

信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：信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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 28 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11

6.2	利润表.....	12
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4	报表附注.....	14
§ 7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	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股票投资明细.....	32
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12	投资组合报告附注.....	43
§ 8	基金份额持有人信息.....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	46
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§ 9	开放式基金份额变动.....	46
§ 10	重大事件揭示.....	47
10.1	基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4	基金投资策略的改变.....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§ 12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件名称.....	51
12.2	备查文件存放地点.....	51
12.3	备查文件查阅方式.....	51

§ 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 2 月 11 日		
基金管理人	信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	203,960,615.70 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	27,632,384.00 份	41,448,577.00 份	134,879,654.70 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 500 指数 分级 A:低风险、收 益相对稳定的特 征。	信诚中证 500 指 数分级 B:高风险、 高预期收益的特 征。	信诚中证 500 指数分级: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		信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@xcfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张翔燕	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

§ 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(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,035,942.52
本期利润	1,860,164.63
加权平均基金份额本期利润	0.0091
本期加权平均净值利润率	0.74%
本期基金份额净值增长率	1.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	79,928,320.06

期末可供分配基金份额利润	0.3919
期末基金资产净值	251,231,257.12
期末基金份额净值	1.232
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	50.26%

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。

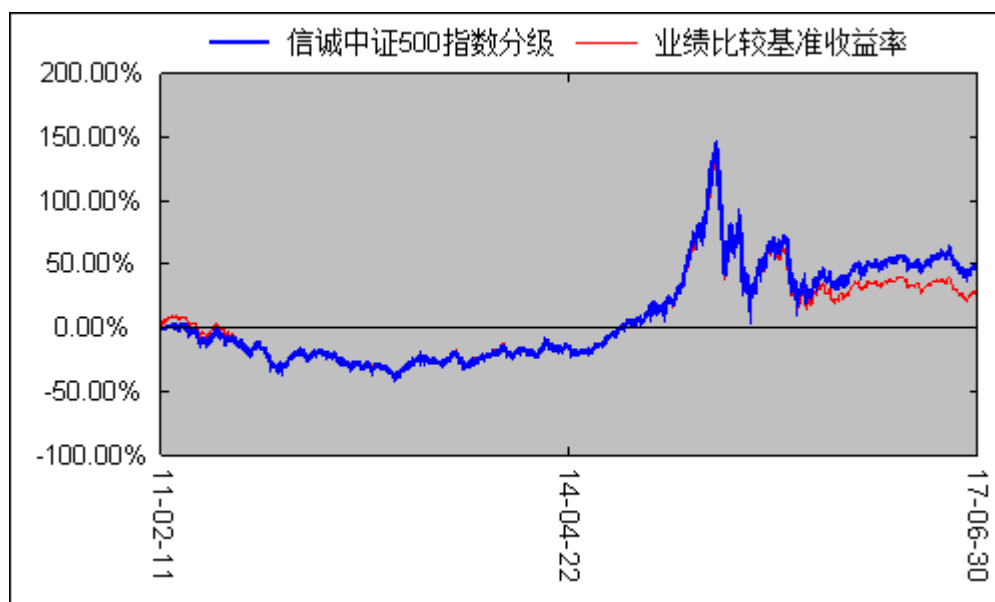
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	5.57%	0.90%	5.12%	0.89%	0.45%	0.01%
过去三个月	-3.60%	0.97%	-3.89%	0.97%	0.29%	0.00%
过去六个月	1.05%	0.85%	-1.86%	0.85%	2.91%	0.00%
过去一年	6.01%	0.86%	0.31%	0.86%	5.70%	0.00%
过去三年	79.38%	2.02%	54.27%	1.96%	25.11%	0.06%
自基金合同生效起至今	50.26%	1.69%	29.81%	1.68%	20.45%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效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



注：本基金建仓期自 2011 年 2 月 11 日至 2011 年 8 月 11 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 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

本基金管理人信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%。截至 2017 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 70 只基金,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、信诚经典优债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、信诚添金分级债券型证券投资基金、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、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、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、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、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)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚至益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、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、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫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、信诚主题轮动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、信诚永鑫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、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、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、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信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	2015 年 1 月	-	4	理学硕士、文学硕士。曾任职于美

	信诚沪深 300 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金 (LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活配置混合基金、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、信诚永益一年定期开放混合基金、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、信诚至信灵活配置混合基金的基金经理。	15 日			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 月加入信诚基金, 历任助理投资经理、专户投资经理。现任数量投资副总监, 信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 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金 (LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活配置混合基金、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、信诚永益一年定期开放混合基金、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、信诚至信灵活配置混合基金的基金经理。
黄稚	本基金的基金经理助理, 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 7 月 1 日	-	5	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 月加入信诚基金, 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. 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、二级市场同一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的行为监控，分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年上半年，A 股市场在经历年初回调后逐步企稳，一季度持续震荡上涨，其中消费相关行业（如家用电器、食品饮料）以及基建投资相关行业（钢铁、建材、建筑等）表现较好。在二季度，A 股市场经历了一个探底回升的过程。各板块走势分化明显，绝对估值较低的家用电器、食品饮料、汽车、医药生物等消费板块在 4、5 月份继续强势上涨，而中小成长股板块表现不佳。首先，从经济基本面看，全球经济延续复苏态势，出口保持平稳增长。国内消费整体保持稳定。投资方面，基础设施建设明显放缓。通货膨胀整体压力不大，工业品价格震荡向下带动 PPI 环比转负，CPI 温和回升保持平稳。第二，从监管力度来看，4 月份市场关注的焦点集中在金融监管。银监会连发多文，全方位多角度加强银行监管，监管力度超出市场预期；同时证监会对高送转股票、次新股、雄安主题股的监管力度较强。4 月份 A 股市场震荡和中小盘股票承压。随后监管阶段性有所放松，新股发行放缓，减持新规的出台、A 股加入 MSCI 等都对市场风险偏好有提振作用。第三，外围压力有所降低。特朗普政策持续低于市场预期，美元指数走低，外汇储备有所上升。随着人民币贬值压力基本释放，外部流动性将会出现明显改善。

在本报告期内，我们继续利用量化分层抽样技术跟踪指数，在震荡市场环境中及时处理每日申购赎回现金流，有效管理跟踪误差，也利用股指期货多头套保应对申赎的现金管理。同时，积极参与网下新股申购，以提高基金净值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 1.05%，同期业绩比较基准收益率为-1.86%，基金超越业绩比较基准 2.91%。

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 2017 年下半年，房地产和基建投资虽然有所回落，但目前仍处于高位，制造业投资弱企稳，外部经济的复苏有助于拉动出口，预计经济运行整体平稳，微观经济结构将继续优化。货币政策仍将保持高度灵活性，流动性短期内难以宽松。

我们对 A 股市场基本判断为将呈现整体震荡结构型行情，市场关注方向可能从绝对估值较低的蓝筹板块转向高业绩成长板块，具有真实确定性成长性的股票未来可能受到市场青睐，部分市场热点也存在交易性机会。

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最严格的控制。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。

基金管理人根据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有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

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。

本基金于本期间未进行过利润分配,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。

根据本基金合同的约定,本基金不进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	15,386,761.20	6,080,728.38
结算备付金		4,499,284.33	4,708,482.77
存出保证金		1,602,659.72	1,616,675.85
交易性金融资产	6.4.7.2	231,051,049.34	252,601,874.53
其中：股票投资		231,051,049.34	242,632,874.53
基金投资		-	-
债券投资		-	9,969,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		249,319.94	-
应收利息	6.4.7.5	5,545.08	92,690.88
应收股利		-	-
应收申购款		47,517.79	42,883.57
递延所得税资产			
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		252,842,137.40	265,143,335.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		506,561.35	204,865.21
应付管理人报酬		204,889.03	231,132.84
应付托管费		45,075.58	50,849.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	154,673.51	105,431.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	699,680.81	691,137.10
负债合计		1,610,880.28	1,283,415.74
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	167,130,302.41	177,311,280.77
未分配利润	6.4.7.10	84,100,954.71	86,548,639.47
所有者权益合计		251,231,257.12	263,859,920.24
负债和所有者权益总计		252,842,137.40	265,143,335.98

注：截止本报告期末，基金份额总额 203,960,615.70 份。信诚中证 500 指数分级的基金份额净值 1.232 元，基金份额总额 134,879,654.70 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 27,632,384.00 份；信诚中证 500 指数分级 B 的基金份额净值 1.374 元，基金份额总额 41,448,577.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		4,134,258.92	-95,552,657.96
1. 利息收入		94,112.63	126,446.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,246.88	126,311.93
债券利息收入		22,865.75	134.21
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）		4,133,510.28	-55,852,842.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,470,975.63	-55,466,964.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-26,870.00	124,881.24
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	117,706.67	-2,322,445.88
股利收益	6.4.7.16	1,571,697.98	1,811,686.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-175,777.89	-40,309,393.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	82,413.90	483,132.39

号填列)			
减：二、费用		2,274,094.29	3,431,340.73
1. 管理人报酬		1,253,173.52	1,878,733.20
2. 托管费		275,698.16	413,321.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	385,341.24	808,047.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	359,881.37	331,239.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,860,164.63	-98,983,998.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,860,164.63	-98,983,998.69

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 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
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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	370,846,925.87	250,137,197.42	620,984,123.29

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-98,983,998.69	-98,983,998.69
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)	-165,057,607.42	-65,113,040.78	-230,170,648.20
其中:1.基金申购款	116,678,375.74	40,835,149.66	157,513,525.40
2.基金赎回款	-281,735,983.16	-105,948,190.44	-387,684,173.60
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)	205,789,318.45	86,040,157.95	291,829,476.40

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:

<u>吕涛</u>	<u>陈逸辛</u>	<u>刘卓</u>
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[2010]1877 号文)和《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2011]69 号文)批准,由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。本基金的基金管理人为信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。

本基金于 2011 年 1 月 6 日至 2011 年 1 月 28 日募集,首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币 374,118,554.71 元,利息人民币 135,745.39 元,共计人民币 374,254,300.10 元。上述认购资金折合 374,254,300.10 份基金份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了 KPMG-B(2011)CR No.0003 号验资报告。

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

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合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要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

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。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 1 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017] 56 号)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) 以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (b) 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。
- (c) 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。

证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

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(含公开募集证券投资基金)过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务), 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。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为(以下称其他业务), 继续按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额, 未分别核算的, 资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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。因此, 截至 2017 年 6 月 30 日, 本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 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。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业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。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得, 暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益, 由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时, 对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税; 或发行债券的企业向该内

地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

(h) 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，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	15,386,761.20
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计	15,386,761.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		245,854,909.34	231,051,049.34	-14,803,860.00
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		245,854,909.34	231,051,049.34	-14,803,860.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 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	7,024,680.00	-	-	-
IC1709	3,630,280.00	-	-	-
IC1712	3,394,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,024,680.00	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,856.19
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	56.07
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,803.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	829.82
合计	5,545.08

注：其他指应收期货清算备付金利息、应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	154,673.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	154,673.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,687.96
预提审计费	69,424.36
预提信息披露费	548,765.71
基金上市费	29,752.78
应付指数使用费	50,050.00
合计	699,680.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	213,115,599.87	177,311,280.77
本期申购	2,108,298.34	1,754,117.62
本期赎回（以“-”号填列）	-11,053,166.44	-9,194,723.14
2017 年 2 月 3 日基金拆分/份额折算前	204,170,731.77	169,870,675.25
基金拆分/份额折算调整	3,138,519.53	-
本期申购	43,121,722.79	35,335,770.80
本期赎回（以“-”号填列）	-46,470,358.39	-38,076,143.64
本期末	203,960,615.70	167,130,302.41

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2017 年 2 月 3 日份额折算基准日，对本基金实施定期份额折算。

3、根据本基金合同规定，投资者可申购、赎回信诚中证 500 指数分级份额，信诚中证 500 指数分级 A 份额和信诚中证 500 指数分级 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露信诚中证 500 指数分级 A 份额和信诚中证 500 指数分级 B 份额的情况。

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	82,212,823.74	4,335,815.73	86,548,639.47
本期利润	2,035,942.52	-175,777.89	1,860,164.63
本期基金份额交易产生的变动数	-4,320,446.20	12,596.81	-4,307,849.39
其中：基金申购款	18,393,483.86	1,874,474.11	20,267,957.97
基金赎回款	-22,713,930.06	-1,861,877.30	-24,575,807.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,928,320.06	4,172,634.65	84,100,954.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,730.03
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	1,362.62
其他	21,154.23
合计	71,246.88

注：其他包括期货清算备付金利息收入、申购款利息收入和结算保证金利息收入。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	133,205,744.94
减：卖出股票成本总额	130,734,769.31
买卖股票差价收入	2,470,975.63

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 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	-26,870.00
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	-26,870.00

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,081,290.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,997,350.00
减：应收利息总额	110,810.96
买卖债券差价收入	-26,870.00

6.4.7.13.3 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

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末进行权证投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	117,706.67

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,571,697.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,571,697.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-326,751.22
——股票投资	-355,101.22
——债券投资	28,350.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	150,973.33
——权证投资	-
股指期货	150,973.33
3. 其他	-
合计	-175,777.89

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	82,191.61
转换费收入	222.29
合计	82,413.90

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	384,240.05
银行间市场交易费用	175.00
股指期货交易费用	926.19
合计	385,341.24

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	69,424.36
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,050.00
银行费用	2,688.52
债券帐户维护费	9,000.00
基金上市费	29,752.78
上清所 CFCA 数字证书服务费	200.00
合计	359,881.37

6.4.7.21 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

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,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

6.4.10.1.2 权证交易

6.4.10.1.3 债券交易

6.4.10.1.4 债券回购交易

6.4.10.1.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,253,173.52	1,878,733.20
其中:支付销售机构的客户维护费	348,257.89	300,045.37

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	275,698.16	413,321.25

注:支付基金托管人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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期内及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

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。本基金的基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未投资过本基金。

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

1、本基金其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

2、本基金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。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	15,386,761.20	48,730.03	6,452,565.94	49,573.00

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 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 138,523.09 元。(2016 年 6 月 30 日余额为 0 元)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间，均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

6.4.11 利润分配情况

本基金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。

6.4.12 期末（2017 年 6 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
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下新股申购未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603331	百达精	2017-06-27	2017-07-05	网下新	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

	工			股申购 未上市						
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下新 股申购 未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智 能	2017-06-26	2017-07-03	网下新 股申购 未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603305	旭升股 份	2017-06-30	2017-07-10	网下新 股申购 未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603933	睿能科 技	2017-06-28	2017-07-06	网下新 股申购 未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新 股申购 未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科 技	2017-06-05	2017-07-07	网下新 股申购 未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资 产重组	16.99	-	-	105,725	1,152,586.30	1,796,267.75	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大资 产重组	7.79	-	-	189,859	1,665,988.28	1,479,001.61	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资 产重组	14.98	2017-08-02	16.48	98,154	1,724,920.43	1,470,346.92	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资 产重组	8.70	2017-08-14	9.57	147,963	1,965,765.38	1,287,278.10	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大资 产重组	6.07	2017-08-16	6.68	164,700	1,059,707.00	999,729.00	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大资 产重组	10.30	2017-07-24	11.15	96,244	818,759.93	991,313.20	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大资	17.02	2017-07-12	16.68	54,600	1,049,661.88	929,292.00	-

			产重组							
600673	东阳光科	2016-11-15	重 大 资 产 重 组	6.53	-	-	100,534	665,068.07	656,487.02	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	筹 划 发 行 股 份 购 买 资 产	10.94	2017-08-18	12.03	48,751	862,182.12	533,335.94	-
600468	百利电气	2017-05-16	重 大 资 产 重 组	6.50	-	-	79,200	609,558.00	514,800.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	筹 划 重 大 事 项	10.33	2017-08-02	11.36	31,465	315,273.60	325,033.45	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重 大 资 产 重 组	11.32	-	-	12,172	215,186.85	137,787.04	-
002681	奋达科技	2017-06-22	中 国 证 监 会 上 市 公 司 并 购 重 组 审 核 委 员 审 核 公 司 重 大 资 产 重 组 事 项	12.59	2017-07-03	18.01	7,100	89,596.58	89,389.00	-
000656	金科股份	2017-05-05	重 大 资 产 重 组	6.54	2017-07-05	5.92	8,100	28,650.44	52,974.00	-

注：截至本报告批准报出日，“深圳惠程”、“郑煤机”、“东阳光科”、“百利电气”和“豫园商城”仍未发布复牌公告。

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

于本报告期末，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系建设，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；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，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与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责，其中监察稽核部还须向督察长

报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

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,以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,均能及时变现。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资产的公允价值。此外,对于基金投资的股指期货等场内金融衍生品,管理人会对衍生品的流动性、交割日等予以关注。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;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。

本基金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 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所市场及银行间市场交易的固定收益证券,因此存在一定的利率风险。本

基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	15,386,761.20	-	-	-	-	-	15,386,761.20
结算备付金	4,499,284.33	-	-	-	-	-	4,499,284.33
存出保证金	1,602,659.72	-	-	-	-	-	1,602,659.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	231,051,049.34	231,051,049.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	249,319.94	249,319.94
应收利息	-	-	-	-	-	5,545.08	5,545.08
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	47,517.79	47,517.79
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,488,705.25	-	-	-	-	231,353,432.15	252,842,137.40
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	506,561.35	506,561.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	204,889.03	204,889.03
应付托管费	-	-	-	-	-	45,075.58	45,075.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	154,673.51	154,673.51
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	699,680.81	699,680.81
负债总计	-	-	-	-	-	1,610,880.28	1,610,880.28
利率敏感度缺口	21,488,705.25	-	-	-	-	229,742,551.87	251,231,257.12
上年度末 2016 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	6,080,728.38	-	-	-	-	-	6,080,728.38
结算备付金	4,708,482.77	-	-	-	-	-	4,708,482.77
存出保证金	1,616,675.85	-	-	-	-	-	1,616,675.85
交易性金融资产	-	-	9,969,000.00	-	-	242,632,874.53	252,601,874.53

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	92,690.88	92,690.88
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	42,883.57	42,883.57
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,405,887.00	-	9,969,000.00	-	-	242,768,448.98	265,143,335.98
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	204,865.21	204,865.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	231,132.84	231,132.84
应付托管费	-	-	-	-	-	50,849.20	50,849.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	105,431.39	105,431.39
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	691,137.10	691,137.10
负债总计	-	-	-	-	-	1,283,415.74	1,283,415.74
利率敏感度缺口	12,405,887.00	-	9,969,000.00	-	-	241,485,033.24	263,859,920.24

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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

假设	除市场利率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(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	-	14,541.00
	市场利率上升 25 个基点	-	-14,498.70

注：本基金于本期末未持有受利率波动明显的金融资产，因此可认为市场利率的变动对本基金本期资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，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市场价格风险，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。特别是针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等

法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

于本报告期末,本基金面临的其他市场价格风险列示如下:

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	231,051,049.34	91.97	242,632,874.53	91.96
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	231,051,049.34	91.97	242,632,874.53	91.96

注: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。

6.4.13.4.2.2 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(2017 年 6 月 30 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	11,805,349.38	12,422,806.50
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-11,805,349.38	-12,422,806.50

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
	2. -		
假设	-		
分析	风险价值 (单位:人民币元)	本期末(2017 年 6 月 30 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	-	-	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§ 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	231,051,049.34	91.38
	其中：股票	231,051,049.34	91.38
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	19,886,045.53	7.87
7	其他各项资产	1,905,042.53	0.75
8	合计	252,842,137.40	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,587,995.11	0.63
B	采矿业	8,870,406.93	3.53
C	制造业	146,768,594.02	58.42
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	7,041,616.35	2.80
E	建筑业	5,822,872.76	2.32
F	批发和零售业	10,995,900.07	4.38
G	交通运输、仓储和邮政业	7,005,653.03	2.79
H	住宿和餐饮业	474,250.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	12,267,211.20	4.88
J	金融业	2,988,423.92	1.19
K	房地产业	12,644,891.34	5.03
L	租赁和商务服务业	2,680,650.05	1.07
M	科学研究和技术服务业	1,890,976.00	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	2,627,707.58	1.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	63,903.00	0.03
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	4,172,834.23	1.66
S	综合	457,680.00	0.18
	合计	228,361,565.59	90.90

7.2.2 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,681,844.13	1.07
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	7,639.62	—
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	2,689,483.75	1.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
—	—	—
合计	—	—

本基金本报告期内未进行沪港通投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000997	新 大 陆	107,506	2,439,311.14	0.97
2	600487	亨通光电	86,090	2,414,824.50	0.96
3	600388	龙净环保	151,400	2,351,242.00	0.94
4	600298	安琪酵母	87,465	2,262,719.55	0.90
5	600516	方大炭素	142,400	2,024,928.00	0.81
6	600122	宏图高科	170,855	1,896,490.50	0.75
7	600183	生益科技	152,012	1,875,828.08	0.75
8	000066	中国长城	206,268	1,858,474.68	0.74
9	002405	四维图新	88,466	1,748,088.16	0.70
10	002400	省广股份	217,625	1,747,528.75	0.70
11	600312	平高电气	125,561	1,725,208.14	0.69
12	002092	中泰化学	135,600	1,722,120.00	0.69
13	600260	凯乐科技	67,215	1,703,228.10	0.68
14	300115	长盈精密	58,263	1,700,114.34	0.68
15	600521	华海药业	79,021	1,662,601.84	0.66
16	002004	华邦健康	211,607	1,656,882.81	0.66
17	000012	南 玻 A	174,281	1,626,041.73	0.65
18	000488	晨鸣纸业	125,944	1,624,677.60	0.65
19	002050	三花智控	98,354	1,605,137.28	0.64
20	600161	天坛生物	41,080	1,594,314.80	0.63
21	002672	东江环保	93,375	1,577,103.75	0.63
22	000970	中科三环	103,300	1,526,774.00	0.61
23	601886	江河集团	146,700	1,503,675.00	0.60
24	601717	郑煤机	189,859	1,479,001.61	0.59
25	600643	爱建集团	98,154	1,470,346.92	0.59
26	600503	华丽家族	210,200	1,452,482.00	0.58
27	600635	大众公用	264,223	1,440,015.35	0.57
28	000960	锡业股份	105,100	1,430,411.00	0.57
29	600418	江淮汽车	134,606	1,420,093.30	0.57
30	002001	新 和 成	73,000	1,416,930.00	0.56
31	600325	华发股份	169,130	1,412,235.50	0.56
32	002308	威创股份	107,950	1,408,747.50	0.56
33	002221	东华能源	129,110	1,408,590.10	0.56
34	002366	台海核电	29,400	1,379,154.00	0.55
35	002078	太阳纸业	187,144	1,375,508.40	0.55
36	002002	鸿达兴业	175,311	1,372,685.13	0.55
37	600062	华润双鹤	49,734	1,364,203.62	0.54
38	000825	太钢不锈	305,700	1,329,795.00	0.53
39	600409	三友化工	131,900	1,328,233.00	0.53
40	002437	誉衡药业	181,680	1,322,630.40	0.53

41	002217	合力泰	133,698	1,320,936.24	0.53
42	600633	浙数文化	68,300	1,319,556.00	0.53
43	600026	中远海能	196,527	1,302,974.01	0.52
44	000703	恒逸石化	91,200	1,298,688.00	0.52
45	002354	天神娱乐	60,288	1,296,192.00	0.52
46	002128	露天煤业	147,963	1,287,278.10	0.51
47	300274	阳光电源	116,000	1,286,440.00	0.51
48	002048	宁波华翔	61,205	1,276,736.30	0.51
49	000685	中山公用	116,153	1,271,875.35	0.51
50	000988	华工科技	87,100	1,270,789.00	0.51
51	600499	科达洁能	158,900	1,261,666.00	0.50
52	600307	酒钢宏兴	442,000	1,259,700.00	0.50
53	002390	信邦制药	143,578	1,250,564.38	0.50
54	300026	红日药业	259,300	1,221,303.00	0.49
55	000089	深圳机场	130,000	1,215,500.00	0.48
56	600809	山西汾酒	34,800	1,207,212.00	0.48
57	000930	中粮生化	110,900	1,195,502.00	0.48
58	002190	成飞集成	44,600	1,195,280.00	0.48
59	000612	焦作万方	148,328	1,194,040.40	0.48
60	600808	马钢股份	335,300	1,186,962.00	0.47
61	600240	华业资本	130,080	1,178,524.80	0.47
62	000926	福星股份	95,600	1,166,320.00	0.46
63	600291	西水股份	53,000	1,166,000.00	0.46
64	002603	以岭药业	66,150	1,154,979.00	0.46
65	002266	浙富控股	236,500	1,154,120.00	0.46
66	600270	外运发展	60,800	1,150,944.00	0.46
67	601928	凤凰传媒	117,550	1,147,288.00	0.46
68	600611	大众交通	207,400	1,144,848.00	0.46
69	002440	闰土股份	73,500	1,121,610.00	0.45
70	600073	上海梅林	116,900	1,116,395.00	0.44
71	002261	拓维信息	95,300	1,115,963.00	0.44
72	002281	光迅科技	50,102	1,113,266.44	0.44
73	000426	兴业矿业	123,300	1,112,166.00	0.44
74	600125	铁龙物流	124,000	1,111,040.00	0.44
75	000090	天健集团	99,500	1,104,450.00	0.44
76	002589	瑞康医药	71,460	1,100,484.00	0.44
77	300199	翰宇药业	71,700	1,099,878.00	0.44
78	002463	沪电股份	240,462	1,094,102.10	0.44
79	600259	广晟有色	27,900	1,089,216.00	0.43
80	300273	和佳股份	88,423	1,075,223.68	0.43
81	600736	苏州高新	151,300	1,069,691.00	0.43

82	600639	浦东金桥	58,939	1,067,974.68	0.43
83	002701	奥瑞金	165,887	1,060,017.93	0.42
84	603188	亚邦股份	60,606	1,056,968.64	0.42
85	600338	西藏珠峰	27,800	1,056,122.00	0.42
86	002431	棕榈股份	95,650	1,054,063.00	0.42
87	002242	九阳股份	53,500	1,052,345.00	0.42
88	600300	维维股份	197,000	1,051,980.00	0.42
89	002479	富春环保	88,100	1,048,390.00	0.42
90	600596	新安股份	123,625	1,044,631.25	0.42
91	000998	隆平高科	47,068	1,036,437.36	0.41
92	002106	莱宝高科	101,900	1,032,247.00	0.41
93	600751	天海投资	181,400	1,032,166.00	0.41
94	600586	金晶科技	210,805	1,030,836.45	0.41
95	600572	康恩贝	148,900	1,030,388.00	0.41
96	600874	创业环保	52,545	1,028,305.65	0.41
97	002064	华峰氨纶	212,400	1,023,768.00	0.41
98	600517	置信电气	135,200	1,023,464.00	0.41
99	600395	盘江股份	139,000	1,018,870.00	0.41
100	000541	佛山照明	111,200	1,013,032.00	0.40
101	600645	中源协和	47,200	1,011,496.00	0.40
102	600460	士兰微	164,700	999,729.00	0.40
103	603355	莱克电气	17,000	999,090.00	0.40
104	002271	东方雨虹	26,783	993,649.30	0.40
105	002122	天马股份	96,244	991,313.20	0.39
106	601016	节能风电	268,800	989,184.00	0.39
107	002063	远光软件	94,400	983,648.00	0.39
108	600757	长江传媒	131,609	983,119.23	0.39
109	600053	九鼎投资	28,100	982,376.00	0.39
110	000616	海航投资	225,162	968,196.60	0.39
111	002371	北方华创	40,300	963,976.00	0.38
112	002005	德豪润达	200,100	954,477.00	0.38
113	600251	冠农股份	119,300	950,821.00	0.38
114	600216	浙江医药	95,000	941,450.00	0.37
115	600978	宜华生活	93,471	939,383.55	0.37
116	001696	宗申动力	123,800	937,166.00	0.37
117	600058	五矿发展	75,400	935,714.00	0.37
118	300202	聚龙股份	56,442	932,421.84	0.37
119	600059	古越龙山	100,551	930,096.75	0.37
120	002358	森源电气	54,600	929,292.00	0.37
121	600220	江苏阳光	270,104	926,456.72	0.37
122	000680	山推股份	169,700	924,865.00	0.37

123	002309	中利集团	73,451	918,872.01	0.37
124	002573	清新环境	48,819	918,773.58	0.37
125	002118	紫鑫药业	133,500	911,805.00	0.36
126	002414	高德红外	49,719	909,857.70	0.36
127	600410	华胜天成	101,600	900,176.00	0.36
128	000758	中色股份	127,462	893,508.62	0.36
129	000547	航天发展	85,300	891,385.00	0.35
130	600594	益佰制药	58,300	889,658.00	0.35
131	002489	浙江永强	139,300	888,734.00	0.35
132	600120	浙江东方	33,000	887,040.00	0.35
133	603568	伟明环保	41,000	886,420.00	0.35
134	600079	人福医药	45,000	882,900.00	0.35
135	000878	云南铜业	66,900	882,411.00	0.35
136	000517	荣安地产	189,700	882,105.00	0.35
137	603698	航天工程	34,900	879,480.00	0.35
138	002019	亿帆医药	52,600	877,368.00	0.35
139	600329	中新药业	48,362	875,835.82	0.35
140	600481	双良节能	164,400	872,964.00	0.35
141	600765	中航重机	63,200	870,896.00	0.35
142	600694	大商股份	22,332	870,278.04	0.35
143	600862	中航高科	89,722	869,406.18	0.35
144	603567	珍宝岛	50,700	853,281.00	0.34
145	603001	奥康国际	45,400	853,066.00	0.34
146	600466	蓝光发展	98,000	845,740.00	0.34
147	002233	塔牌集团	68,700	836,079.00	0.33
148	600292	远达环保	76,300	822,514.00	0.33
149	002018	华信国际	119,717	820,061.45	0.33
150	600971	恒源煤电	100,300	815,439.00	0.32
151	600478	科力远	93,700	806,757.00	0.32
152	300116	坚瑞沃能	75,000	806,250.00	0.32
153	600166	福田汽车	281,400	799,176.00	0.32
154	600348	阳泉煤业	117,500	796,650.00	0.32
155	600776	东方通信	117,400	795,972.00	0.32
156	601678	滨化股份	114,100	792,995.00	0.32
157	300297	蓝盾股份	72,200	790,590.00	0.31
158	002051	中工国际	37,992	787,574.16	0.31
159	603005	晶方科技	27,600	772,524.00	0.31
160	603799	华友钴业	12,700	771,906.00	0.31
161	002268	卫 士 通	45,760	769,683.20	0.31
162	002317	众生药业	59,466	738,567.72	0.29
163	600458	时代新材	63,400	725,930.00	0.29

164	000418	小天鹅 A	15,500	725,245.00	0.29
165	600187	国中水务	143,200	723,160.00	0.29
166	600880	博瑞传播	110,700	722,871.00	0.29
167	002155	湖南黄金	73,489	703,289.73	0.28
168	000636	风华高科	82,629	703,172.79	0.28
169	002315	焦点科技	27,900	695,826.00	0.28
170	000417	合肥百货	84,096	693,792.00	0.28
171	002408	齐翔腾达	60,800	673,664.00	0.27
172	000572	海马汽车	128,100	662,277.00	0.26
173	600673	东阳光科	100,534	656,487.02	0.26
174	002410	广联达	34,400	646,720.00	0.26
175	002285	世联行	80,400	644,808.00	0.26
176	600699	均胜电子	19,874	637,756.66	0.25
177	600600	青岛啤酒	18,100	635,310.00	0.25
178	601231	环旭电子	39,900	626,829.00	0.25
179	600219	南山铝业	182,837	619,817.43	0.25
180	000581	威孚高科	23,600	611,240.00	0.24
181	600039	四川路桥	146,885	611,041.60	0.24
182	000158	常山股份	38,300	605,140.00	0.24
183	300043	星辉娱乐	72,700	596,867.00	0.24
184	600169	太原重工	154,300	595,598.00	0.24
185	600366	宁波韵升	33,555	591,910.20	0.24
186	603883	老百姓	12,000	583,800.00	0.23
187	600284	浦东建设	54,400	583,168.00	0.23
188	002041	登海种业	41,627	551,557.75	0.22
189	603198	迎驾贡酒	28,700	546,161.00	0.22
190	600872	中炬高新	29,654	542,668.20	0.22
191	600289	亿阳信通	48,751	533,335.94	0.21
192	300136	信维通信	13,000	520,260.00	0.21
193	600835	上海机电	24,562	519,240.68	0.21
194	600201	生物股份	14,030	499,047.10	0.20
195	002551	尚荣医疗	30,803	496,852.39	0.20
196	002491	通鼎互联	36,600	491,904.00	0.20
197	600584	长电科技	30,102	483,137.10	0.19
198	002273	水晶光电	23,000	474,490.00	0.19
199	600754	锦江股份	17,500	474,250.00	0.19
200	002244	滨江集团	68,412	473,411.04	0.19
201	600859	王府井	28,574	461,470.10	0.18
202	600648	外高桥	24,500	453,740.00	0.18
203	000021	深科技	50,400	432,432.00	0.17
204	000528	柳 工	49,406	426,867.84	0.17

205	600826	兰生股份	23,442	424,300.20	0.17
206	603025	大豪科技	15,100	398,640.00	0.16
207	600557	康缘药业	23,051	382,877.11	0.15
208	600597	光明乳业	29,600	377,400.00	0.15
209	002707	众信旅游	27,900	366,327.00	0.15
210	601012	隆基股份	21,323	364,623.30	0.15
211	000829	天音控股	33,000	356,400.00	0.14
212	000563	陕国投 A	68,100	352,077.00	0.14
213	600525	长园集团	24,870	337,983.30	0.13
214	002013	中航机电	31,465	325,033.45	0.13
215	000400	许继电气	17,900	321,484.00	0.13
216	000848	承德露露	31,580	315,168.40	0.13
217	600884	杉杉股份	19,000	312,930.00	0.12
218	600642	申能股份	49,600	312,480.00	0.12
219	600720	祁连山	39,300	307,719.00	0.12
220	002344	海宁皮城	36,900	307,008.00	0.12
221	000566	海南海药	22,204	294,425.04	0.12
222	600805	悦达投资	38,800	285,180.00	0.11
223	600811	东方集团	42,200	275,144.00	0.11
224	000620	新华联	38,152	271,260.72	0.11
225	000860	顺鑫农业	13,255	265,232.55	0.11
226	600435	北方导航	18,100	259,011.00	0.10
227	002690	美亚光电	13,400	257,012.00	0.10
228	600184	光电股份	13,000	243,880.00	0.10
229	002176	江特电机	27,700	241,544.00	0.10
230	000513	丽珠集团	3,459	235,557.90	0.09
231	600917	重庆燃气	24,200	228,206.00	0.09
232	000999	华润三九	7,000	222,250.00	0.09
233	000661	长春高新	1,678	216,646.58	0.09
234	002269	美邦服饰	57,600	214,848.00	0.09
235	600316	洪都航空	12,900	207,303.00	0.08
236	600729	重庆百货	7,100	190,564.00	0.08
237	600967	内蒙一机	13,900	189,457.00	0.08
238	600056	中国医药	7,000	181,650.00	0.07
239	002572	索菲亚	4,400	180,400.00	0.07
240	600614	鹏起科技	16,334	179,674.00	0.07
241	002482	广田集团	19,900	178,901.00	0.07
242	600848	上海临港	8,200	176,792.00	0.07
243	603077	和邦生物	34,100	173,569.00	0.07
244	600770	综艺股份	23,000	172,500.00	0.07
245	600831	广电网络	16,900	168,155.00	0.07

246	600879	航天电子	18,348	161,278.92	0.06
247	002340	格林美	26,626	161,087.30	0.06
248	002428	云南锗业	14,700	156,996.00	0.06
249	000062	深圳华强	5,800	153,874.00	0.06
250	600881	亚泰集团	28,744	146,019.52	0.06
251	000401	冀东水泥	9,400	144,666.00	0.06
252	600655	豫园商城	12,172	137,787.04	0.05
253	603766	隆鑫通用	18,000	131,040.00	0.05
254	300253	卫宁健康	15,396	120,242.76	0.05
255	000761	本钢板材	22,600	118,198.00	0.05
256	002073	软控股份	12,800	108,544.00	0.04
257	002416	爱施德	10,000	107,900.00	0.04
258	600628	新世界	9,200	106,260.00	0.04
259	000078	海王生物	17,603	106,146.09	0.04
260	002392	北京利尔	17,800	105,554.00	0.04
261	603369	今世缘	7,700	101,640.00	0.04
262	600801	华新水泥	10,500	100,065.00	0.04
263	600640	号百控股	5,700	96,330.00	0.04
264	600141	兴发集团	7,700	95,249.00	0.04
265	002681	奋达科技	7,100	89,389.00	0.04
266	300156	神雾环保	2,500	81,900.00	0.03
267	600759	洲际油气	13,358	80,949.48	0.03
268	000816	智慧农业	10,700	79,608.00	0.03
269	000726	鲁 泰 A	6,400	75,904.00	0.03
270	600422	昆药集团	6,100	69,174.00	0.03
271	603377	东方时尚	1,700	63,903.00	0.03
272	600970	中材国际	6,600	57,354.00	0.02
273	600171	上海贝岭	5,400	54,918.00	0.02
274	000656	金科股份	8,100	52,974.00	0.02
275	601689	拓普集团	1,100	36,839.00	0.01
276	603328	依顿电子	2,600	36,790.00	0.01
277	300287	飞利信	4,000	36,720.00	0.01
278	600022	山东钢铁	17,810	36,688.60	0.01
279	601002	晋亿实业	4,200	36,330.00	0.01
280	601000	唐山港	5,641	29,446.02	0.01
281	002311	海大集团	1,544	28,208.88	0.01
282	002179	中航光电	845	26,355.55	0.01
283	600717	天津港	1,500	18,735.00	0.01
284	601168	西部矿业	2,200	16,918.00	0.01
285	002544	杰赛科技	500	11,400.00	—
286	002439	启明星辰	600	11,160.00	—

287	600138	中青旅	455	9,582.30	-
288	600537	亿晶光电	700	3,486.00	-
289	002345	潮宏基	100	1,087.00	-

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002168	深圳惠程	105,725	1,796,267.75	0.71
2	600468	百利电气	79,200	514,800.00	0.20
3	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
4	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
5	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
6	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
7	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
8	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
9	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
10	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
11	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
12	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
13	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
14	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
15	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
16	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
17	300672	国科微	1,257	10,659.36	-
18	603331	百达精工	999	9,620.37	-
19	300671	富满电子	942	7,639.62	-
20	603617	君禾股份	832	7,429.76	-

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	600503	华丽家族	1,602,758.01	0.61
2	002092	中泰化学	1,534,899.00	0.58
3	000960	锡业股份	1,472,405.00	0.56
4	000825	太钢不锈	1,469,443.00	0.56
5	600161	天坛生物	1,459,200.00	0.55
6	600325	华发股份	1,410,663.50	0.53
7	300026	红日药业	1,381,551.00	0.52
8	002371	北方华创	1,342,386.00	0.51
9	600633	浙数文化	1,289,049.00	0.49

10	002354	天神娱乐	1,288,116.20	0.49
11	000727	华东科技	1,277,549.00	0.48
12	300273	和佳股份	1,269,923.25	0.48
13	000930	中粮生化	1,269,610.00	0.48
14	002266	浙富控股	1,264,273.60	0.48
15	600699	均胜电子	1,243,212.00	0.47
16	600522	中天科技	1,237,093.00	0.47
17	600516	方大炭素	1,234,031.00	0.47
18	600307	酒钢宏兴	1,204,751.00	0.46
19	002358	森源电气	1,201,536.03	0.46
20	600499	科达洁能	1,198,319.43	0.45

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	002508	老板电器	3,358,187.22	1.27
2	000887	中鼎股份	2,929,580.84	1.11
3	002179	中航光电	2,510,958.60	0.95
4	600522	中天科技	1,968,017.50	0.75
5	600094	大名城	1,766,271.00	0.67
6	600664	哈药股份	1,667,187.41	0.63
7	000969	安泰科技	1,636,061.73	0.62
8	600614	鹏起科技	1,634,897.00	0.62
9	002573	清新环境	1,622,642.00	0.61
10	600416	湘电股份	1,406,545.45	0.53
11	000897	津滨发展	1,393,198.68	0.53
12	002311	海大集团	1,389,582.00	0.53
13	000566	海南海药	1,368,539.00	0.52
14	600757	长江传媒	1,322,634.00	0.50
15	600138	中青旅	1,321,478.88	0.50
16	000501	鄂武商 A	1,276,829.47	0.48
17	002368	太极股份	1,272,730.82	0.48
18	000616	海航投资	1,265,581.55	0.48
19	600825	新华传媒	1,253,367.25	0.48
20	600143	金发科技	1,252,148.00	0.47

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	119,508,045.34
卖出股票收入（成交）总额	133,205,744.94

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	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

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

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 (%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

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
IC1709	IC1709	3	3,613,080.00	-17,200.00	-

IC1712	IC1712	3	3,546,480.00	152,080.00	-
公允价值变动总额合计(元)			134,880.00		
股指期货投资本期收益(元)			117,706.67		
股指期货投资本期公允价值变动(元)			150,973.33		

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。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)			-		
国债期货投资本期收益(元)			-		
国债期货投资本期公允价值变动(元)			-		

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 本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,602,659.72
2	应收证券清算款	249,319.94
3	应收股利	-
4	应收利息	5,545.08
5	应收申购款	47,517.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,905,042.53
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

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

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
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	002168	深圳惠程	1,796,267.75	0.71	重大资产重组
2	600468	百利电气	514,800.00	0.20	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	778	35,517.20	20,844,578.00	75.44%	6,787,806.00	24.56%
信诚中证500指数分级B	5,855	7,079.18	1,562,344.00	3.77%	39,886,233.00	96.23%
信诚中证500指数分级	13,595	9,921.27	29,222,204.70	21.67%	105,657,450.00	78.33%

合计	20,228	10,083.08	51,629,126.70	25.31%	152,331,489.00	74.69%
----	--------	-----------	---------------	--------	----------------	--------

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	工银瑞信基金—农业银行—中油财务有限责任公司	9,853,328.00	35.66%
2	中荷人寿保险有限公司	3,861,487.00	13.97%
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	8.04%
4	中国银河证券股份有限公司	1,942,413.00	7.03%
5	万范霞	900,068.00	3.26%
6	徐进	826,781.00	2.99%
7	丁瑞金	822,600.00	2.98%
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	2.41%
9	中信建投证券股份有限公司	652,698.00	2.36%
10	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	2.22%

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	2.01%
2	广州市广百股份有限公司	709,684.00	1.71%
3	郑智	557,084.00	1.34%
4	陈胜华	500,000.00	1.21%
5	杨东宁	485,613.00	1.17%
6	梁森泉	467,983.00	1.13%
7	云南云达工程造价咨询有限公司	432,871.00	1.04%
8	张钢	400,000.00	0.97%
9	张爱群	359,000.00	0.87%
10	孙大军	343,200.00	0.83%

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	310,422.91	0.23%
	合计	310,422.91	0.15%

注：1、本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

2、期末本公司基金从业人员未持有本基金的 A 级份额和 B 级份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	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	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	—

注：期末本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	—	—	—	—	—
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

§ 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 2 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	37,261,620.00	55,892,431.00	119,961,548.87
本报告期基金总申购份额	—	—	45,230,021.13
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	57,523,524.83
本报告期基金拆分变动份额	-9,629,236.00	-14,443,854.00	27,211,609.53
本报告期期末基金份额总额	27,632,384.00	41,448,577.00	134,879,654.70

注：1. 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。

2. 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》、《信诚基金关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，基金管理人信诚基金管理有

限公司于 2017 年 2 月 3 日(折算基准日)对本基金进行了基金份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚 500 份额 3,138,519.53 份。

§ 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

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。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、托管人及其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		应支付券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	76,435,391.59	30.76%	69,655.65	30.41%	-
瑞银证券	1	61,132,973.70	24.60%	56,933.87	24.86%	-
平安证券	2	39,396,077.22	15.85%	35,901.37	15.67%	-
西南证券	2	38,976,503.26	15.68%	36,298.85	15.85%	-
银河证券	2	12,693,471.09	5.11%	11,821.84	5.16%	-
中泰证券	1	7,824,397.31	3.15%	7,287.63	3.18%	-
兴业证券	2	7,711,238.32	3.10%	7,181.70	3.14%	-
西部证券	1	4,342,579.42	1.75%	3,957.38	1.73%	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-

大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-

中信浙江	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		
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
中信证券	-	-	-	-	-	-	
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	
平安证券	-	-	-	-	-	-	
西南证券	-	-	-	-	-	-	
银河证券	-	-	-	-	-	-	
中泰证券	-	-	-	-	-	-	
兴业证券	-	-	-	-	-	-	
西部证券	-	-	-	-	-	-	
安信证券	-	-	-	-	-	-	
长城证券	-	-	-	-	-	-	
长江证券	-	-	-	-	-	-	
川财证券	-	-	-	-	-	-	
大通证券	-	-	-	-	-	-	
东北证券	-	-	-	-	-	-	
东方证券	-	-	-	-	-	-	
东吴证券	-	-	-	-	-	-	
东兴证券	-	-	-	-	-	-	
方正证券	-	-	-	-	-	-	
高华证券	-	-	-	-	-	-	
广发证券	-	-	-	-	-	-	
国金证券	-	-	-	-	-	-	
国联证券	-	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	-	
国信证券	-	-	-	-	-	-	
海通证券	-	-	-	-	-	-	
红塔证券	-	-	-	-	-	-	
宏源证券	-	-	-	-	-	-	
华创证券	-	-	-	-	-	-	
华融证券	-	-	-	-	-	-	
华泰证券	-	-	-	-	-	-	
联合证券	-	-	-	-	-	-	
民生证券	-	-	-	-	-	-	

山西证券	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金租用证券公司交易单元本报告期末未进行其他证券投资。

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
-	-	-	-

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- | |
|---|
| <ol style="list-style-type: none">1、信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程3、信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同4、信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书5、本报告期内按照规定披露的各项公告 |
|---|

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地点--中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

12.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日