信诚中证500指数分级证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018年12月31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:2019年03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2019年3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。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§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02月11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	161,887,338.06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	2011-03-14		
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	21,462,632.00份	32,193,949.00份	108,230,757.06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 A分额具有低风险、收益相对稳定的特征。	信诚中证500 B分额具有较高风险、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。

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	田甫
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tianqing1.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	田国立

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

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-74,523,695.24	8,217,351.69	-59,522,820.01
本期利润	-77,333,399.78	11,870,163.81	-83,453,148.07
加权平均基金份额本期利润	-0.3594	0.0529	-0.2941
本期加权平均净值利润率	-32.31%	4.15%	-24.92%
本期基金份额净值增长率	-29.48%	4.74%	-11.17%
3.1.2期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	5,598,496.33	99,172,418.48	82,212,823.74
期末可供分配基金份额利润	0.0346	0.4134	0.3858
期末基金资产净值	143,631,528.33	306,247,919.95	263,859,920.24
期末基金份额净值	0.887	1.277	1.238
3.1.3累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	9.83%	55.75%	48.71%

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。

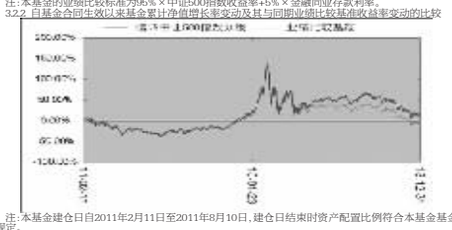
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-11.12%	1.64%	-12.51%	1.74%	1.39%	-0.10%
过去六个月	-17.41%	1.44%	-19.14%	1.50%	1.73%	-0.06%
过去一年	-29.48%	1.39%	-31.84%	1.43%	2.36%	-0.04%
过去三年	-34.39%	1.41%	-43.32%	1.43%	8.93%	-0.02%
过去五年	34.66%	1.75%	9.64%	1.71%	25.02%	0.04%
自基金合同生效起至今	9.83%	1.61%	-9.94%	1.61%	19.77%	-

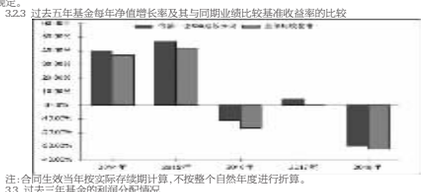
注:本基金的业绩比较标准为95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金建仓日自2011年2月11日至2011年8月10日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	本基金本期未分红
2017	-	-	-	-	本基金本期未分红
2016	-	-	-	-	本基金本期未分红
合计	-	-	-	-	本基金最近三年未进行利润分配

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。

§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2006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明约公告。

截至2018年12月31日,本基金管理人管理的运作中基金为65只,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、中信保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)、信诚金砖四国标股配置证券投资基金(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、信诚沪深500指数分级证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金、信诚优势精选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(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、信诚深证成指分级证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚新金宝货币市场基金、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、信诚新阳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)、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证信息安全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、信诚中证800有色指数分级证券投资基金(LOF)、信诚中证500医药卫生指数分级证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金、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)、信诚中证800医药指数分级证券投资基金(LOF)、信诚中证500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)、信诚新能源灵活配置混合型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚新活力灵活配置混合型证券投资基金、信诚新沪深300指数分级证券投资基金、信诚新动力