# 信诚中证800金融指数分级证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年06月30日

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018年08月28日

## §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 信诚中证800金融指数分级 | | |
| 场内简称 | 信诚金融 | | |
| 基金主代码 | 165521 | | |
| 交易代码 | - | - | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2013年12月20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 | 913,008,286.15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 | 2014年1月22日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚中证800金融指数分级A | 信诚中证800金融指数分级B | 信诚中证800金融指数分级 |
| 下属分级基金的场内简称 | 金融800A | 金融800B | 信诚金融 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150157 | 150158 | 165521 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 431,491,970.00份 | 431,491,971.00份 | 50,024,345.15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800金融指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。 | | |
| 投资策略 | 本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合,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%。<br>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,如预期大额申购赎回、大量分红等,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800金融价格指数收益率+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,具有较高预期风险、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 | 金融A份额具有预期风险、预期收益较低的特征 | 金融B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。 | 本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.citicprufunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年01月01日-2018年06月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 20,313,175.82 |
| 本期利润 | -135,288,478.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1412 |
| 本期基金份额净值增长率 | -14.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年06月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0490 |
| 期末基金资产净值 | 791,157,624.41 |
| 期末基金份额净值 | 0.867 |

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。

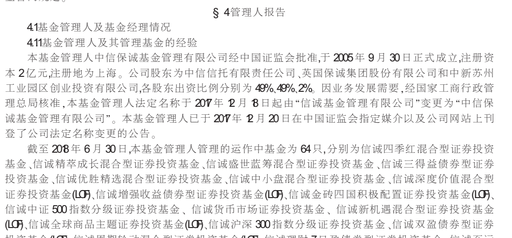
3.2 基金净值表现

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 | -6.57% | 1.02% | -7.24% | 1.06% | 0.67% | -0.04% |
| 过去三个月 | -10.89% | 1.03% | -11.89% | 1.08% | 1.00% | -0.05% |
| 过去六个月 | -14.92% | 1.16% | -16.33% | 1.19% | 1.41% | -0.03% |
| 过去一年 | -8.65% | 1.02% | -9.76% | 1.04% | 1.11% | -0.02% |
| 过去三年 | -20.24% | 1.41% | -21.93% | 1.43% | 1.69% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.48% | 1.60% | 45.59% | 1.62% | 4.89% | -0.02% |

本基金的业绩比较标准为:95%× 中证800金融价格指数收益率+5%× 金融同业存款利率

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2013年12月20日至2014年6月20日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2018年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为64只,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金(LOF)、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财28日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金。

截至2018年6月30日,本基金管理人管理的处于清算期中的基金为10只,分别为信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚至盛灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 杨旭 | 本基金基金经理,兼任量化投资副总监,信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金、中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。 | 2015年01月15日 | - | 5 | 理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金Robust methods公司,担任数量分析师;于华尔街对冲基金WSFA Group公司,担任Global Systematic Alpha Fund基金经理。2012年8月加入中信保诚基金管理有限公司,历任助理投资经理、专户投资经理。现任量化投资副总监,信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚永丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金、中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。 |
| HAN YILING | 本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级证券投资基金的基金经理。 | 2018年04月10日 | - | 4 | 计算机学硕士、信息技术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术研究院,担任研究员;于中信保诚基金管理有限公司,担任量化投资部金融工程师;于华宝兴业基金管理有限公司,担任量化部投资经理。2016年6月重新加入中信保诚基金管理有限公司,历任投资经理、基金经理助理。现任信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚中证800金融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800金融指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,国内股票市场波动有所加大,受美国加息及中美贸易战等因素的影响,出现较大幅度回调。上证综指上半年下跌-14.07%。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,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。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-14.92%,同期比较基准收益率为-16.33%,基金超越业绩比较基准1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年,市场总体呈下跌态势。一季度流动性先松后紧,市场风格变化较快,加之前阶段性上涨势头过猛,引起了市场恐慌情绪。直至3月,美联储加息以及中美产生贸易摩擦,恐慌情绪进一步扩大。二季度对A股市场最大的影响仍然来源于海外。美联储加息意料之内,且伴随贸易摩擦进一步升级,以及中美对话因各自利益互补妥协,市场受到了沉重打击。虽然有MSCI纳入A股进入其新兴市场指数,但市场资金面本身偏紧、信用风险接连爆发,因此上证综指、沪深300等指数在5月小幅反弹后继续下跌。目前上证综指处于2015年股灾以来的低点,未来仍将保持谨慎投资的态势。

从目前市场来看,整个市场面临双重考验:内部稳步降杠杆过程需要继续推进;外部中美发展矛盾仍需解决。下半年从国务院基调来看,避免"大水漫灌"式放水政策可能会配合财政政策为融资链末端注入资金,加之通胀压力并不大,内部形式或将得到缓解。但中美矛盾源于两国之间发展的矛盾,并非关税这么简单的问题。这一影响可能会一直持续下去。综上,下半年仍然关注超跌行业,选股逻辑仍以盈利、估值为主线。目前市场超跌的优质公司相对较多,若市场回暖,超跌公司将带来较好的投资收益。但市场目前悲观情绪较重,三季度将保持谨慎,在市场回暖中寻找投资机会。

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严格控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

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

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中"基金资产净值计算和会计核算"确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2.基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

4.基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定,本基金(包括信诚金融份额、信诚金融A份额、信诚金融B份额)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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信诚中证800金融指数分级证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末(2018年06月30日) | 上年度末(2017年12月31日) |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 41,355,721.15 | 53,557,571.41 |
| 结算备付金 | | 1,169,293.84 | 6,756,302.94 |
| 存出保证金 | | 92,421.28 | 206,956.08 |
| 交易性金融资产 | | 750,279,900.11 | 1,022,864,965.70 |
| 其中:股票投资 | | 750,279,900.11 | 1,021,505,765.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 1,359,200.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 8,182.61 | 12,891.08 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 28,534.37 | 53,300.18 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 792,934,053.36 | 1,083,451,987.39 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末(2018年06月30日) | 上年度末(2017年12月31日) |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 1,494,568.59 |
| 应付赎回款 | | 16,822.98 | 19,462.03 |
| 应付管理人报酬 | | 686,793.79 | 949,302.29 |
| 应付托管费 | | 151,094.62 | 208,846.50 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 313,630.24 | 421,502.65 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 608,087.32 | 800,571.50 |
| 负债合计 | | 1,776,428.95 | 3,894,253.56 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 526,087,734.80 | 610,324,206.12 |
| 未分配利润 | | 265,069,889.61 | 469,233,527.71 |
| 所有者权益合计 | | 791,157,624.41 | 1,079,557,733.83 |
| 负债和所有者权益总计 | | 792,934,053.36 | 1,083,451,987.39 |

注:截至本报告期末,基金份额总额913,008,286.15份。信诚中证800金融指数分级的基金份额净值0.867元,基金份额总额50,024,345.15份。下属分级基金:信诚中证800金融指数分级A的基金份额净值1.025元,基金份额总额431,491,970.00份;信诚中证800金融指数分级B的基金份额净值0.709元,基金份额总额431,491,971.00份。

6.2 利润表

会计主体:信诚中证800金融指数分级证券投资基金

本报告期:2018年01月01日-2018年06月30日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期(2018年01月01日至2018年06月30日) | 上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -127,627,186.94 | 127,468,242.04 |
| 1.利息收入 | | 199,759.27 | 728,465.33 |
| 其中:存款利息收入 | | 199,293.32 | 174,222.87 |
| 债券利息收入 | | 465.95 | 554,242.46 |
| 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) | | 27,545,979.08 | -83,086,995.93 |
| 其中:股票投资收益 | | 20,350,792.01 | -93,243,713.91 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 311,225.56 | 196,587.24 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 6,883,961.51 | 9,960,130.74 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -155,601,654.70 | 209,412,398.83 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 228,729.41 | 414,373.81 |
| 减:二、费用 | | 7,661,291.94 | 15,849,624.19 |
| 1. 管理人报酬 | | 4,733,206.47 | 9,033,715.61 |
| 2. 托管费 | | 1,041,305.42 | 1,987,417.37 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 1,536,900.50 | 4,391,676.40 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | | 349,879.55 | 436,814.81 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -135,288,478.88 | 111,618,617.85 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -135,288,478.88 | 111,618,617.85 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚中证800金融指数分级证券投资基金

本报告期:2018年01月01日-2018年06月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期(2018年01月01日至2018年06月30日) 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|---|---|---|---|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 610,324,206.12 | 469,233,527.71 | 1,079,557,733.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -135,288,478.88 | -135,288,478.88 |
| 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) | -84,236,471.32 | -68,875,159.22 | -153,111,630.54 |
| 其中:1.基金申购款 | 5,564,369.66 | 4,437,341.79 | 10,001,711.45 |
| 2.基金赎回款 | -89,800,840.98 | -73,312,501.01 | -163,113,341.99 |
| 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) | 526,087,734.80 | 265,069,889.61 | 791,157,624.41 |

| 项目 | 上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|---|---|---|---|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,202,279,401.76 | 653,310,791.44 | 1,855,590,193.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 111,618,617.85 | 111,618,617.85 |
| 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) | -181,525,848.93 | -104,804,137.24 | -286,329,986.17 |
| 其中:1.基金申购款 | 30,414,222.35 | 17,083,045.58 | 47,497,267.93 |
| 2.基金赎回款 | -211,940,071.28 | -121,887,182.82 | -333,827,254.10 |
| 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) | 1,020,753,552.83 | 660,125,272.05 | 1,680,878,824.88 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

吕涛 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800金融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")证监许可[2013]1088号《关于核准信诚中证800金融指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为"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》、《证券投资基金运作管理办法》、《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币263,149,632.10元,业经普华永道中天验字(2013)第841号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》于2013年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为263,186,356.17份基金份额,其中认购资金利息折合36,724.07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。

根据《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金份额包括信诚中证800金融指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"信诚金融份额",基金代码"165521")、信诚中证800金融指数分级证券投资基金之信诚金融A份额(以下简称"信诚金融A份额",基金代码"150157")与信诚中证800金融指数分级证券投资基金之信诚金融B份额(以下简称"信诚金融B份额",基金代码"150158")。本基金通过场外、场内两种方式公开发售信诚金融份额。投资人场外认购所得的信诚金融份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的信诚金融份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为信诚金融A份额和信诚金融B份额。信诚金融A份额和信诚金融B份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,信诚金融份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,信诚金融A份额和信诚金融B份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内信诚金融份额与信诚金融A份额和信诚金融B份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份场内信诚金融份额按照1:1的份额配比转换成1份信诚金融A份额与1份信诚金融B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份信诚金融A份额与1份信诚金融B份额按照1:1的基金份额配比转换成2份场内信诚金融份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:信诚金融份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为信诚金融份额、信诚金融A份额、信诚金融B份额数量的总和。本基金每份信诚金融A份额与每份信诚金融B份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额净值之和等于2份信诚金融份额的基金份额净值之和。信诚金融A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率(税后)+3.2%,信诚金融A份额的基金份额净值以1.000元为基础,采用信诚金融A份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算(信诚金融A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数),计算出信诚金融A份额的基金份额净值后,根据信诚金融份额的基金份额净值与信诚金融A份额、信诚金融B份额之间的基金份额净值关系,可以计算出信诚金融B份额的基金份额净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年12月15日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日;基金合同生效不满3个月的除外),本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后信诚金融A份额的基金份额净值调整为1.000元,基金份额折算日折算前信诚金融A份额的基金份额净值超出1.000元的部分将折算为信诚金融份额的场内份额分配给信诚金融A份额持有人。信诚金融A份额持有人持有的每两份信诚金融A份额将按一份信诚金融A份额获得新增信诚金融份额的分配,经过上述份额折算后,信诚金融份额的基金份额净值将相应调整。信诚金融B份额不进行定期份额折算,其基金份额净值和份额数保持不变。

除以上的定期份额折算外,当信诚金融份额的基金份额净值大于或等于1.500元;当信诚金融B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日,进行不定期份额折算:份额折算后信诚金融A份额和信诚金融B份额的比例仍保持1:1不变,份额折算后信诚金融份额、信诚金融A份额和信诚金融B份额的基金份额净值均调整为1.000元。当信诚金融份额的基金份额净值大于或等于1.500元时,基金份额折算日折算前信诚金融份额、信诚金融A份额和信诚金融B份额的基金份额净值超出1.000元的部分均将折算为信诚金融份额分别分配给信诚金融份额、信诚金融A份额和信诚金融B份额的持有人。当信诚金融B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,信诚金融份额、信诚金融A份额和信诚金融B份额的份额数将得到相应的调整。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2013]第1088号文审核同意,本基金信诚金融A份额(150157)13,253,156.00份基金份额和信诚金融B份额(150158)13,253,157.00份基金份额于2014年1月22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》、《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》和最新公布的《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证800金融指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于中证800金融指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准:95%× 中证800金融价格指数收益率+5%× 金融同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除6.4.5所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《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《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 中信保诚基金管理有限公司("中信保诚基金") | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("建设银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中信信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.2 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交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期(2018年01月01日至2018年06月30日) | 上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,733,206.47 | 9,033,715.61 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 291,762.38 | 342,283.61 |

注:支付基金管理人中信保诚基金的管理人报酬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。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.00%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期(2018年01月01日至2018年06月30日) | 上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,041,305.42 | 1,987,417.37 |

注:支付基金托管人中国建设银行的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。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值X0.22%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行,本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: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。

信诚中证800金融指数分级

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末(2018年06月30日) 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 上年度末(2017年12月31日) 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 中信信托有限责任公司 | 1.00 | 0.00% | 1.00 | 0.00% |

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期(2018年01月01日至2018年06月30日) 期末余额 | 当期利息收入 | 上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 建设银行 | 41,355,721.15 | 188,798.33 | 31,765,014.25 | 140,247.05 |

注:

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

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,于本报告期末的相关余额为人民币1,169,293.84元。(2017年6月30日余额为人民币3,342,549.57元)

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 603105 | 芯能科技 | 2018年06月29日 | 2018年07月09日 | 网下新股申购未上市 | 4.83 | 4.83 | 3,410 | 16,470.30 | 16,470.30 | - |
| 603706 | 东方环宇 | 2018年06月29日 | 2018年07月09日 | 网下新股申购未上市 | 13.09 | 13.09 | 1,765 | 23,103.85 | 23,103.85 | |
| 603693 | 江苏新能 | 2018年06月25日 | 2018年07月03日 | 网下新股申购未上市 | 9.00 | 9.00 | 5,384 | 48,456.00 | 48,456.00 | |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为750,191,869.96元,属于第二层次的余额为88,030.15元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次1,021,357,257.50元,第二层次1,507,708.20元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3)除以上事项外,截至本报告期末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 | 750,279,900.11 | 94.62 |
| | 其中:股票 | 750,279,900.11 | 94.62 |
| | 基金投资 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 42,525,014.99 | 5.36 |
| 7 | 其他各项资产 | 129,138.26 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 792,934,053.36 | 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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | 748,552,719.30 | 94.61 |
| K | 房地产业 | 432,684.00 | 0.05 |
| 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 | 748,985,403.30 | 94.67 |

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,030,715.32 | 0.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 110,995.50 | 0.01 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,226.14 | 0.01 |
| 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 | 1,294,496.81 | 0.16 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| - | 601318 | 中国平安 | 1,694,097 | 99,240,202.26 | 12.54 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 2,000,480 | 52,892,691.20 | 6.69 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 2,958,756 | 42,606,086.40 | 5.39 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 5,728,888 | 40,102,216.00 | 5.07 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 6,716,892 | 38,554,960.08 | 4.87 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 9,730,284 | 33,472,176.96 | 4.23 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 5,644,672 | 30,029,655.04 | 3.80 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 3,109,168 | 29,723,646.08 | 3.76 |
| 9 | 601169 | 北京银行 | 4,245,101 | 25,597,959.03 | 3.24 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 1,526,350 | 25,291,619.50 | 3.20 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 10,261 | 738,381.56 | 0.09 |
| 2 | 300747 | 锐科激光 | 1,543 | 123,995.48 | 0.02 |
| 3 | 601990 | 南京证券 | 10,230 | 110,995.50 | 0.01 |
| 4 | 603587 | 地素时尚 | 2,442 | 100,879.02 | 0.01 |
| 5 | 601330 | 绿色动力 | 4,971 | 81,226.14 | 0.01 |

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 | 601998 | 中信银行 | 32,895,280.33 | 3.05 |
| 2 | 601997 | 贵阳银行 | 29,042,856.21 | 2.69 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 27,473,409.84 | 2.54 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 26,993,781.30 | 2.50 |
| 5 | 601229 | 上海银行 | 23,817,190.91 | 2.21 |
| 6 | 601009 | 南京银行 | 21,797,994.38 | 2.02 |
| 7 | 600919 | 江苏银行 | 20,347,738.79 | 1.88 |
| 8 | 600015 | 华夏银行 | 20,097,555.62 | 1.86 |
| 9 | 601288 | 农业银行 | 19,846,574.19 | 1.84 |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 18,483,343.64 | 1.71 |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 15,795,174.54 | 1.46 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 14,925,861.68 | 1.38 |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 14,152,295.00 | 1.31 |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 12,441,797.86 | 1.15 |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 12,335,455.96 | 1.14 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 11,854,255.00 | 1.10 |
| 17 | 600390 | 五矿资本 | 9,902,697.00 | 0.92 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 8,385,100.00 | 0.78 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 7,572,114.00 | 0.70 |
| 20 | 600016 | 民生银行 | 6,448,119.00 | 0.60 |

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 | 601318 | 中国平安 | 69,873,245.42 | 6.47 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 38,165,507.62 | 3.54 |
| 3 | 601998 | 中信银行 | 25,871,451.48 | 2.40 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 24,862,396.00 | 2.30 |
| 5 | 601997 | 贵阳银行 | 22,829,315.29 | 2.11 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 22,606,759.04 | 2.09 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 19,486,364.35 | 1.81 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 17,353,402.50 | 1.61 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 17,332,724.15 | 1.61 |
| 10 | 601229 | 上海银行 | 16,466,873.40 | 1.53 |
| 11 | 601009 | 南京银行 | 16,353,891.22 | 1.51 |
| 12 | 601688 | 华泰证券 | 16,186,436.00 | 1.50 |
| 13 | 600919 | 江苏银行 | 15,259,974.06 | 1.41 |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 15,137,788.00 | 1.40 |
| 15 | 600015 | 华夏银行 | 14,912,296.11 | 1.38 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 14,131,535.12 | 1.31 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 14,097,244.80 | 1.31 |
| 18 | 600000 | 浦发银行 | 13,105,173.10 | 1.21 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 12,428,841.00 | 1.15 |
| 20 | 600016 | 民生银行 | 12,013,174.33 | 1.11 |

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 | 416,843,159.09 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 552,818,161.99 |

买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未进行债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未进行债券投资。

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

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核算业务细则(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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资.

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

2018年1月18日,银监会四川监管局对上海浦东发展银行股份有限公司成都分行作出行政处罚决定,对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46,175万元人民币。此外,对成都分行原行长、2名副行长、1名部门负责人和1名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。

2018年2月12日,中国银监会行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕4号)显示,浦发银行存在(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;(四)理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等十九条违法违规事实,中国银监会对其罚款5,845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5,855.927万元;兴业银行股份有限公司于2018年4月19日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监银罚决字〔2018〕1号),兴业银行因(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规等12项违法违规事实被银保监会罚款5,870万元;招商银行股份有限公司于2018年2月12日收到中国银监会行政处罚决定书(银监罚决字〔2018〕1号),招商银行因(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本等等14项违法违规事实被银保监会罚款6,570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6,573.024万元。

对浦发银行、兴业银行、招商银行投资决策程序的说明:浦发银行作为中证800金融指数的成分股,其指数权重为3.37%;信诚中证800金融分级基金作为指数基金,理应按照指数权重进行投资。组合投资于该股票的权重约为3.95%,未发现投资决策异常。兴业银行和招商银行作为中证800金融指数的成分股,公司对兴业银行和招商银行有长期的跟踪研究,处罚事项也不对公司的企业经营和投资价值产生实质性影响。另外,基金经理在筛选标的时参考量化指标,控制其在基金中占比,也考虑了意外风险,我们认为投资策略没有问题。

除此之外,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 | 92,421.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,182.61 |
| 5 | 应收申购款 | 28,534.37 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 129,138.26 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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 | 机构投资者 持有份额 | 机构投资者 占总份额比例 | 个人投资者 持有份额 | 个人投资者 占总份额比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 信诚中证800金融指数分级A | 388 | 1,112,092.71 | 387,499,888.00 | 89.80% | 43,992,082.00 | 10.20% |
| 信诚中证800金融指数分级B | 13995 | 30,831.87 | 19,566,902.00 | 4.53% | 411,925,069.00 | 95.47% |
| 信诚中证800金融指数分级 | 8821 | 5,671.05 | 4,496,890.00 | 8.99% | 45,527,455.15 | 91.01% |
| 合计 | 23204 | 39,347.02 | 411,563,680.00 | 45.08% | 501,444,606.15 | 54.92% |

注:本表列示"占总份额比例"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800金融指数分级A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红 | 98,551,267.00 | 22.84% |
| 2 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品 | 80,593,777.00 | 18.68% |
| 3 | 中国银河证券股份有限公司 | 61,360,150.00 | 14.22% |
| 4 | 中意人寿保险有限公司 | 55,760,357.00 | 12.92% |
| 5 | 民生加银基金-广州农商银行-中信证券股份有限公司 | 26,133,064.00 | 6.06% |
| 6 | 新华人寿保险股份有限公司 | 25,348,859.00 | 5.87% |
| 7 | 全国社保基金二一四组合 | 9,300,000.00 | 2.16% |
| 8 | 齐静 | 7,053,001.00 | 1.63% |
| 9 | 郭小农 | 6,000,000.00 | 1.39% |
| 10 | 太平洋资管-工商银行-太平洋卓越七十三号产品 | 4,900,900.00 | 1.14% |

信诚中证800金融指数分级B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 王建乔 | 17,899,123.00 | 4.15% |
| 2 | 陈奉娥 | 12,152,000.00 | 2.82% |
| 3 | 百年人寿保险股份有限公司-分红保险产品 | 10,858,000.00 | 2.52% |
| 4 | 宋伟铭 | 5,155,400.00 | 1.19% |
| 5 | 张美芳 | 5,092,100.00 | 1.18% |
| 6 | 高加林 | 4,048,800.00 | 0.94% |
| 7 | 秦至红 | 3,168,100.00 | 0.73% |
| 8 | 叶宁 | 3,030,800.00 | 0.70% |
| 9 | 邹建 | 3,000,000.00 | 0.70% |
| 10 | 张潭生 | 2,622,800.00 | 0.61% |

信诚中证800金融指数分级

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 刘琳 | 3,931,045.01 | 7.86% |
| 2 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品 | 3,391,527.00 | 6.78% |
| 3 | 张建忠 | 1,729,490.00 | 3.46% |
| 4 | 袁子 | 934,105.10 | 1.87% |
| 5 | 温汴丽 | 627,860.04 | 1.26% |
| 6 | 朱红 | 589,667.59 | 1.18% |
| 7 | 张素平 | 486,548.39 | 0.97% |
| 8 | 李金仙 | 456,320.29 | 0.91% |
| 9 | 李建平 | 451,248.00 | 0.90% |
| 10 | 强锦香 | 432,372.00 | 0.86% |

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800金融指数分级A | - | - |
| | 信诚中证800金融指数分级B | 5,400.00 | - |
| | 信诚中证800金融指数分级 | 49,239.24 | 0.01% |
| | 合计 | 54,639.24 | 0.01% |

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 信诚中证800金融指数分级A | - |
| | 信诚中证800金融指数分级B | - |
| | 信诚中证800金融指数分级 | 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800金融指数分级A | - |
| | 信诚中证800金融指数分级B | - |
| | 信诚中证800金融指数分级 | - |
| | 合计 | - |

期末本基金的基金经理未持有本开放式基金的基金份额。

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800金融指数分级A | 信诚中证800金融指数分级B | 信诚中证800金融指数分级 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日(2013年12月20日)基金份额总额 | 13,253,156.00 | 13,253,157.00 | 236,680,043.17 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 493,241,425.00 | 493,241,426.00 | 72,722,371.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - | 9,657,122.56 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - | - | 155,854,058.91 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | -61,749,455.00 | -61,749,455.00 | 123,498,910.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 431,491,970.00 | 431,491,971.00 | 50,024,345.15 |

拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.本报告期内基金管理人无重大人事变动

2.报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 应支付该券商的佣金 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | 2 | 169,595,309.84 | 17.53% | 157,943.58 | 17.59% | - |
| 申银万国 | 1 | 160,316,722.76 | 16.57% | 149,302.41 | 16.62% | - |
| 天风证券 | 2 | 139,659,248.28 | 14.44% | 129,485.59 | 14.42% | - |
| 西南证券 | 2 | 135,392,653.31 | 14.00% | 126,090.96 | 14.04% | - |
| 招商证券 | 2 | 127,582,679.30 | 13.19% | 118,458.42 | 13.19% | - |
| 广发证券 | 1 | 123,473,594.90 | 12.76% | 114,988.95 | 12.80% | - |
| 宏源证券 | 3 | 71,321,637.07 | 7.37% | 66,421.95 | 7.40% | - |
| 西部证券 | 1 | 25,180,902.90 | 2.60% | 22,947.37 | 2.55% | - |
| 兴业证券 | 2 | 13,714,519.84 | 1.42% | 12,498.02 | 1.39% | - |
| 中信建投 | 2 | 1,056,221.50 | 0.11% | - | - | - |
| 安信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | 本期新增1个交易单元 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | 本期新增1个交易单元 |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西藏东财 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信山东 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信浙江 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联合证券 | 1 | - | - | - | - | 本期退租 |

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 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 回购交易 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 权证交易 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 335,000.00 | 7.24% | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2,053,292.88 | 44.40% | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 87,000.00 | 1.88% | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1,094,659.50 | 23.67% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1,054,900.00 | 22.81% | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东财 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | - | - | - | - | - | - |
| 中信山东 | - | - | - | - | - | - |
| 中信浙江 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 联合证券 | - | - | - | - | - | - |

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

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无 |

中信保诚基金管理有限公司

2018年08月28日