

信诚中证 500 指数分级证券投资基金
2020 年中期报告

2020 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

报告送出日期：2020 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。本中期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 2020 年 08 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 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	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..	11
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1	资产负债表	11
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	14
§ 7	投资组合报告	31
7.1	期末基金资产组合情况	31
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
7.8	报告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	47
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	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48

§ 8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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情况	51
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	51
§ 9	开放式基金份额变动	52
§ 10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

§ 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	159,093,146.54 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 03 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	16,256,688.00 份	24,385,033.00 份	118,451,425.54 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	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 500A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	信诚中证 500B 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	李申
	联系电话	021-68649788	021-60637102
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637111
传真		021-50120888	021-60635778
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	18,824,064.54
本期利润	28,262,344.35
加权平均基金份额本期利润	0.1425
本期加权平均净值利润率	12.21%
本期基金份额净值增长率	15.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	41,877,081.71
期末可供分配基金份额利润	0.2632
期末基金资产净值	204,252,985.06
期末基金份额净值	1.284
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	65.22%

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	9.56%	0.84%	8.04%	0.84%	1.52%	0.00%
过去三个月	18.89%	1.08%	15.47%	1.08%	3.42%	0.00%
过去六个月	15.27%	1.68%	10.85%	1.70%	4.42%	-0.02%
过去一年	26.79%	1.36%	17.65%	1.39%	9.14%	-0.03%
过去三年	9.96%	1.35%	-3.77%	1.39%	13.73%	-0.04%
自基金合同生 效起至今	65.22%	1.59%	24.91%	1.59%	40.31%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 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2020年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为71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)、中信保诚景华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、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建设工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽18个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型

证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智慧金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月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、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金。

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, 兼任信诚中证建设工程指数型证券投资基金 (LOF)、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、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、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的基金经理。	2018 年 07 月 25 日	-	8	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)、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、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、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合规守信情况的说明

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

2020 年上半年,国内经济形势逐步缓和。随着全球复工复产,经济面受到的主要影响因素:新冠疫情对经济的影响处于逐步缓和的状态。上半年,医药、半导体、消费仍然是领涨行业;而休闲娱乐随着免税开放的政策落地也大幅拉升;周期、金融在上半年中表现不佳。上半年,上证综指涨幅-0.79%、深证成指涨幅 16.13%、创业板指涨幅 35.6%。

2020 年上半年宏观数据较为乐观,二季度 GDP 实际同比增 3.2%,经济恢复向好的势头有望持续;宽信用的政策带动社融数据显著回升并构造了流动性宽松的市场环境,其中社融增速主要由人民币贷款和政府债券支撑;上半年 CPI 逐月走低,而近期 CPI 有所回升的主要原因在于洪灾导致的猪肉价格和农产品价格上涨,结合经济回升的现状来看通胀压力并不大;制造业 PMI 连续五个月维持在 50 以上,表明经济仍在好转。国内经济整体复苏共同导致工业金属需求增加,而南美疫情导致部分工业金属供给端收紧,配合国内流动性宽松的大环境,有色板块近期上涨较多。然而需关注中美关系的后续发展,中美互关领事馆等事件导致中美关系的不确定性有所上升,国际贸易摩擦加剧,需关注国际形势给 A 股市场带来的不确定性;同时,国内避险情绪升温也导致了黄金白银等贵金属持续走强。

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 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 15.27%,同期业绩比较基准收益率为 10.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,总体来说我们更加看好估值处于合理区间的行业龙头。从疫情中复工是中国相对世界其他国家更具确定性的情况,因此全球资本流入是大势所趋。风险在于中美的大国博弈或能产生对中国较为负面的影响。

从行业角度看,下半年我们持续看好消费、医药以及电子科技对股市的带动作用,同时会关注低估值行业的中短期回暖,比如金融板块中的非银板块以及周期股。对于科创板以及未来创业板的改革抱有正向预期,未来将长期持有在科创板及创业板上市的科技龙头企业。

我们坚持以“价值”作为投资,看好未来在各行业聚集效用,做价值股的长期投资。

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够公允时,可申请召开估值决策委员会临时会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、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：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	13,405,915.00	15,651,173.35
结算备付金	-	1,370,897.00	2,410,499.66
存出保证金	-	334,603.95	607,352.05
交易性金融资产	6.4.7.2	190,902,847.72	225,307,886.52
其中：股票投资	-	190,738,328.77	224,861,586.52
债券投资	-	164,518.95	446,300.00
资产支持证券投资	-	-	-
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	-	145,640.85	-
应收利息	6.4.7.5	2,663.67	3,728.22
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	2,385,439.99	586,548.61
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	208,548,008.18	244,567,188.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	328,341.68	-
应付赎回款	-	3,271,865.56	757,377.90
应付管理人报酬	-	165,205.03	199,457.07
应付托管费	-	36,345.11	43,880.57
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	156,664.41	193,864.86
应交税费	-	7,842.93	2,156.30
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	328,758.40	527,170.45
负债合计	-	4,295,023.12	1,723,907.15
所有者权益：	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	123,564,172.32	169,381,332.50

未分配利润	6.4.7.10	80,688,812.74	73,461,948.76
所有者权益合计	-	204,252,985.06	242,843,281.26
负债和所有者权益总计	-	208,548,008.18	244,567,188.41

注：截止本报告期末，基金份额总额 159,093,146.54 份，信诚中证 500 指数分级的基金份额净值 1.284 元，基金份额总额 118,451,425.54 份。下属分级基金：信诚中证 500 指数分级 A 的基金份额净值 1.019 元，基金份额总额 16,256,688.00 份；信诚中证 500 指数分级 B 的基金份额净值 1.461 元，基金份额总额 24,385,033.00 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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日 至 2019 年 06 月 30 日
一、收入	-	30,414,883.37	28,263,913.19
1. 利息收入	-	64,463.79	45,351.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,331.86	45,297.14
债券利息收入	-	131.93	54.74
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	20,689,760.56	13,004,161.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,847,767.97	11,913,532.57
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	160,491.68	30,983.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	386,601.94	-463,972.04
股利收益	6.4.7.15	1,294,898.97	1,523,617.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,438,279.81	15,160,342.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	222,379.21	54,057.07
减：二、费用	-	2,152,539.02	1,820,516.75
1. 管理人报酬	-	1,150,311.67	805,998.68
2. 托管费	-	253,068.54	177,319.73
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	472,351.90	565,105.97
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 税金及附加	-	1,392.23	208.31
7. 其他费用	6.4.7.19	275,414.68	271,884.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	28,262,344.35	26,443,396.44

减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	28,262,344.35	26,443,396.44

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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 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）	169,381,332.50	73,461,948.76	242,843,281.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,262,344.35	28,262,344.35
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）	-45,817,160.18	-21,035,480.37	-66,852,640.55
其中：1. 基金申购款	70,180,046.59	35,334,493.79	105,514,540.38
2. 基金赎回款	-115,997,206.77	-56,369,974.16	-172,367,180.93
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）	123,564,172.32	80,688,812.74	204,252,985.06
项目	上年度可比期间 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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	126,079,498.04	38,361,718.77	164,441,216.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

唐世春

陈逸辛

刘卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚中证 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。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

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〈年度报告和中期报告〉》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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

本基金在本报告期间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 2020 年 06 月 30 日
活期存款	13,405,915.00
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	13,405,915.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
----	-------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	169,989,840.79	190,738,328.77	20,748,487.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	122,300.00	164,518.95
	银行间市场	-	-
	合计	122,300.00	164,518.95
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	170,112,140.79	190,902,847.72	20,790,706.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,082,480.00	-	-	-
IC2012	2,082,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,082,480.00	-	-	-

注：1、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。

2、于本年度末，本基金持有 2 手中证 500 股指期货 IC2012，合约市值为 2,198,640.00 元，公允价值变动为 116,160.00 元。

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 2020 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	2,383.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	27.09
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	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	253.15
合计	2,663.67

注：其他包括应收结算保证金利息、应收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 2020 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	156,664.41
银行间市场应付交易费用	—
合计	156,664.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	10,109.92
应付审计费	74,590.88
应付信息披露费	159,672.34
应付指数使用费	50,050.00
应付账户维护费	4,500.00
应付基金上市费	29,835.26
合计	328,758.40

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,211,367.86	169,381,332.50
本期申购	19,523,277.48	15,436,393.67
本期赎回（以“-”号填列）	-8,918,974.51	-7,052,010.23
2020 年 02 月 03 日基金拆分/份额折算前	224,815,670.83	177,765,715.94
基金拆分/份额折算调整	4,062,804.13	—
本期申购	70,483,227.08	54,743,652.92
本期赎回（以“-”号填列）	-140,268,555.50	-108,945,196.54
本期末	159,093,146.54	123,564,172.32

注：1、申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

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 2020 年 2 月 3 日为份额折算基准日，对本基金实施定期份额折算。

3、本基金本报告期末场内外基金份额如下：

基金代码	场内简称	本报告期末	
		场内	场外
150028	中证500A	16,256,688.00	-
150029	中证500B	24,385,033.00	-
165511	信诚500	12,920,716.00	105,530,709.54

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	34,669,277.96	38,792,670.80	73,461,948.76
本期利润	18,824,064.54	9,438,279.81	28,262,344.35
本期基金份额交易产生的变动数	-11,616,260.79	-9,419,219.58	-21,035,480.37
其中：基金申购款	16,518,549.07	18,815,944.72	35,334,493.79
基金赎回款	-28,134,809.86	-28,235,164.30	-56,369,974.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,877,081.71	38,811,731.03	80,688,812.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	57,080.64
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	1,640.03
其他	5,611.19
合计	64,331.86

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入、中金所清算备付金利息收入。

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 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	188,631,465.34
减：卖出股票成本总额	169,783,697.37
买卖股票差价收入	18,847,767.97

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 2020年01月01日至2020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	160,491.68
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	160,491.68
----	------------

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 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,061,958.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	901,300.00
减：应收利息总额	166.41
买卖债券差价收入	160,491.68

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	本期收益金额 2020年01月01日至2020年06月30日
股指期货投资收益	386,601.94

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,294,898.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,294,898.97

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	9,450,229.11
--股票投资	9,408,010.16
--债券投资	42,218.95
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-8,160.00
--权证投资	-
--期货投资	-8,160.00

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	3,789.30
合计	9,438,279.81

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	222,345.44
转换费收入	33.77
合计	222,379.21

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	472,102.70
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	249.20
合计	472,351.90

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34
指数使用费	100,100.00
银行费用	2,216.20
账户维护费	9,000.00
基金上市费	29,835.26
合计	275,414.68

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

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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股票交易。

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权证交易。

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债券交易。

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,150,311.67	805,998.68
其中：支付销售机构的客户维护费	356,752.22	271,799.15

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	253,068.54	177,319.73

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	13,405,915.00	57,080.64	10,216,313.55	39,185.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 2020 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
002500	山西证券	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 10 日	增发流通受限	5.00	6.54	20,910	104,550.00	136,751.40	-
300840	酷特智能	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 06 月 23 日	2020 年 07 月 02 日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 03 日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 01 日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

300847	中船汉光	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 09 日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688026	洁特生物	2020 年 01 月 15 日	2020 年 07 月 22 日	锁定期股票	16.49	83.32	4,101	67,625.49	341,695.32	-
688027	国盾量子	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 09 日	新发未上市	36.18	36.18	1,273	46,057.14	46,057.14	-
688080	映翰通	2020 年 02 月 03 日	2020 年 08 月 12 日	锁定期股票	27.63	86.78	2,233	61,697.79	193,779.74	-
688106	金宏气体	2020 年 06 月 09 日	2020 年 12 月 16 日	锁定期股票	15.48	41.36	3,874	59,969.52	160,228.64	-
688200	华峰测控	2020 年 02 月 11 日	2020 年 08 月 18 日	锁定期股票	107.41	270.02	1,092	117,291.72	294,861.84	-
688233	神工股份	2020 年 02 月 13 日	2020 年 08 月 21 日	锁定期股票	21.67	49.26	5,455	118,209.85	268,713.30	-
688277	天智航	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 07 日	新发未上市	12.04	12.04	5,175	62,307.00	62,307.00	-
688278	特宝生物	2020 年 01 月 09 日	2020 年 07 月 17 日	锁定期股票	8.24	67.73	8,405	69,257.20	569,270.65	-
688377	迪威尔	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 08 日	新发未上市	16.42	16.42	2,972	48,800.24	48,800.24	-
688528	秦川物联	2020 年 06 月 19 日	2020 年 07 月 01 日	新发未上市	11.33	11.33	4,585	51,948.05	51,948.05	-

688599	天合光能	2020 年 06 月 02 日	2020 年 12 月 10 日	锁定期股票	8.16	13.91	6,706	54,720.96	93,280.46	-
688600	皖仪科技	2020 年 06 月 23 日	2020 年 07 月 03 日	新发未上市	15.50	15.50	2,916	45,198.00	45,198.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128115	巨星转债	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 16 日	新发未上市	100.00	100.00	358	35,800.00	35,800.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	金正大	2020 年 06 月 30 日	公司股票被实行退市风险警示	2.27	2020 年 07 月 01 日	2.16	25,300	109,311.94	57,431.00	-
601880	大连港	2020 年 06 月 22 日	筹划重大资产重组	1.72	2020 年 07 月 08 日	1.89	76,000	157,150.05	130,720.00	-

注：本基金本报告期末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。

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市场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市场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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	26,000.00
AAA 以下	164,518.95	420,300.00
未评级	-	-
合计	164,518.95	446,300.00

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约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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期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公司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、结算备付金及债券投资等。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 2020 年 06 月 30	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日							
资产							
银行存款	13,405,915.00	-	-	-	-	-	13,405,915.00
结算备付金	1,370,897.00	-	-	-	-	-	1,370,897.00
存出保证金	26,794.35	-	-	-	-	307,809.60	334,603.95
交易性金融资产	-	-	-	-	164,518.95	190,738,328.77	190,902,847.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	145,640.85	145,640.85
应收利息	-	-	-	-	-	2,663.67	2,663.67
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,385,439.99	2,385,439.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,803,606.35	-	-	-	164,518.95	193,579,882.88	208,548,008.18
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	-	-	-	-	-	328,341.68	328,341.68
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,271,865.56	3,271,865.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,205.03	165,205.03
应付托管费	-	-	-	-	-	36,345.11	36,345.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	156,664.41	156,664.41
应交税费	-	-	-	-	-	7,842.93	7,842.93
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	328,758.40	328,758.40
负债总计	-	-	-	-	-	4,295,023.12	4,295,023.12
利率敏感度缺	14,803,606.35	-	-	-	164,518.95	189,284,859.77	204,252,985.06

口	5				5	6	6
上年度末 2019 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	15,651,173.35	-	-	-	-	-	15,651,173.35
结算备付金	2,410,499.66	-	-	-	-	-	2,410,499.66
存出保证金	23,294.45	-	-	-	-	584,057.60	607,352.05
交易性金融资产	-	-	-	-	446,300.00	224,861,586.52	225,307,886.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,728.22	3,728.22
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	586,548.61	586,548.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,084,967.46	-	-	-	446,300.00	226,035,920.95	244,567,188.41
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	757,377.90	757,377.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	199,457.07	199,457.07
应付托管费	-	-	-	-	-	43,880.57	43,880.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	193,864.86	193,864.86
应交税费	-	-	-	-	-	2,156.30	2,156.30
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	527,170.45	527,170.45
负债总计	-	-	-	-	1,723,907.15	1,723,907.15
利率敏感度缺口	18,084,967.46	-	-	446,300.00	224,312,013.80	242,843,281.26

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账面价值，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金融资产与负债的比例较低。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 2020 年 06 月 30 日		上年度末 2019 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	190,738,328.77	93.38	224,861,586.52	92.60
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	190,738,328.77	93.38	224,861,586.52	92.60

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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(2020 年 06 月 30 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指	9,593,170.92	10,944,292.41

	数上升 5%		
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-9,593,170.92	-10,944,292.41

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。

于本报告期末，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资产中属于第一层次的余额为 188,466,240.62 元，属于第二层次的余额为 2,436,607.10 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 224,200,096.88 元，第二层次 1,107,789.64 元，无第三层次）

(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

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

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

(3) 除以上事项外，截至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	190,738,328.77	91.46
	其中：股票	190,738,328.77	91.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	164,518.95	0.08
	其中：债券	164,518.95	0.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,776,812.00	7.09
8	其他各项资产	2,868,348.46	1.38
9	合计	208,548,008.18	100.00

7.2 报告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	1,119,405.20	0.55
B	采矿业	4,360,759.70	2.13
C	制造业	112,649,511.79	55.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,848,373.40	1.88
E	建筑业	2,469,285.80	1.21
F	批发和零售业	11,407,218.18	5.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,600,632.38	2.25
H	住宿和餐饮业	620,377.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,143,556.89	8.88
J	金融业	5,378,897.22	2.63
K	房地产业	7,318,371.48	3.58
L	租赁和商务服务业	3,670,821.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	2,072,651.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,428,325.60	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	74,520.00	0.04
Q	卫生和社会工作	2,263,220.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	5,309,735.45	2.60
S	综合	651,914.00	0.32
	合计	188,387,576.09	92.23

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	2,232.00	0.00
C	制造业	2,322,320.79	1.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,336.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,350,752.68	1.15

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所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	97,600	1,928,576.00	0.94
2	601128	常熟银行	242,200	1,818,922.00	0.89
3	002127	南极电商	84,800	1,795,216.00	0.88
4	002081	金螳螂	210,300	1,652,958.00	0.81
5	002821	凯莱英	5,600	1,360,800.00	0.67
6	600729	重庆百货	43,300	1,351,826.00	0.66
7	002419	天虹股份	136,500	1,303,575.00	0.64
8	300253	卫宁健康	56,610	1,298,633.40	0.64
9	300558	贝达药业	9,100	1,273,818.00	0.62
10	600161	天坛生物	26,880	1,218,470.40	0.60
11	002223	鱼跃医疗	32,950	1,199,380.00	0.59
12	300482	万孚生物	11,500	1,196,000.00	0.59
13	603882	金域医学	13,100	1,172,450.00	0.57
14	300595	欧普康视	16,900	1,171,846.00	0.57
15	603939	益丰药房	12,800	1,164,800.00	0.57
16	600201	生物股份	41,600	1,158,144.00	0.57
17	300357	我武生物	18,500	1,151,625.00	0.56
18	603233	大参林	14,124	1,147,151.28	0.56
19	600325	华发股份	159,330	1,124,869.80	0.55
20	001914	招商积余	36,600	1,124,718.00	0.55
21	300009	安科生物	62,580	1,120,182.00	0.55
22	002019	亿帆医药	48,500	1,114,045.00	0.55
23	002439	启明星辰	26,300	1,106,441.00	0.54
24	002385	大北农	121,300	1,105,043.00	0.54
25	603444	吉比特	2,000	1,098,020.00	0.54
26	000513	丽珠集团	22,850	1,097,028.50	0.54
27	300244	迪安诊断	30,900	1,090,770.00	0.53
28	002185	华天科技	80,500	1,089,165.00	0.53
29	600380	健康元	67,000	1,088,080.00	0.53
30	603707	健友股份	16,800	1,084,776.00	0.53
31	000975	银泰黄金	68,240	1,070,003.20	0.52

32	000739	普洛药业	45,882	1,068,591.78	0.52
33	002340	格林美	214,400	1,065,568.00	0.52
34	600298	安琪酵母	21,500	1,063,820.00	0.52
35	600466	蓝光发展	195,220	1,052,235.80	0.52
36	300088	长信科技	93,200	1,043,840.00	0.51
37	002244	滨江集团	241,700	1,032,059.00	0.51
38	000031	大悦城	202,300	1,029,707.00	0.50
39	600511	国药股份	25,300	1,028,951.00	0.50
40	300496	中科创达	13,100	1,017,870.00	0.50
41	300630	普利制药	13,700	1,013,115.00	0.50
42	002212	南洋股份	38,100	1,012,698.00	0.50
43	300271	华宇软件	34,300	967,603.00	0.47
44	300212	易华录	17,200	963,200.00	0.47
45	002273	水晶光电	55,540	951,955.60	0.47
46	002174	游族网络	36,500	951,920.00	0.47
47	000028	国药一致	21,100	949,711.00	0.46
48	002373	千方科技	39,500	947,605.00	0.46
49	002901	大博医疗	7,900	942,391.00	0.46
50	300058	蓝色光标	120,200	937,560.00	0.46
51	000988	华工科技	38,300	935,669.00	0.46
52	300207	欣旺达	49,300	931,770.00	0.46
53	300618	寒锐钴业	14,900	924,098.00	0.45
54	002414	高德红外	31,260	915,292.80	0.45
55	600845	宝信软件	15,490	915,149.20	0.45
56	000970	中科三环	92,228	901,989.84	0.44
57	300113	顺网科技	35,500	901,700.00	0.44
58	002396	星网锐捷	25,500	900,915.00	0.44
59	002156	通富微电	35,800	896,790.00	0.44
60	002074	国轩高科	33,400	896,456.00	0.44
61	002281	光迅科技	27,100	890,506.00	0.44
62	601799	星宇股份	7,000	889,000.00	0.44
63	300251	光线传媒	81,300	886,983.00	0.43
64	600699	均胜电子	37,160	884,779.60	0.43
65	300010	立思辰	45,100	882,607.00	0.43
66	000807	云铝股份	202,300	882,028.00	0.43
67	600728	佳都科技	95,700	871,827.00	0.43
68	002138	顺络电子	34,900	870,755.00	0.43
69	600885	宏发股份	21,700	870,604.00	0.43
70	601958	金钼股份	140,300	867,054.00	0.42
71	002368	太极股份	19,300	843,217.00	0.41
72	603712	七一二	21,700	832,846.00	0.41

73	600884	杉杉股份	70,635	832,786.65	0.41
74	002465	海格通信	64,000	828,160.00	0.41
75	002920	德赛西威	13,500	827,955.00	0.41
76	300115	长盈精密	36,200	827,170.00	0.40
77	300133	华策影视	114,000	826,500.00	0.40
78	300316	晶盛机电	33,400	826,316.00	0.40
79	300285	国瓷材料	24,600	824,346.00	0.40
80	603659	璞泰来	8,000	824,160.00	0.40
81	600195	中牧股份	50,720	823,185.60	0.40
82	300166	东方国信	66,300	822,783.00	0.40
83	002458	益生股份	53,400	815,418.00	0.40
84	300182	捷成股份	203,700	812,763.00	0.40
85	600153	建发股份	99,900	809,190.00	0.40
86	000681	视觉中国	43,100	802,522.00	0.39
87	601098	中南传媒	75,608	799,932.64	0.39
88	300274	阳光电源	55,400	797,206.00	0.39
89	002583	海能达	104,800	795,432.00	0.39
90	000581	威孚高科	38,300	792,044.00	0.39
91	600143	金发科技	59,800	787,566.00	0.39
92	601928	凤凰传媒	114,400	777,920.00	0.38
93	601689	拓普集团	27,860	777,294.00	0.38
94	300001	特锐德	36,700	768,498.00	0.38
95	603228	景旺电子	21,712	764,045.28	0.37
96	002925	盈趣科技	13,100	759,014.00	0.37
97	603517	绝味食品	10,600	749,844.00	0.37
98	002815	崇达技术	36,800	744,464.00	0.36
99	600026	中远海能	114,500	739,670.00	0.36
100	603806	福斯特	14,780	737,669.80	0.36
101	600426	华鲁恒升	41,600	735,488.00	0.36
102	000547	航天发展	53,800	735,446.00	0.36
103	002507	涪陵榨菜	20,200	727,402.00	0.36
104	000089	深圳机场	93,800	718,508.00	0.35
105	002048	宁波华翔	46,400	716,416.00	0.35
106	601333	广深铁路	315,100	708,975.00	0.35
107	600580	卧龙电驱	62,800	705,872.00	0.35
108	002353	杰瑞股份	22,600	700,600.00	0.34
109	600282	南钢股份	215,700	696,711.00	0.34
110	600132	重庆啤酒	9,500	693,500.00	0.34
111	603515	欧普照明	25,250	691,092.50	0.34
112	002434	万里扬	79,200	687,456.00	0.34
113	002013	中航机电	86,700	684,930.00	0.34

114	600315	上海家化	14,200	680,180.00	0.33
115	002250	联化科技	31,200	680,160.00	0.33
116	603885	吉祥航空	74,600	678,860.00	0.33
117	002110	三钢闽光	101,350	674,991.00	0.33
118	002557	洽洽食品	12,400	671,956.00	0.33
119	600879	航天电子	104,300	671,692.00	0.33
120	603786	科博达	8,900	670,615.00	0.33
121	601615	明阳智能	53,800	669,810.00	0.33
122	300070	碧水源	81,400	660,968.00	0.32
123	600486	扬农化工	8,000	660,000.00	0.32
124	000932	华菱钢铁	174,400	657,488.00	0.32
125	600782	新钢股份	159,200	649,536.00	0.32
126	601233	桐昆股份	50,700	646,932.00	0.32
127	603056	德邦股份	47,600	644,028.00	0.32
128	603338	浙江鼎力	8,480	642,529.60	0.31
129	002690	美亚光电	12,200	641,720.00	0.31
130	600507	方大特钢	123,174	639,273.06	0.31
131	600167	联美控股	43,980	630,673.20	0.31
132	600862	中航高科	35,800	605,736.00	0.30
133	600779	水井坊	9,700	605,474.00	0.30
134	600967	内蒙一机	57,500	597,425.00	0.29
135	002080	中材科技	38,500	596,750.00	0.29
136	600528	中铁工业	67,400	594,468.00	0.29
137	603605	珀莱雅	3,300	594,066.00	0.29
138	300474	景嘉微	8,800	592,240.00	0.29
139	601003	柳钢股份	133,500	591,405.00	0.29
140	600801	华新水泥	24,660	584,688.60	0.29
141	002221	东华能源	65,900	579,261.00	0.28
142	601966	玲珑轮胎	28,600	577,720.00	0.28
143	603568	伟明环保	24,833	576,125.60	0.28
144	603866	桃李面包	11,300	575,057.00	0.28
145	000401	冀东水泥	35,500	569,420.00	0.28
146	600160	巨化股份	82,370	567,529.30	0.28
147	002648	卫星石化	34,600	562,942.00	0.28
148	002563	森马服饰	79,400	559,770.00	0.27
149	600597	光明乳业	37,400	555,764.00	0.27
150	000598	兴蓉环境	119,400	549,240.00	0.27
151	002595	豪迈科技	28,000	544,880.00	0.27
152	000967	盈峰环境	65,400	539,550.00	0.26
153	600388	龙净环保	61,000	536,800.00	0.26
154	002064	华峰氨纶	105,800	536,406.00	0.26

155	000301	东方盛虹	95,600	531,536.00	0.26
156	002444	巨星科技	44,000	522,720.00	0.26
157	603486	科沃斯	16,980	512,965.80	0.25
158	600409	三友化工	109,800	511,668.00	0.25
159	600835	上海机电	30,100	509,593.00	0.25
160	601200	上海环境	42,150	505,800.00	0.25
161	000543	皖能电力	122,600	492,852.00	0.24
162	600141	兴发集团	54,900	491,355.00	0.24
163	603983	丸美股份	5,700	490,371.00	0.24
164	000553	安道麦 A	54,100	487,982.00	0.24
165	002572	索菲亚	20,000	483,400.00	0.24
166	601139	深圳燃气	74,200	482,300.00	0.24
167	000600	建投能源	94,700	482,023.00	0.24
168	000877	天山股份	31,900	481,690.00	0.24
169	603317	天味食品	8,600	477,988.00	0.23
170	002511	中顺洁柔	21,058	469,593.40	0.23
171	002233	塔牌集团	38,200	459,546.00	0.22
172	002078	太阳纸业	47,700	454,104.00	0.22
173	002372	伟星新材	38,720	450,313.60	0.22
174	600739	辽宁成大	23,600	446,748.00	0.22
175	603225	新凤鸣	44,600	445,108.00	0.22
176	600529	山东药玻	7,300	423,400.00	0.21
177	002131	利欧股份	104,300	402,598.00	0.20
178	600079	人福医药	14,600	397,412.00	0.19
179	601865	福莱特	21,100	396,680.00	0.19
180	002242	九阳股份	10,400	387,608.00	0.19
181	600521	华海药业	11,210	380,355.30	0.19
182	002831	裕同科技	13,820	380,188.20	0.19
183	600567	山鹰纸业	128,200	378,190.00	0.19
184	603816	顾家家居	7,940	357,379.40	0.17
185	600060	海信视像	29,000	352,350.00	0.17
186	002191	劲嘉股份	39,300	350,163.00	0.17
187	002429	兆驰股份	69,100	342,045.00	0.17
188	002075	沙钢股份	27,300	341,250.00	0.17
189	000629	攀钢钒钛	169,000	339,690.00	0.17
190	000009	中国宝安	39,800	338,698.00	0.17
191	000488	晨鸣纸业	67,600	333,944.00	0.16
192	601099	太平洋	105,200	333,484.00	0.16
193	000983	西山煤电	86,950	326,062.50	0.16
194	002701	奥瑞金	76,900	322,211.00	0.16
195	000636	风华高科	11,000	321,090.00	0.16

196	600754	锦江酒店	11,500	319,125.00	0.16
197	300418	昆仑万维	12,700	316,992.00	0.16
198	002867	周大生	14,200	314,814.00	0.15
199	300315	掌趣科技	42,605	312,294.65	0.15
200	601699	潞安环能	56,000	311,920.00	0.15
201	600258	首旅酒店	19,600	301,252.00	0.15
202	002603	以岭药业	9,300	290,067.00	0.14
203	300168	万达信息	12,800	282,496.00	0.14
204	600138	中青旅	27,900	275,373.00	0.13
205	002128	露天煤业	35,300	273,575.00	0.13
206	600859	王府井	6,000	273,300.00	0.13
207	600339	中油工程	117,300	266,271.00	0.13
208	300024	机器人	19,300	263,831.00	0.13
209	002797	第一创业	37,800	261,576.00	0.13
210	002030	达安基因	9,450	257,796.00	0.13
211	600985	淮北矿业	33,000	257,070.00	0.13
212	603868	飞科电器	5,200	256,516.00	0.13
213	300017	网宿科技	30,100	255,549.00	0.13
214	000750	国海证券	58,850	255,409.00	0.13
215	603858	步长制药	8,800	253,880.00	0.12
216	000021	深科技	11,400	248,862.00	0.12
217	002195	二三四五	88,360	248,291.60	0.12
218	603355	莱克电气	9,900	246,411.00	0.12
219	000050	深天马 A	15,800	242,688.00	0.12
220	600895	张江高科	11,900	242,403.00	0.12
221	002152	广电运通	18,600	240,684.00	0.12
222	600410	华胜天成	17,000	231,200.00	0.11
223	600667	太极实业	19,500	230,490.00	0.11
224	600037	歌华有线	15,000	228,000.00	0.11
225	600535	天士力	14,000	227,080.00	0.11
226	000623	吉林敖东	14,400	226,512.00	0.11
227	600155	华创阳安	18,800	225,412.00	0.11
228	600642	申能股份	37,900	223,989.00	0.11
229	002500	山西证券	34,110	223,079.40	0.11
230	002382	蓝帆医疗	7,400	222,814.00	0.11
231	000630	铜陵有色	113,800	219,634.00	0.11
232	600126	杭钢股份	20,900	217,360.00	0.11
233	002926	华西证券	20,400	216,852.00	0.11
234	600415	小商品城	43,600	212,332.00	0.10
235	600811	东方集团	47,760	211,099.20	0.10
236	600216	浙江医药	10,500	202,230.00	0.10

237	600804	鹏博士	22,000	197,560.00	0.10
238	002028	思源电气	9,400	192,324.00	0.09
239	002268	卫 士 通	9,000	192,060.00	0.09
240	600909	华安证券	27,900	190,557.00	0.09
241	002294	信立泰	6,400	189,824.00	0.09
242	300002	神州泰岳	30,200	186,938.00	0.09
243	603883	老百姓	1,825	182,573.00	0.09
244	000686	东北证券	21,600	182,520.00	0.09
245	000997	新 大 陆	11,300	180,574.00	0.09
246	600446	金证股份	9,300	180,420.00	0.09
247	600418	江淮汽车	20,400	180,132.00	0.09
248	002387	维信诺	12,600	179,928.00	0.09
249	600827	百联股份	12,400	179,180.00	0.09
250	600460	士兰微	12,100	177,628.00	0.09
251	600598	北大荒	10,912	175,683.20	0.09
252	000999	华润三九	6,000	175,140.00	0.09
253	600959	江苏有线	46,200	173,712.00	0.09
254	600733	北汽蓝谷	26,900	172,967.00	0.08
255	002317	众生药业	10,000	171,600.00	0.08
256	601168	西部矿业	29,400	170,520.00	0.08
257	600256	广汇能源	62,800	169,560.00	0.08
258	603000	人民网	8,500	168,555.00	0.08
259	000878	云南铜业	15,700	166,577.00	0.08
260	300296	利亚德	27,400	166,318.00	0.08
261	600260	凯乐科技	12,300	166,296.00	0.08
262	000564	供销大集	37,000	166,130.00	0.08
263	600820	隧道股份	29,100	164,415.00	0.08
264	002670	国盛金控	17,900	163,785.00	0.08
265	600704	物产中大	38,900	163,769.00	0.08
266	600839	四川长虹	56,900	163,303.00	0.08
267	600497	驰宏锌锗	47,000	161,680.00	0.08
268	002124	天邦股份	12,500	160,625.00	0.08
269	600673	东阳光	23,200	160,312.00	0.08
270	600572	康恩贝	28,800	158,400.00	0.08
271	600008	首创股份	52,500	158,025.00	0.08
272	000158	常山北明	14,800	154,512.00	0.08
273	600718	东软集团	13,400	154,100.00	0.08
274	600549	厦门钨业	13,000	153,920.00	0.08
275	300026	红日药业	27,800	153,456.00	0.08
276	601179	中国西电	31,600	152,944.00	0.07
277	000800	一汽解放	14,200	152,508.00	0.07

278	600875	东方电气	17,100	151,335.00	0.07
279	600171	上海贝岭	8,700	151,206.00	0.07
280	002217	合力泰	28,800	151,200.00	0.07
281	600021	上海电力	20,100	148,740.00	0.07
282	000729	燕京啤酒	21,700	148,645.00	0.07
283	600094	大名城	24,500	145,775.00	0.07
284	600881	亚泰集团	50,000	145,500.00	0.07
285	002399	海普瑞	5,800	145,232.00	0.07
286	600645	中源协和	5,100	144,075.00	0.07
287	002709	天赐材料	4,240	143,269.60	0.07
288	000060	中金岭南	38,500	143,220.00	0.07
289	002056	横店东磁	12,600	141,750.00	0.07
290	000090	天健集团	20,180	139,443.80	0.07
291	600064	南京高科	14,300	138,996.00	0.07
292	600273	嘉化能源	15,400	134,596.00	0.07
293	601005	重庆钢铁	89,700	133,653.00	0.07
294	600392	盛和资源	18,900	133,245.00	0.07
295	000960	锡业股份	15,456	132,303.36	0.06
296	002807	江阴银行	33,580	131,969.40	0.06
297	600755	厦门国贸	19,900	131,340.00	0.06
298	002004	华邦健康	24,400	131,272.00	0.06
299	002203	海亮股份	15,000	131,250.00	0.06
300	002085	万丰奥威	20,200	130,896.00	0.06
301	601880	大连港	76,000	130,720.00	0.06
302	600039	四川路桥	34,200	130,644.00	0.06
303	600563	法拉电子	2,100	129,780.00	0.06
304	600737	中粮糖业	16,500	128,370.00	0.06
305	601118	海南橡胶	26,400	128,304.00	0.06
306	600166	福田汽车	70,800	127,440.00	0.06
307	601975	招商南油	53,300	127,387.00	0.06
308	600566	济川药业	5,000	127,300.00	0.06
309	000690	宝新能源	26,800	126,496.00	0.06
310	000778	新兴铸管	36,800	126,224.00	0.06
311	300324	旋极信息	18,849	125,534.34	0.06
312	600515	海航基础	24,100	125,320.00	0.06
313	600373	中文传媒	10,600	124,868.00	0.06
314	000400	许继电气	9,300	122,760.00	0.06
315	002506	协鑫集成	47,000	122,670.00	0.06
316	002183	怡亚通	22,800	122,208.00	0.06
317	000402	金融街	18,400	122,176.00	0.06
318	002635	安洁科技	4,900	122,010.00	0.06

319	002745	木林森	7,900	121,739.00	0.06
320	002038	双鹭药业	9,500	121,695.00	0.06
321	600435	北方导航	16,000	120,960.00	0.06
322	000738	航发控制	8,800	120,120.00	0.06
323	002092	中泰化学	26,400	119,592.00	0.06
324	600643	爱建集团	14,962	118,947.90	0.06
325	601860	紫金银行	28,100	118,863.00	0.06
326	002839	张家港行	20,600	118,656.00	0.06
327	000039	中集集团	16,380	118,427.40	0.06
328	600808	马钢股份	45,900	118,422.00	0.06
329	601106	中国一重	42,000	118,020.00	0.06
330	600120	浙江东方	17,176	117,999.12	0.06
331	000830	鲁西化工	15,800	117,868.00	0.06
332	000930	中粮科技	17,200	117,476.00	0.06
333	600633	浙数文化	12,000	117,360.00	0.06
334	600056	中国医药	8,253	116,779.95	0.06
335	000825	太钢不锈	35,100	116,532.00	0.06
336	600376	首开股份	19,800	116,028.00	0.06
337	600649	城投控股	19,400	115,236.00	0.06
338	600675	中华企业	28,100	114,367.00	0.06
339	000415	渤海租赁	38,000	113,240.00	0.06
340	000563	陕国投 A	30,400	112,784.00	0.06
341	601866	中远海发	61,000	112,240.00	0.05
342	601718	际华集团	33,800	112,216.00	0.05
343	300180	华峰超纤	13,100	112,136.00	0.05
344	002407	多氟多	10,500	111,720.00	0.05
345	600776	东方通信	7,400	111,666.00	0.05
346	000501	鄂武商 A	7,100	111,328.00	0.05
347	002640	跨境通	16,800	109,032.00	0.05
348	002010	传化智联	20,000	108,800.00	0.05
349	600022	山东钢铁	84,200	108,618.00	0.05
350	000012	南玻 A	21,490	107,879.80	0.05
351	603077	和邦生物	81,500	107,580.00	0.05
352	600500	中化国际	21,230	107,423.80	0.05
353	000078	海王生物	25,500	106,845.00	0.05
354	600062	华润双鹤	8,000	105,760.00	0.05
355	000883	湖北能源	30,000	105,600.00	0.05
356	600266	城建发展	20,784	105,374.88	0.05
357	002375	亚厦股份	10,300	105,266.00	0.05
358	000959	首钢股份	24,400	104,920.00	0.05
359	000685	中山公用	13,600	104,720.00	0.05

360	600316	洪都航空	6,600	104,280.00	0.05
361	000559	万向钱潮	21,200	102,608.00	0.05
362	002936	郑州银行	29,810	102,546.40	0.05
363	000027	深圳能源	21,980	101,987.20	0.05
364	601000	唐山港	45,600	101,688.00	0.05
365	002155	湖南黄金	12,900	101,652.00	0.05
366	000519	中兵红箭	10,700	100,794.00	0.05
367	000528	柳 工	15,840	99,950.40	0.05
368	000987	越秀金控	8,500	99,110.00	0.05
369	600640	号百控股	4,900	97,755.00	0.05
370	600908	无锡银行	19,900	97,709.00	0.05
371	002440	闰土股份	10,600	96,884.00	0.05
372	002625	光启技术	13,300	96,425.00	0.05
373	002266	浙富控股	24,800	95,976.00	0.05
374	600073	上海梅林	10,100	95,849.00	0.05
375	000156	华数传媒	8,800	95,304.00	0.05
375	600777	新潮能源	62,700	95,304.00	0.05
377	601717	郑煤机	16,059	94,587.51	0.05
378	300459	金科文化	27,206	93,860.70	0.05
379	002390	信邦制药	20,500	93,480.00	0.05
380	300072	三聚环保	21,700	92,876.00	0.05
381	600312	平高电气	12,516	92,868.72	0.05
382	600291	西水股份	10,100	91,405.00	0.04
383	000046	泛海控股	24,000	90,480.00	0.04
384	002424	贵州百灵	10,900	90,470.00	0.04
385	000898	鞍钢股份	36,900	90,405.00	0.04
386	600557	康缘药业	6,377	88,767.84	0.04
387	000887	中鼎股份	11,300	88,705.00	0.04
388	000758	中色股份	21,200	88,616.00	0.04
389	002505	大康农业	39,200	88,200.00	0.04
390	000008	神州高铁	29,900	87,906.00	0.04
391	600765	中航重机	8,600	87,892.00	0.04
392	600863	内蒙华电	35,700	87,822.00	0.04
393	601228	广州港	28,600	86,944.00	0.04
394	002589	瑞康医药	16,200	86,832.00	0.04
395	600751	海航科技	27,700	86,701.00	0.04
396	002002	鸿达兴业	23,900	86,279.00	0.04
397	000712	锦龙股份	6,900	86,250.00	0.04
398	000813	德展健康	13,800	85,560.00	0.04
399	600158	中体产业	10,400	85,072.00	0.04
400	600970	中材国际	16,100	85,008.00	0.04

401	600259	广晟有色	2,800	84,000.00	0.04
402	600478	科力远	17,800	83,838.00	0.04
403	600639	浦东金桥	5,200	83,096.00	0.04
404	600545	卓郎智能	17,500	82,775.00	0.04
405	300134	大富科技	5,900	82,482.00	0.04
406	600717	天津港	18,524	81,876.08	0.04
407	000826	启迪环境	11,000	81,620.00	0.04
408	600648	外高桥	5,700	80,598.00	0.04
409	603198	迎驾贡酒	3,700	80,549.00	0.04
410	002503	搜于特	28,500	80,085.00	0.04
411	002249	大洋电机	21,800	78,698.00	0.04
412	600125	铁龙物流	14,085	78,594.30	0.04
413	601598	中国外运	24,200	78,166.00	0.04
414	600348	阳泉煤业	18,500	78,070.00	0.04
415	000732	泰禾集团	15,300	77,877.00	0.04
416	600823	世茂股份	17,300	77,331.00	0.04
417	000061	农产品	10,400	77,064.00	0.04
418	600329	中新药业	4,400	76,208.00	0.04
419	002665	首航高科	31,200	76,128.00	0.04
420	601611	中国核建	12,200	75,396.00	0.04
421	002302	西部建设	7,800	74,880.00	0.04
422	600582	天地科技	25,500	74,715.00	0.04
423	603377	东方时尚	4,500	74,520.00	0.04
424	300376	易事特	14,300	74,360.00	0.04
425	600307	酒钢宏兴	48,200	74,228.00	0.04
426	000990	诚志股份	5,800	73,602.00	0.04
427	600748	上实发展	14,200	72,562.00	0.04
428	000718	苏宁环球	23,400	72,306.00	0.04
429	600901	江苏租赁	13,800	71,898.00	0.04
430	000869	张裕 A	2,100	71,715.00	0.04
431	600664	哈药股份	23,100	71,148.00	0.03
432	000717	韶钢松山	18,700	71,060.00	0.03
433	600017	日照港	28,400	70,716.00	0.03
434	603888	新华网	3,150	70,434.00	0.03
435	601678	滨化股份	16,600	70,384.00	0.03
436	000062	深圳华强	4,820	70,082.80	0.03
437	002544	杰赛科技	5,300	69,695.00	0.03
438	000848	承德露露	9,928	69,496.00	0.03
439	300257	开山股份	5,300	69,271.00	0.03
440	600277	亿利洁能	21,100	68,786.00	0.03
441	600869	智慧能源	17,100	68,400.00	0.03

442	002416	爱施德	9,500	68,210.00	0.03
443	002093	国脉科技	7,700	68,145.00	0.03
444	002408	齐翔腾达	10,900	67,689.00	0.03
445	002653	海思科	2,500	66,525.00	0.03
446	002948	青岛银行	12,700	64,643.00	0.03
447	300197	铁汉生态	25,300	64,262.00	0.03
448	603328	依顿电子	6,100	63,623.00	0.03
449	603650	彤程新材	2,700	62,829.00	0.03
450	000537	广宇发展	8,600	62,780.00	0.03
451	600565	迪马股份	22,400	62,496.00	0.03
452	603766	隆鑫通用	15,800	61,146.00	0.03
453	601019	山东出版	9,600	60,000.00	0.03
454	600053	九鼎投资	2,000	59,680.00	0.03
455	002491	通鼎互联	11,600	59,392.00	0.03
456	600787	中储股份	13,500	59,265.00	0.03
457	600350	山东高速	9,600	58,944.00	0.03
458	601869	长飞光纤	1,900	58,539.00	0.03
459	600770	综艺股份	12,000	57,600.00	0.03
460	002470	金正大	25,300	57,431.00	0.03
461	600338	西藏珠峰	5,620	56,200.00	0.03
462	002051	中工国际	7,600	55,328.00	0.03
463	600694	大商股份	2,300	55,177.00	0.03
464	600657	信达地产	13,200	54,384.00	0.03
465	601016	节能风电	25,600	54,272.00	0.03
466	002285	世联行	18,800	52,452.00	0.03
467	002118	紫鑫药业	11,800	52,392.00	0.03
468	601801	皖新传媒	9,200	51,152.00	0.03
469	600428	中远海特	16,500	50,820.00	0.02
470	600707	彩虹股份	11,000	50,160.00	0.02
471	600575	淮河能源	23,900	49,951.00	0.02
472	600006	东风汽车	12,300	49,569.00	0.02
473	000937	冀中能源	16,300	49,226.00	0.02
474	600757	长江传媒	9,309	47,382.81	0.02
475	600996	贵广网络	6,500	46,345.00	0.02
476	600874	创业环保	6,700	44,488.00	0.02
477	600623	华谊集团	8,600	44,376.00	0.02
478	603556	海兴电力	3,000	43,320.00	0.02
479	002941	新疆交建	3,000	42,450.00	0.02
480	600058	五矿发展	6,600	39,864.00	0.02
481	000785	居然之家	4,600	36,432.00	0.02
482	002946	新乳业	2,000	34,700.00	0.02

483	600903	贵州燃气	3,500	34,440.00	0.02
484	000025	特力A	1,830	33,543.90	0.02
485	601127	小康股份	3,900	32,409.00	0.02
486	600335	国机汽车	6,700	30,954.00	0.02
487	601969	海南矿业	6,000	29,280.00	0.01
488	002818	富森美	2,360	29,028.00	0.01
489	603379	三美股份	1,340	28,769.80	0.01
490	601512	中新集团	2,500	28,750.00	0.01
491	601811	新华文轩	2,400	24,408.00	0.01
492	002423	中粮资本	2,800	24,360.00	0.01
493	001872	招商港口	1,600	23,280.00	0.01
494	603025	大豪科技	2,900	21,083.00	0.01
495	600917	重庆燃气	2,900	20,706.00	0.01
496	601068	中铝国际	4,700	18,377.00	0.01
497	603256	宏和科技	1,500	17,160.00	0.01
498	002957	科瑞技术	600	14,340.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688278	特宝生物	8,405	569,270.65	0.28
2	688026	洁特生物	4,101	341,695.32	0.17
3	688200	华峰测控	1,092	294,861.84	0.14
4	688233	神工股份	5,455	268,713.30	0.13
5	688080	映翰通	2,233	193,779.74	0.09
6	688106	金宏气体	3,874	160,228.64	0.08
7	688599	天合光能	6,706	93,280.46	0.05
8	603087	甘李药业	645	64,693.50	0.03
9	688277	天智航	5,175	62,307.00	0.03
10	688528	秦川物联	4,585	51,948.05	0.03
11	688377	迪威尔	2,972	48,800.24	0.02
12	688027	国盾量子	1,273	46,057.14	0.02
13	688600	皖仪科技	2,916	45,198.00	0.02
14	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
15	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
16	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
17	300839	N博汇	502	11,751.82	0.01
18	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
19	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
20	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
21	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
22	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

23	600759	洲际油气	1,200	2,232.00	0.00
24	601326	秦港股份	300	753.00	0.00
25	601872	招商轮船	100	583.00	0.00

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	002081	金螳螂	1,649,259.00	0.68
2	601128	常熟银行	1,274,382.00	0.52
3	300558	贝达药业	1,170,799.00	0.48
4	002185	华天科技	1,170,303.00	0.48
5	300357	我武生物	1,163,990.88	0.48
6	001914	招商积余	1,147,390.98	0.47
7	002419	天虹股份	1,105,464.00	0.46
8	300482	万孚生物	1,101,976.00	0.45
9	600729	重庆百货	1,099,087.00	0.45
10	300595	欧普康视	1,065,868.30	0.44
11	000739	普洛药业	1,035,489.96	0.43
12	300630	普利制药	972,356.99	0.40
13	300496	中科创达	924,254.00	0.38
14	300271	华宇软件	920,784.00	0.38
15	300012	华测检测	902,424.00	0.37
16	002244	滨江集团	894,343.00	0.37
17	300618	寒锐钴业	889,920.17	0.37
18	600153	建发股份	883,309.00	0.36
19	002396	星网锐捷	876,136.00	0.36
20	000031	大悦城	876,007.00	0.36

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	600745	闻泰科技	2,378,174.00	0.98
2	002129	中环股份	2,199,283.00	0.91
3	300014	亿纬锂能	2,047,846.88	0.84
4	002371	北方华创	1,926,930.16	0.79
5	002463	沪电股份	1,637,086.00	0.67
6	600584	长电科技	1,619,489.00	0.67
7	002384	东山精密	1,617,435.00	0.67
8	300383	光环新网	1,560,684.51	0.64
9	600763	通策医疗	1,522,974.00	0.63
10	002049	紫光国微	1,489,954.75	0.61

11	300529	健帆生物	1,392,980.11	0.57
12	002812	恩捷股份	1,388,799.40	0.57
13	600536	中国软件	1,331,253.00	0.55
14	000066	中国长城	1,282,035.00	0.53
15	002065	东华软件	1,260,914.00	0.52
16	601100	恒立液压	1,219,251.00	0.50
17	600739	辽宁成大	1,175,654.00	0.48
18	002180	纳思达	1,011,474.57	0.42
19	000009	中国宝安	989,780.07	0.41
20	601099	太平洋	962,244.00	0.40

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	126,252,429.46
卖出股票收入（成交）总额	188,631,465.34

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（可交换债）	164,518.95	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	164,518.95	0.08

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	128108	蓝帆转债	535	84,192.95	0.04
2	113583	益丰转债	270	35,904.60	0.02
3	128115	巨星转债	358	35,800.00	0.02
4	113035	福莱转债	60	8,621.40	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告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	公允价值变动	风险说明
IC2012	IC2012	2	2,198,640.00	116,160.00	-
公允价值变动总额合计					116,160.00
股指期货投资本期收益					386,601.94
股指期货投资本期公允价值变动					-11,543.30

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

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

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

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	334,603.95
2	应收证券清算款	145,640.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,663.67
5	应收申购款	2,385,439.99

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,868,348.46

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中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	688278	特宝生物	569,270.65	0.28	锁定期股票
2	688026	洁特生物	341,695.32	0.17	锁定期股票
3	688200	华峰测控	294,861.84	0.14	锁定期股票
4	688233	神工股份	268,713.30	0.13	锁定期股票
5	688080	映翰通	193,779.74	0.09	锁定期股票

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	494	32,908.28	13,211,276.00	81.27%	3,045,412.00	18.73%
信诚中证500指数分级B	3,898	6,255.78	842,330.00	3.45%	23,542,703.00	96.55%
信诚中证500指数分级	39,585	2,992.33	2,361,674.01	1.99%	116,089,751.53	98.01%
合计	43,977	3,617.64	16,415,280.01	10.32%	142,677,866.53	89.68%

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	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	2,959,400.00	18.20%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募）	2,438,080.00	15.00%
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	13.67%
4	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅七号证券投资私募基金	1,799,239.00	11.07%
5	中国银河证券股份有限公司	1,118,297.00	6.88%
6	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅六号证券投资私募基金	882,600.00	5.43%
7	范黎渊	767,240.00	4.72%
8	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	4.10%
9	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	3.77%
10	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	3.08%

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	纪芃芃	660,000.00	2.71%
2	张钢	510,000.00	2.09%
3	陈胜华	500,000.00	2.05%
4	梁森泉	467,983.00	1.92%
5	王晓刚	443,324.00	1.82%
6	云南云达工程造价咨询有限公司	432,871.00	1.78%
7	广州市广百股份有限公司	384,000.00	1.57%
8	杨胜华	345,247.00	1.42%
9	张凤英	339,416.00	1.39%
10	加建民	338,302.00	1.39%

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	2,722,702.35	2.30%
2	李汝波	1,476,080.43	1.25%
3	幸福人寿保险股份有限公司-分红	1,331,196.00	1.12%
4	赵从志	844,750.00	0.71%
5	池航钊	602,096.97	0.51%
6	杨海峰	571,579.52	0.48%
7	李紫龙	544,872.51	0.46%
8	温东明	537,246.84	0.45%
9	马琳	536,770.95	0.45%
10	勒斌	498,456.62	0.42%

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	280,944.32	0.24%
	合计	280,944.32	0.18%

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。

8.4 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	0~10
	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	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

注：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
本报告期期初基金份额总额	20,827,212.00	31,240,819.00	162,143,336.86
本报告期基金总申购份额	—	—	90,006,504.56
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	149,187,530.01
本报告期基金拆分变动份额	-4,570,524.00	-6,855,786.00	15,489,114.13
报告期期末基金份额总额	16,256,688.00	24,385,033.00	118,451,425.54

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金份额折算变动份额。根据《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》及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算业务的公告》，基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2020 年 2 月 3 日（折算基准日）对本基金信诚中证 500 指数分级基金进行基金份额折算。

§ 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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（特殊普通合伙）。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

报告期内基金管理人、基金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	
安信证券	3	4,349,028.17	1.40%	4,050.27	1.72%	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	2	13,795,946.00	4.45%	9,813.18	4.16%	—

长江证券	2	5,844,748.28	1.89%	5,443.31	2.31%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	113,088,975.48	36.50%	80,441.42	34.08%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	18,487,649.41	5.97%	17,217.75	7.30%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	277,612.50	0.09%	-	-	-
华西证券	2	78,319,029.94	25.28%	55,708.43	23.60%	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	20,167,440.29	6.51%	18,378.62	7.79%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	25,939,685.98	8.37%	23,638.91	10.02%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

西藏东财	1	29,144,935.90	9.41%	21,313.66	9.03%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	396,256.00	0.13%	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	23,171.50	1.41%	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	115,576.00	7.05%	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	506,600.90	30.90%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	253,914.20	15.49%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	193,300.00	11.79%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	20,974.23	1.28%	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	23,860.80	1.46%	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	501,860.46	30.62%	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年01月01日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年01月17日
3	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第四季度报告	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年01月17日
4	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	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年01月21日
5	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年01月30日
6	中信保诚基金管理有限公司关于顺延办理信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算业务的提示性公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年01月31日
7	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	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月04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之中证 500 A 份额年约定收益率设定的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月04日

		v. cn/fund/)	
9	中信保诚基金管理有限公司关于中证 500 A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月05日
10	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	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月05日
11	信诚中证 500 指数分级证券投资基金托管协议	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
12	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
13	信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
14	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
15	《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》修订前后对照表	指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
16	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月07日
17	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月19日
18	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道基金赎回费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年02月19日
19	信诚中证 500 指数分级证券投资基金暂停场外大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月05日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	《中国证券报》及指定网站 (www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月06日

21	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加济安财富基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月12日
22	中信保诚基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月21日
23	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书	指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月24日
24	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年03月24日
25	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年04月13日
26	中信保诚基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年04月14日
27	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年04月21日
28	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年04月22日
29	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年第一季度报告	指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年04月22日
30	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年04月25日
31	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年04月25日
32	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年05月18日
33	中信保诚基金管理有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告	《中国证券报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/)	2020年06月15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 备查文件目录

- 1、信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 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 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 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。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 08 月 28 日