

# 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2017 年第三季度报告

2017 年 9 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

报告送出日期：2017 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|                 |   |                              |   |
|-----------------|---|------------------------------|---|
| 基金简称            | 信诚中证 500 指数分级   |                              |   |
| 场内简称            | 信诚 500  |                              |   |
| 基金主代码           | 165511  |                              |   |
| 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   |                              |   |
| 报告期末基金份额总额      | 266,795,070.33 份  |                              |   |
| 投资目标            | 本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证 500 指数的有效跟踪，为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。  |                              |   |
| 投资策略            | <p>本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> |                              |   |
| 业绩比较基准          | 95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率  |                              |   |
| 风险收益特征          | 本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。   |                              |   |
| 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  |                              |   |
| 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 | 24,223,264.00 份   | 36,334,897.00 份              | 206,236,909.33 份  |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 信诚中证 500 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。   | 信诚中证 500 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。 | 本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2017年7月1日至2017年9月30日） |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 4,066,606.98              |
| 2.本期利润         | 28,330,362.98             |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1207                    |
| 4.期末基金资产净值     | 359,716,177.28            |
| 5.期末基金份额净值     | 1.348                     |

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。

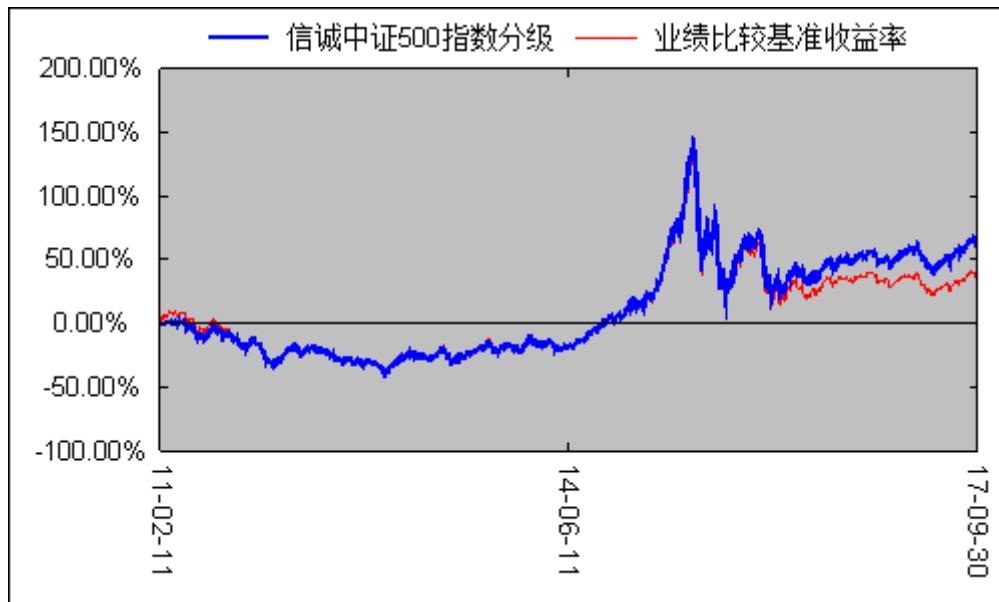
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 9.42%      | 0.90%         | 7.21%          | 0.89%                 | 2.21% | 0.01% |

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期自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 基金经理（或基金经理小组）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 |        |   |
| 杨旭 | 本基金基金经理，兼任信诚沪深 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基金(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、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理。 | 2015 年 1 月 15 日 | -    | 5      | 理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司，担任数量分析师；于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司，担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入信诚基金，历任助理投资经理、专户投资经理。现任量化投资二部副总监，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基金(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、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理。 |

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的行为监控，分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2017年三季度，A股市场震荡上扬，周期股首先发力，同时之前蓝筹滞胀板块出现补涨，金融板块随之发力引领上证综指创去年11月底以来的新高，随后市场涨幅趋缓维持震荡横盘，周期板块出现调整，资金逐步从周期板块流出，各板块之间轮动加快。

从外部因素来看，欧美经济数据持续改善，9月美国ISM制造业和非制造业PMI分别创出2004、2006年以来的新高，欧元区PMI持续上行；美联储缩表计划临近，年底加息几率增大，欧退出QE尚存分歧，推进速度慢于预期。国际货币政策总体保持不紧不松，欧美经济复苏持续性仍较为依赖全球性的需求复苏。

从国内环境来看，6、7月各项经济数据的超预期，随后8月经济数据走弱，经济持续超预期的观点被证伪，规模以上工业增加值、汽车销售数据、全国固定资产投资、房地产投资、制造业投资以及终端需求在内的数据均表现低迷，但PMI、社会融资等数据表明经济仍有较强的支撑；房地产市场经历了新一轮的调控政策，地产逐渐回归居住属性。流动性方面央行货币政策维持稳健中性。总体来说经济韧性较强，流动性不紧不松。

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。

展望今年四季度，对宏观层面的判断是库存周期开始下降，伴随中周期开启，整个经济韧性较大。中国制造业领域的盈利修复，资本开支扩张与ROE的扩张仍没见顶。

对市场判断为震荡向上，市场的结构性机会在于盈利驱动的成长板块。从资金面看，流动性不紧不松，央行此次提出定向降准是对7月份全国金融经济工作会议上提出的“脱虚向实”的政策延续，并助力中小企业；同时，定向降准时间定在2018年，表明四季度货币政策基调仍为“脱虚向实”同时保持金融市场稳定。因此A股市场不具备流动性趋势性改变机会，故而市场仍为盈利驱动。在盈利驱动的大逻辑下，目前市场正寻找性价比相对较高的板块，估值合理的成长板块吸引力较，看好有需求增量、符合中长期需求趋势的板块。

#### 4.5 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9.42%，同期业绩比较基准收益率为7.21%，基金超越业绩比较基准2.21%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 333,846,579.62 | 92.24        |
|    | 其中：股票             | 333,846,579.62 | 92.24        |
| 2  | 固定收益投资            | 138,500.00     | 0.04         |
|    | 其中：债券             | 138,500.00     | 0.04         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 25,987,142.69  | 7.18         |
| 7  | 其他资产              | 1,947,107.03   | 0.54         |
| 8  | 合计                | 361,919,329.34 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,866,300.00   | 0.80         |
| B  | 采矿业              | 13,191,447.20  | 3.67         |
| C  | 制造业              | 207,502,718.80 | 57.69        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,643,310.83  | 3.24         |
| E  | 建筑业              | 6,694,334.74   | 1.86         |
| F  | 批发和零售业           | 22,541,702.40  | 6.27         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,521,610.91   | 2.37         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 18,961,151.35  | 5.27         |
| J  | 金融业              | 4,920,255.92   | 1.37         |
| K  | 房地产业             | 18,294,224.98  | 5.09         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,542,808.40   | 0.98         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,998,094.00   | 0.56         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,787,974.20   | 0.50         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | 553,525.00     | 0.15         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 1,637,760.00   | 0.46         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 4,971,541.62   | 1.38         |
| S  | 综合               | 691,898.00     | 0.19         |
|    | 合计               | 330,320,658.35 | 91.83        |

### 5.2.2 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              | 39,793.60    | 0.01         |
| C  | 制造业              | 3,146,988.18 | 0.87         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,093.44    | 0.01         |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | 26,380.90    | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 25,571.91    | 0.01         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 17,468.03    | -            |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 79,324.72    | 0.02         |
| 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          | 115,299.99   | 0.03         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 44,000.50    | 0.01         |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 3,525,921.27 | 0.98         |

### 5.2.3 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沪港通投资股票。

### 5.3 报告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

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

| 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  | 300136 | 信维通信 | 82,780  | 3,476,760.00 | 0.97         |
| 2  | 600809 | 山西汾酒 | 53,400  | 2,939,670.00 | 0.82         |
| 3  | 600516 | 方大炭素 | 94,500  | 2,886,975.00 | 0.80         |
| 4  | 600487 | 亨通光电 | 83,490  | 2,872,056.00 | 0.80         |
| 5  | 000488 | 晨鸣纸业 | 128,544 | 2,520,747.84 | 0.70         |
| 6  | 600388 | 龙净环保 | 141,800 | 2,399,256.00 | 0.67         |
| 7  | 000997 | 新大陆  | 103,806 | 2,340,825.30 | 0.65         |
| 8  | 002078 | 太阳纸业 | 233,744 | 2,337,440.00 | 0.65         |
| 9  | 600183 | 生益科技 | 152,012 | 2,330,343.96 | 0.65         |
| 10 | 600298 | 安琪酵母 | 87,465  | 2,228,608.20 | 0.62         |

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|    |      |      |       |         |              |

|   |        |      |         |              | 值比例 (%) |
|---|--------|------|---------|--------------|---------|
| 1 | 002168 | 深圳惠程 | 105,725 | 1,796,267.75 | 0.50    |
| 2 | 600468 | 百利电气 | 79,200  | 514,800.00   | 0.14    |
| 3 | 603882 | 金域医学 | 2,763   | 115,299.99   | 0.03    |
| 4 | 603106 | 恒银金融 | 2,786   | 84,025.76    | 0.02    |
| 5 | 002900 | 哈三联  | 1,983   | 83,087.70    | 0.02    |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)    | 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       | 138,500.00 | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 138,500.00 | 0.04         |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 128016 | 雨虹转债 | 1,385 | 138,500.00 | 0.04         |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 5.7 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

本基金报告期内未进行贵金属投资。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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 |
|-------------------|--------|------------|--------------|------------|------|
| IC1712            | IC1712 | 4          | 5,209,920.00 | 499,560.00 | -    |
| IC1803            | IC1803 | 2          | 2,588,560.00 | 42,920.00  | -    |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        | 542,480.00 |              |            |      |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        | 341,520.00 |              |            |      |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        | 407,600.00 |              |            |      |

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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 山东晨鸣纸业集团股份有限公司(以下简称“该公司”)于2017年6月15日接获债权人向香港高等法院作出的清盘呈请，指称该公司未能履行仲裁案之最后裁决需支付金额人民币167,860,000元及利息、律师费用美元3,548,932.04元及利息及仲裁费用3,303,933.07港元及利息(以下统称“该债务”)。2016年10月18日，债权人向该公司发出法定要求偿债书以要求该公司支付该债务，该公司因此向香港高等法院于2016年11月7日申请禁制令以禁止债权人对公司提出任何潜在清盘呈请；由于禁制令被驳回及法定要求偿债书已发出超过二十天后，该公司仍未支付该债务，故债权人现透过香港高等法院向本公司作出清盘呈请。

5.11.2 该公司于2017年6月1日、6月16日、6月22日、6月29日、8月24日及8月28日陆续发布关于该法定要求偿债书及清盘呈请的公告。2017年9月21日，该公司发布清盘呈请之最新消息，称已向香港高等法院存入港币389,112,432.44元(相等于法定要求偿债书之港币款额及其由2016年10月19日至2018年8月27日之利息)之款项，清盘呈请之聆讯被押后但可随意恢复。

5.11.3 对晨鸣纸业的投资决策程序的说明：晨鸣纸业属于中证500指数成分股，本基金为指数型基金，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，故持有该证券。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.4 除此之外，其余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。

5.11.5 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。

### 5.11.6 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,751,862.76 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 12,079.47    |
| 5  | 应收申购款   | 183,164.80   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,947,107.03 |

**5.11.7 报告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。

**5.11.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****5.11.8.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**5.11.8.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 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   | 0.50         | 重大资产重组   |
| 2  | 600468 | 百利电气 | 514,800.00     | 0.14         | 重大资产重组   |

注：截止到本报告批准报送之日，“深圳惠程”“百利电气”仍未发布复牌公告。

**5.11.9 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。

**§ 6 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    |
|------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                  | 27,632,384.00 | 41,448,577.00 | 134,879,654.70 |
| 报告期内基金总申购份额                  | -             | -             | 84,199,384.50  |
| 减：报告期内基金总赎回份额                | -             | -             | 21,364,929.87  |
| 报告期内基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -3,409,120.00 | -5,113,680.00 | 8,522,800.00   |
| 报告期末基金份额总额                   | 24,223,264.00 | 36,334,897.00 | 206,236,909.33 |

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。

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

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 |
|-------------------------|--------------|--------------|-------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额        | -            | -            |             |
| 报告期内买入/申购总份额            | -            | -            |             |
| 报告期内卖出/赎回总份额            | -            | -            |             |
| 报告期末管理人持有的本基金份额         | -            | -            |             |
| 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | -            | -            |             |

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |      |               |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|--------------------------|------|---------------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20170825 至 20170930      |      | 54,431,570.76 |      | 54,431,570.76 | 20.40% |
| 个人    | -              | -                        | -    | -             | -    | -             | -      |

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%, 则面临大额赎回的情况, 可能导致:

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对, 可能会产生基金仓位调整困难, 导致流动性风险; 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回, 如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请, 对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 则可能使基金资产净值受到不利影响, 影响基金的投资运作和收益水平;
- (3) 因基金净值精度计算问题, 或因赎回费收入归基金资产, 导致基金净值出现较大波动;
- (4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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、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

### 10.2 存放地点

信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

### 10.3 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.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司  
2017 年 10 月 26 日