002179	中航光电	5,179,875.19	1.69
4	000039	中集集团	4,897,775.23	1.60
5	002491	通鼎互联	4,829,497.84	1.58
6	000050	深天马 A	4,633,880.02	1.51
7	601928	凤凰传媒	4,489,243.93	1.47
8	002271	东方雨虹	4,472,210.21	1.46
9	002195	二三四五	4,410,320.99	1.44
10	000960	锡业股份	4,349,782.47	1.42
11	002410	广联达	4,322,576.88	1.41
12	600176	中国巨石	4,320,478.80	1.41
13	600521	华海药业	4,201,998.74	1.37
14	000988	华工科技	4,155,021.85	1.36
15	300182	捷成股份	4,104,847.73	1.34
16	600884	杉杉股份	4,095,613.66	1.34

17	002311	海大集团	4,072,190.93	1.33
18	000513	丽珠集团	3,979,000.15	1.30
19	600673	东阳光科	3,905,664.39	1.28
20	600516	方大炭素	3,829,772.44	1.25

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	663,365,585.82
卖出股票收入（成交）总额	674,865,348.70

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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前十名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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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
IC1812	IC1812	5	5,008,400.00	-440,280.00	-
公允价值变动总额合计(元)				-440,280.00	
股指期货投资本期收益(元)				-441,880.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-379,440.00	

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	1,188,940.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,442.04
5	应收申购款	151,561.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,346,943.65

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300324	旋极信息	2,377,490.13	0.92	筹划重大资产重组

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	002426	胜利精密	1,069,200.00	0.41	筹划重大资产重组

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	672	31,327.85	7,696,831.00	36.56%	13,355,485.00	63.44%
信诚中证 500 指数分级 B	4801	6,577.48	1,078,081.00	3.41%	30,500,394.00	96.59%
信诚中证 500 指数分级	12874	14,593.38	100,537,971.39	53.51%	87,337,249.23	46.49%
合计	18347	13,108.74	109,312,883.39	45.45%	131,193,128.23	54.55%

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	李星影	2,436,300.00	11.57%
2	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	2,222,471.00	10.56%
3	中国银河证券股份有限公司	1,896,875.00	9.01%
4	王嘉定	1,018,200.00	4.84%
5	余晓敏	997,530.00	4.74%
6	万范霞	763,107.00	3.62%
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	3.17%
8	中信建投证券股份有限公司	652,698.00	3.10%
9	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001	613,000.00	2.91%
10	鹏华资产—中信银行—鹏华资产华夏未来泽时进取 7 号 1 期资产管理计	516,334.00	2.45%

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	2.64%
2	郑智	523,016.00	1.66%
3	陈胜华	500,000.00	1.58%
4	杨东宁	485,613.00	1.54%
5	梁森泉	467,983.00	1.48%
6	云南云达工程造价咨询有限公司	432,871.00	1.37%
7	张钢	430,000.00	1.36%
8	广州市广百股份有限公司	384,000.00	1.22%
9	加建民	345,302.00	1.09%
10	张凤英	294,092.00	0.93%

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	中国人寿保险股份有限公司	36,711,314.74	19.54%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	27,593,169.75	14.69%
3	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001	25,413,546.59	13.53%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	8,209,458.58	4.37%
5	杨丽	2,620,033.65	1.39%
6	李汝波	1,420,419.81	0.76%
7	车亚丽	1,330,639.53	0.71%
8	幸福人寿保险股份有限公司—分红	1,280,999.00	0.68%
9	徐清华	847,301.31	0.45%
10	池航钊	579,392.85	0.31%

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	401,434.32	0.21%
	合计	401,434.32	0.17%

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。

8.4 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	信诚中证 500 指数分级	—

员、基金投资和 研究部门负责人持 有本开放式基金	A	
	信诚中证 500 指数分级 B	-
	信诚中证 500 指数分级	0~10
	合计	0~10
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	-
	信诚中证 500 指数分级 B	-
	信诚中证 500 指数分级	-
	合计	-

期末本基金基金经理未持有本基金。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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
本报告期期初基金份额总额	22,376,212.00	33,564,319.00	183,969,900.54
本报告期基金总申购份额	-	-	109,128,797.82
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	111,301,749.85
本报告期基金拆分变动份额	-1,323,896.00	-1,985,844.00	6,078,272.11
本报告期末基金份额总额	21,052,316.00	31,578,475.00	187,875,220.62

§ 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无重大人事变动。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、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	
兴业证券	2	243,241,770.38	18.21%	221,666.58	18.07%	-
东吴证券	2	231,230,849.26	17.31%	212,323.26	17.31%	-
招商证券	2	223,820,684.87	16.75%	203,966.41	16.63%	-
天风证券	2	180,461,881.74	13.51%	168,066.59	13.70%	-
广发证券	1	172,420,432.31	12.91%	160,575.44	13.09%	-
长江证券	2	122,973,459.47	9.21%	114,524.65	9.34%	-
华创证券	3	64,418,719.55	4.82%	58,704.79	4.79%	-
东兴证券	1	61,400,510.72	4.60%	55,954.45	4.56%	-
平安证券	2	18,305,057.57	1.37%	17,047.75	1.39%	-
国盛证券	2	10,009,647.55	0.75%	7,119.66	0.58%	本期新增
国金证券	1	5,028,363.68	0.38%	4,582.28	0.37%	-
华泰证券	2	2,371,418.05	0.18%	2,161.12	0.18%	本期新增 1 个交易单元
中信建投	2	224,424.96	0.02%	0.00	0.00%	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	本期新增 1 个交易单元
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-

宏源证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	本期新增 1 个交易单元
西藏东财	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	9,015.30	4.99%	-	-	-	-
招商证券	93,388.28	51.65%	-	-	-	-
天风证券	48,410.60	26.77%	-	-	-	-
广发证券	9,000.00	4.98%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	21,000.00	11.61%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-

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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180307 至 20180607	-	72,711,314.74	36,000,000.00	36,711,314.74	15.26%
	2	20180101 至 20180105, 20180108 至 20180123	54,431,570.76	-	54,431,570.76	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致： (1) 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中信保诚基金管理有限公司
2018 年 08 月 28 日