信诚中证信息安全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	信诚中证信息安全指数分级		
场内简称	信息安全		
基金主代码	165523		
交易代码	-	-	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年06月26日		
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	188,780,021.24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	2015年7月15日		
下属分级基金的基金简称	信诚中证信息安全指数分级A	信诚中证信息安全指数分级B	信诚中证信息安全指数分级
下属分级基金的场内简称	信息安A	信息安B	信息安全
下属分级基金的交易代码	150309	150310	165523
报告期末下属分级基金的份额总额	6,143,413.00份	6,143,413.00份	176,493,195.24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,实现对中证信息安全主题指数的有效跟踪,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,即按照标的指数的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,力争将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,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%×中证信息安全主题指数收益率+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	信息安A份额具有预期风险、预期收益较低的特征	信息安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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	haozhou@citicprufunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为"中信保诚基金管理有限公司"。

本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.4信息披露方式

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	-23,859,809.09
本期利润	-21,339,104.31
加权平均基金份额本期利润	-0.1035
本期基金份额净值增长率	-13.61%
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	-0.8127
期末基金资产净值	131,840,534.48
期末基金份额净值	0.698

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。

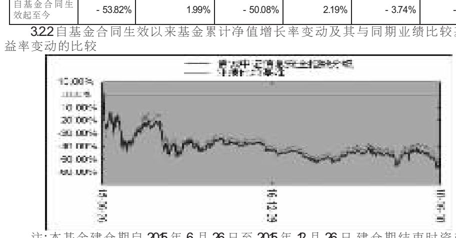
3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-10.40%	2.44%	-11.06%	2.55%	0.66%	-0.11%
过去三个月	-19.03%	1.93%	-18.06%	1.93%	-0.97%	-
过去六个月	-13.61%	2.06%	-12.06%	2.03%	-1.55%	0.03%
过去一年	-9.63%	1.74%	-7.55%	1.72%	-2.08%	0.02%
过去三年	-54.00%	2.00%	-43.97%	2.15%	-10.03%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-53.82%	1.99%	-50.08%	2.19%	-3.74%	-0.20%

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2015年6月26日至2015年12月26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、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		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,兼任量化投资部副总监,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06月26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月加入中信保诚基金管理有限公司,历任量化投资分析师、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。

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《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对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,受美联储加息、中美贸易冲突加剧等事件影响,国内股票市场波动有所加大,整体出现较大幅度回调。上半年上证综指下跌-13.90%,与内需相关的行业的如食品饮料、家用电器、医药生物、休闲服务等行业涨幅较高。

报告期内,本基金坚持既定的指数化投资策略,及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。

4.4.2报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-13.61%,同期业绩比较基准收益率为-12.06%,基金落后业绩比较基准1.55%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受国内外环境影响,国内宏观经济面临较大挑战。2季度实际GDP增长6.7%,较1季度回落0.1%,在结构上出口贡献下降,消费贡献上升;1-6月固定资产投资累计同比6.0%,环比回落0.1%,基建投资持续大幅回落是拖累固定资产投资;上半年社会融资规模呈下降态势,表外融资剧烈萎缩,6月社融同比增速创历史新低。中美贸易冲突持续升级,7月初中美对340亿美元商品互相加征25%关税正式生效。货币政策整体稳健中性,二季度操作上较为友好。

展望下半年,在国内经济面临压力较大的情况下,近期宏观政策出现缓和迹象,去杠杆节奏和力度有所放缓,信用紧张局面得到阶段性缓解。下半年宏观政策对于股票市场影响加大,后续密切关注政策变化以及中美贸易冲突进展。A股市场仍面临较大波动性,预计维持震荡格局下的结构性行情。

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(包括信诚信息安全份额、信诚信息安全A份额、信诚信息安全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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在信诚中证信息安全指数分级证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:信诚中证信息安全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		17,146,116.36	10,157,680.68
结算备付金		-	-
存出保证金		10,069.10	16,494.60
交易性金融资产		114,880,011.46	170,328,844.12
其中:股票投资		114,880,011.46	170,328,844.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		414,358.33	-
应收利息		2,345.56	2,277.73
应收股利		-	-
应收申购款		164,290.92	105,807.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		132,617,191.73	180,611,105.01
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		-	-
应付赎回款		75,695.87	185,114.83
应付管理人报酬		116,019.48	156,070.64
应付托管费		25,524.29	34,335.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		45,515.54	44,000.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		513,902.07	710,327.99
负债合计		776,657.25	1,129,849.40
所有者权益:			
实收基金		285,260,387.21	335,474,659.12
未分配利润		-153,419,852.73	-155,993,403.51
所有者权益合计		131,840,534.48	179,481,255.61
负债和所有者权益总计		132,617,191.73	180,611,105.01

注:截至本报告期末,基金份额总额188,780,021.24份。信诚中证信息安全指数分级的基金份额净值0.698元,基金份额总额176,493,195.24份。下属分级基金:信诚中证信息安全指数分级A的基金份额净值1.026元,基金份额总额6,143,413.00份;信诚中证信息安全指数分级B的基金份额净值0.370元,基金份额总额6,143,413.00份。

6.2利润表

会计主体:信诚中证信息安全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		-19,956,100.17	-21,250,398.90
1.利息收入		37,028.41	59,216.97
其中:存款利息收入		37,028.41	59,207.59
债券利息收入		-	9.38
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)		-22,610,295.16	-18,760,163.79
其中:股票投资收益		-22,916,990.66	-19,196,735.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	11,262.84
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		306,695.50	425,308.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		2,520,704.78	-2,576,397.75
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		96,461.80	26,945.67
减:二、费用		1,383,004.14	1,729,102.48
1. 管理人报酬		811,575.35	1,080,767.73
2. 托管费		178,546.62	237,768.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		128,375.04	101,520.20
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		264,507.13	309,045.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-21,339,104.31	-22,979,501.38
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-21,339,104.31	-22,979,501.38

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚中证信息安全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)	335,474,659.12	-155,993,403.51	179,481,255.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-21,339,104.31	-21,339,104.31
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)	-50,214,271.91	23,912,655.09	-26,301,616.82
其中:1.基金申购款	117,635,097.01	-54,226,515.10	63,408,581.91
2.基金赎回款	-167,849,368.92	78,139,170.19	-89,710,198.73
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)	285,260,387.21	-153,419,852.73	131,840,534.48
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)	436,104,954.44	-188,936,887.20	247,168,067.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,979,501.38	-22,979,501.38
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)	-52,722,170.86	24,461,335.07	-28,260,835.79
其中:1.基金申购款	10,636,001.31	-5,023,792.04	5,612,209.27
2.基金赎回款	-63,358,172.17	29,485,127.11	-33,873,045.06
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)	383,382,783.58	-187,455,053.51	195,927,730.07

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

信诚中证信息安全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[2015]893号《关于准予信诚中证信息安全指数分级证券投资基金注册的批复》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》、《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证信息安全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712,651,869.63元,业经普华永道中天验字(2015)第773号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为712,930,901.63份基金份额,其中认购资金利息折合279,032.00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《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证信息安全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信息安全指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"信诚信息安全份额",基金代码"165523")、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之信诚信息安全A份额(以下简称"信诚信息安全A份额",基金代码"150309")与信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之信诚信息安全B份额(以下简称"信诚信息安全B份额",基金代码"150310")。本基金通过场外、场内两种方式公开发售信诚信息安全份额。投资人场外认购所得的信诚信息安全份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的信诚信息安全份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额。信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,信诚信息安全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,信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内信诚信息安全份额与信诚信息安全A份额和信诚信息安全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份场内信诚信息安全份额按照1:1的份额配比转换成1份信诚信息安全A份额与1份信诚信息安全B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份信诚信息安全A份额与1份信诚信息安全B份额按照1:1的基金份额配比转换成2份场内信诚信息安全份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:信诚信息安全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信息安全份额、信诚信息安全A份额、信诚信息安全B份额数量的总和。本基金每份信诚信息安全A份额与每份信诚信息安全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份信诚信息安全份额的基金份额净值之和。信诚信息安全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%,信诚信息安全A份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算,计算出信诚信息安全A份额的基金份额参考净值后,根据信诚信息安全份额的基金份额净值与信诚信息安全A份额、信诚信息安全B份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出信诚信息安全B份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年12月5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信息安全A份额的基金份额参考净值调整为1.000元,基金份额折算基准日折算前信诚信息安全A份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为场内信诚信息安全份额分配给信诚信息安全A份额持有人。信诚信息安全份额持有人持有的每2份信诚信息安全份额将按1份信诚信息安全A份额获得新增信诚信息安全份额的分配。持有场外信诚信息安全份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外信诚信息安全份额的分配;持有场内信诚信息安全份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内信诚信息安全份额的分配。经过上述份额折算后,信诚信息安全份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额的份额配比保持1:1的比例。信诚信息安全B份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变信诚信息安全B份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外,当信诚信息安全份额的基金份额净值大于或等于1.500元,或当信诚信息安全B份额的基金份额参考净值小于或等于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:份额折算后本基金将确保信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额的比例为1:1,份额折算后信诚信息安全A份额的基金份额参考净值、信诚信息安全B份额的基金份额参考净值和信诚信息安全份额的基金份额净值均调整为1.000元。当信诚信息安全份额的基金份额净值大于或等于1.500元时,基金份额折算基准日折算前信诚信息安全份额的基金份额净值及信诚信息安全A份额、信诚信息安全B份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分均将折算为信诚信息安全份额分别分配给信诚信息安全份额、信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额的持有人。当信诚信息安全B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时,信诚信息安全份额、信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2015]第343号核准,本基金信诚信息安全A份额(150309)63,570,159.00份基金份额与信诚信息安全B份额(150310)63,570,159.00份基金份额于2015年7月15日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的信诚信息安全份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额即可上市流通;对于托管在场外的信诚信息安全份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为信诚信息安全A份额和信诚信息安全B份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》和最新公布的《信诚中证信息安全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,包括中证信息安全主题指数的成份股、备选成份股、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%,投资于中证信息安全主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的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%×中证信息安全主题指数收益率+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》、《信诚中证信息安全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,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算缴纳。

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8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	811,575.35	1,080,767.73
其中:支付销售机构的客户维护费	362,374.61	482,351.78

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	178,546.62	237,768.88

注:支付基金托管人中国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一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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行,本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5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)		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	期末余额	当期利息收入
中国银行	17,146,116.36	36,603.79	16,582,826.19	58,800.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

本基金通过"中国银行基金托管结算资金转用存款账户"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0.00元。(2017年6月30日余额为0.00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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

6.4.9.2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
600485	信威集团	2016年12月27日	重大资产重组	12.89	-	-	398,105	10,187,131.71	5,131,573.45	-
300324	旋极信息	2018年05月30日	重大资产重组	8.37	-	-	167,115	1,952,578.05	1,398,752.55	-
002089	新海宜	2018年04月20日	重大资产重组	6.05	2018年07月20日	5.45	193,100	1,961,631.87	1,168,255.00	-
600764	中国海防	2018年04月16日	重大资产重组	31.77	-	-	31,810	655,839.32	1,010,603.70	-
300229	拓尔思	2018年04月17日	重大资产重组	15.88	2018年07月17日	14.29	37,800	950,775.31	600,264.00	-
300350	华鹏飞	2018年05月10日	重大资产重组	8.13	2018年07月16日	7.32	41,900	392,656.13	340,647.00	-
300561	汇金科技	2018年05月25日	重大资产重组	23.13	2018年07月25日	23.59	9,789	236,263.27	226,419.57	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。截至本报告批准报出日,"信威集团"、"旋极信息"、"中国海防"仍未发布复牌公告。

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,本基金未持有银行间市场因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,本基金未持有交易所市场因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105,003,496.19元,第二层次的余额为9,876,515.27元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次158,755,505.47元,第二层次11,573,338.65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。

(2)除以上事项外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	114,880,011.46	86.63
	其中:股票	114,880,011.46	86.63
	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	17,146,116.36	12.93
7	其他各项资产	591,063.91	0.45
8	合计	132,617,191.73	100.00

7.2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	53,253,821.69	40.39
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	54,812,579.03	41.57
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	1,455,617.72	1.10
S	综合	-	-
	合计	109,522,018.44	83.07

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	5,131,573.45	3.89
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	226,419.57	0.17
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	5,357,993.02	4.06

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(%)
1	002230	科大讯飞	160,162	5,136,395.34	3.90
2	600570	恒生电子	73,700	3,902,415.00	2.96
3	600588	用友网络	141,752	3,474,341.52	2.64
4	002405	四维图新	152,980	3,097,845.00	2.35
5	603019	中科曙光	67,200	3,082,464.00	2.34
6	002049	紫光国微	63,400	2,797,208.00	2.12
7	000977	浪潮信息	115,560	2,756,106.00	2.09
8	000063	中兴通讯	200,027	2,606,351.81	1.98
9	600804	鹏博士	213,700	2,564,400.00	1.95
10	002065	东华软件	281,364	2,419,730.40	1.84

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	600485	信威集团	398,105	5,131,573.45	3.89
2	300561	汇金科技	9,789	226,419.57	0.17

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	601360	三六零	2,484,313.00	1.38
2	002230	科大讯飞	1,016,729.00	0.57
3	002212	南洋股份	1,015,059.00	0.57
4	002268	卫士通	747,980.04	0.42
5	603660	苏州科达	595,808.00	0.33
6	603160	汇顶科技	555,141.00	0.31
7	002530	金财互联	515,200.80	0.29
8	002912	中新赛克	506,840.00	0.28
9	000063	中兴通讯	472,790.00	0.26
10	600776	东方通信	467,493.00	0.26
11	002049	紫光国微	454,244.00	0.25
12	300010	立思辰	451,994.00	0.25
13	600570	恒生电子	394,402.00	0.22
14	600588	用友网络	382,175.00	0.21
15	600410	华胜天成	374,220.00	0.21
16	002405	四维图新	353,249.00	0.20
17	603019	中科曙光	319,610.00	0.18
18	600584	长电科技	284,825.00	0.16
19	600460	士兰微	276,597.00	0.15
20	300017	网宿科技	265,975.00	0.15

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	002230	科大讯飞	2,172,672.00	1.21
2	600570	恒生电子	2,058,861.00	1.15
3	002405	四维图新	1,846,860.20	1.03
4	600588	用友网络	1,732,622.15	0.97
5	600804	鹏博士	1,600,063.00	0.89
6	603019	中科曙光	1,573,955.00	0.88
7	000063	中兴通讯	1,480,775.97	0.83
8	600584	长电科技	1,417,323.15	0.79
9	600100	同方股份	1,373,871.00	0.77
10	002065	东华软件	1,283,695.00	0.72
11	000977	浪潮信息	1,267,446.00	0.71
12	300017	网宿科技	1,252,218.77	0.70
13	002465	海格通信	1,168,308.00	0.65
14	600498	烽火通信	1,140,836.00	0.64
15	002049	紫光国微	1,098,317.77	0.61
16	000066	中国长城	1,017,796.00	0.57
17	600118	中国卫星	986,212.00	0.55
18	002439	启明星辰	945,344.00	0.53
19	300182	捷成股份	860,059.00	0.48
20	002383	合众思壮	848,053.00	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	19,261,686.28
卖出股票收入(成交)总额	54,314,233.06

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

本基金本报告期末,未持有债券。

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

本基金本报告期末,未持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

本基金本报告期初及报告期内均未持有股指期货投资。

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

中兴通讯股份有限公司和全资子公司深圳市中兴康讯电子有限公司(以下合称"中兴通讯")已与BIS达成《替代的和解协议》(以下简称"协议")以替代中兴通讯于2017年3月与BIS达成的《和解协议》。BIS已于2018年6月8日(美国时间)通过《关于中兴通讯的替代命令》(以下简称"2018年6月8日命令")批准协议立即生效。根据协议,中兴通讯将支付合计14亿美元民事罚款,包括在BIS签发2018年6月8日命令后60日内一次性支付10亿美元,以及在BIS签发2018年6月8日命令后90日内支付至由中兴通讯选择、经BIS批准的美国银行托管账户并在监察期内暂缓的额外的4亿美元罚款(监察期内若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和2018年6月8日命令,监察期届满后4亿美元罚款将被豁免支付)。在中兴通讯根据协议和2018年6月8日命令及时全额支付10亿美元及将额外的4亿美元支付至美国银行托管账户后,BIS将终止其于2018年4月15日(美国时间)激活的拒绝令并将中兴通讯从《禁止出口人员清单》中移除。如果上述条件均满足且中兴通讯已从《禁止出口人员清单》中移除,BIS将对外公布。协议还包括更换中兴通信全部董事会成员、现任高级副总裁及以上所有的高层领导等主要条款。

对中兴通讯投资决策说明:中兴通讯作为中证信息安全指数的成分股,其指数权重分别为0.45%和2.31%;信诚中证信息安全分级基金为指数基金,理应按照指数权重进行投资。组合投资于该股票的权重分别约为0.452%和2.148%,未发现投资决策异常。

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不存在超出基金合同规定的备选股票。

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	10,069.10
2	应收证券清算款	414,358.33
3	应收股利	-
4	应收利息	2,345.56
5	应收申购款	164,290.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	591,063.91

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,持有的指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	5,131,573.45	3.89	重大事项停牌
2	300561	汇金科技	226,419.57	0.17	拟筹划重大资产重组

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
信诚中证信息安全指数分级A	93	66,058.20	668,091.00	10.87%	5,475,322.00	89.13%
信诚中证信息安全指数分级B	396	15,513.67	30,002.00	0.49%	6,113,411.00	99.51%
信诚中证信息安全指数分级	6551	26,941.41	1,312,024.08	0.74%	175,181,171.16	99.26%
合计	7040	26,815.34	2,010,117.08	1.06%	186,769,904.16	98.94%

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

信诚中证信息安全指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	丁碧霞	1,762,474.00	28.69%
2	李怡名	1,702,179.00	27.71%
3	郑志坤	1,575,274.00	25.64%
4	德邦基金-浙商银行-百年人寿保险-百年人寿保险股份有限公司-	497,900.00	8.10%
5	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	92,135.00	1.50%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	78,027.00	1.27%
7	高静芬	48,161.00	0.78%
8	贾洪燕	24,078.00	0.39%
9	濮秀芬	18,060.00	0.29%
10	安辉	16,072.00	0.26%

信诚中证信息安全指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	叶亮	803,900.00	13.09%
2	王念东	300,000.00	4.88%
3	何利	250,913.00	4.08%
4	王芳	244,400.00	3.98%
5	周胜成	149,135.00	2.43%
6	姜东	148,400.00	2.42%
7	贾稳鹏	139,000.00	2.26%
8	樊林婷	117,000.00	1.90%
9	张国鑫	115,088.00	1.87%
10	徐洪文	101,200.00	1.65%

信诚中证信息安全指数分级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	叶婵娟	5,097,626.40	2.89%
2	薛巧云	3,970,779.79	2.25%
3	郑岚	2,239,413.00	1.27%
4	王美兰	1,984,880.42	1.12%
5	冯月珍	1,466,960.35	0.83%
6	李倩	1,323,569.02	0.75%
7	邵淑君	1,323,509.45	0.75%
8	刘保军	1,323,271.25	0.75%
9	李志平	1,322,794.84	0.75%
10	华泰紫金鼎锦上添花子集合资产管理计划	1,226,925.08	0.70%

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	信诚中证信息安全指数分级A	-	-
	信诚中证信息安全指数分级B	-	-
	信诚中证信息安全指数分级	246,094.97	0.14%
	合计	246,094.97	0.13%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信诚中证信息安全指数分级A	-
	信诚中证信息安全指数分级B	-
	信诚中证信息安全指数分级	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚中证信息安全指数分级A	-
	信诚中证信息安全指数分级B	-
	信诚中证信息安全指数分级	-
	合计	-

注:期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.5发起式基金发起资金持有份额情况

无

§9开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证信息安全指数分级A	信诚中证信息安全指数分级B	信诚中证信息安全指数分级
基金合同生效日(2015年06月26日)基金份额总额	63,570,159.00	63,570,159.00	585,790,583.63
本报告期期初基金份额总额	7,056,344.00	7,056,344.00	207,897,272.62
本报告期基金总申购份额	-	-	77,849,280.76
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	111,079,220.14
本报告期基金拆分变动份额	-912,931.00	-912,931.00	1,825,862.00
本报告期期末基金份额总额	6,143,413.00	6,143,413.00	176,493,195.24

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。

§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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	37,847,576.96	51.44%	34,490.95	51.07%	本期新增1个交易单元
东方证券	1	23,995,547.04	32.61%	22,347.44	33.09%	-
安信证券	1	8,939,583.34	12.15%	8,146.79	12.06%	-
中信建投	2	2,793,212.00	3.80%	2,545.47	3.77%	本期减少1个交易单元
大通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	本期新增
广州证券	2	-	-	-	-	本期新增
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	本期新增

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

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。

§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