

信诚中证智能家居指数分级证券投资基金

2018年第二季度报告

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月19日

重要提示
本基金的管理人、董事及董事会全体成员不存在虚假记载、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。
本基金的管理人中信保诚基金管理有限公司根据《基金合同》规定，于2018年1月18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。
本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。
本报告期中财务资料未经审计。

报告期自2018年1月1日起至6月30日止。
§ 2 基金产品概况

报告期初基金资产净值
71,462,760.67

投资目标
本基金主要投资于中证智能家居指数成份股，通过资产配置，实现中长期资本增值的理财目标。

投资策略
本基金主要投资于中证智能家居指数成份股，通过资产配置，实现中长期资本增值的理财目标。

投资范围
本基金主要投资于中证智能家居指数成份股，通过资产配置，实现中长期资本增值的理财目标。

投资比例
95%以上的基金资产投资于中证智能家居指数成份股，其余资产投资于法律法规或基金合同约定的其他金融工具。

风险收益特征
本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。
本基金主要投资于中证智能家居指数成份股，其余资产投资于法律法规或基金合同约定的其他金融工具。

基金管理人
中信保诚基金管理有限公司

基金托管人
中国银行股份有限公司

基金类别
股票型基金

基金合同生效日
2015年6月26日

报告期初基金份额总额
71,462,760.67

报告期基金净值增长率
-1.72%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

报告期基金份额净值
49,034,317.03

报告期基金份额净值增长率
-0.69%

注:基金管理人于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日在中证监证监局指定媒介以及公司网站上刊登了本公司法

定名称变更的公告。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标
(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-4,172,158.26

2.本期利润
-9,568,112.00

3.期初至报告期末基金利润
-0.12%

4.期末基金资产净值
49,034,317.03

5.期末基金份额净值
0.69

3.2 基金净值表现

3.2.1 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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

业绩比较基准收益率
-0.12%

业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.2 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

阶段
净值增长率
-16.76%

净值增长率标准差
1.2%

同期业绩比较基准收益率
-1.72%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中信保诚普全指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.1 管理人报告

4.1.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-10,000,530.15

2.本期利润
-44,011,204.00

3.期初至报告期末基金利润
-0.12%

4.期末基金资产净值
43,440,426.76

5.期末基金份额净值
0.89

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.3 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-16.76%

净值增长率标准差
1.2%

同期业绩比较基准收益率
-1.72%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中信保诚普全指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.2 管理人报告

4.2.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-282,261.67

2.本期利润
-267,061.67

3.期初至报告期末基金利润
-0.1059

4.期末基金资产净值
361,263.06

5.期末基金份额净值
1.197

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.4 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.3 管理人报告

4.3.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-282,261.67

2.本期利润
-267,061.67

3.期初至报告期末基金利润
-0.1059

4.期末基金资产净值
361,263.06

5.期末基金份额净值
1.197

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.5 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.4 管理人报告

4.4.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-282,261.67

2.本期利润
-267,061.67

3.期初至报告期末基金利润
-0.1059

4.期末基金资产净值
361,263.06

5.期末基金份额净值
1.197

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.6 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.5 管理人报告

4.5.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-282,261.67

2.本期利润
-267,061.67

3.期初至报告期末基金利润
-0.1059

4.期末基金资产净值
361,263.06

5.期末基金份额净值
1.197

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.7 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中证智能家居指数收益率*20%”。
3.其他指标

4.6 管理人报告

4.6.1 主要财务指标

(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益
-282,261.67

2.本期利润
-267,061.67

3.期初至报告期末基金利润
-0.1059

4.期末基金资产净值
361,263.06

5.期末基金份额净值
1.197

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司已实现收益指基金利息收入、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，本期利息收入为本期已实现收益扣除公允价值变动收益后的余额。
3.基金净值表现

3.2.8 基金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变动的比较

阶段
净值增长率
-1.72%

净值增长率标准差
1.48%

同期业绩比较基准收益率
-0.12%

同期业绩比较基准收益率标准差
-0.10%

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。