# 信诚中证 TMT 产业主题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TMT产业主题指数分级 | |
| 场内简称 | 信诚TMT | |
| 基金主代码 | 165522 | |
| 交易代码 | - | - |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年11月28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 | 187,082,009.53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12月22日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚中证TMT产业主题指数分级A | 信诚中证TMT产业主题指数分级B |
| 下属分级基金的场内简称 | TMT中证A | TMT中证B |
| 下属分级基金的交易代码 | 150173 | 150174 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,166,902.00份 | 19,166,902.00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TMT产业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 | 本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在标的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%。<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TMT产业主题指数收益率+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 | TMT中证A份额具有预期风险、预期收益较低的特征 | TMT中证B份额具有预期风险、预期收益较高的特征<br>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 |

注:本基金管理人法定名称于2017年12月8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 | -21,080,645.04 |
| 本期利润 | -41,025,262.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1152 |
| 本期基金份额净值增长率 | -15.00% |
| 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 | -1.1446 |
| 期末基金资产净值 | 191,359,184.63 |
| 期末基金份额净值 | 1.023 |

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.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。

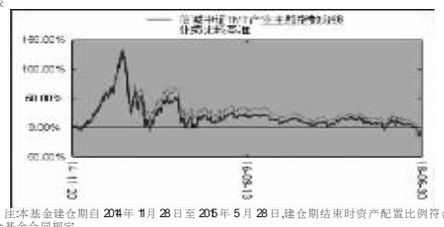
3.2基金净值表现

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 | -9.90% | 2.21% | -10.94% | 2.22% | 1.04% | -0.01% |
| 过去三个月 | -18.72% | 1.70% | -19.12% | 1.70% | 0.40% | - |
| 过去六个月 | -15.00% | 1.75% | -15.70% | 1.73% | 0.70% | 0.02% |
| 过去一年 | -17.39% | 1.46% | -17.82% | 1.46% | 0.43% | - |
| 过去三年 | -44.41% | 2.15% | -44.68% | 1.94% | 0.27% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.27% | 2.22% | -3.82% | 2.04% | -5.45% | 0.18% |

注:本基金的业绩比较标准为:95%×中证TMT产业主题指数收益率+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2014年11月28日至2015年5月28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8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、信诚新锐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。

4.12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,蓝筹权益投资副总监,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、信诚鼎利灵活配置混合基金、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、信诚鼎利灵活配置混合基金、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02月05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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理。 |
| 黄雅 | 本基金的基金经理助理,信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚沪深300指数分级证券投资基金的基金经理助理。 | 2016年07月01日 | - | 6 | 理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司,担任资产管理部产品经理;于平安证券有限责任公司,担任产品经理。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司,担任金融工程师,现任信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚沪深300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的基金经理助理。 |

注:1.还任职日期,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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证TMT产业主题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-8.90%,与内需相关的行业如食品饮料、家用电器、医药生物、休闲服务等行业涨幅较高。

报告期内,本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上,利用数量化方法构建投资组合进行指数化投资,实现对标的指数的有效跟踪。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值。

4.4.2报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-15.00%,同期比较基准收益率为-15.70%,基金超越业绩比较基准0.70%。

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;16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,表外融资萎缩拖累明显,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,二季度维持上较为友好。

展望下半年,在国内经济面临压力较大的情况下,近期宏观政策出现较和迹象,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

4.6.1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TMT份额、信诚TMTA份额和信诚TMTB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TMT产业主题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 | | 12,424,084.29 | 16,716,286.99 |
| 结算备付金 | | 16,656.15 | 9,254.85 |
| 存出保证金 | | 20,789.69 | 32,529.87 |
| 交易性金融资产 | | 181,130,414.65 | 280,977,507.36 |
| 其中:股票投资 | | 181,130,414.65 | 280,770,407.36 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 207,100.00 |
| 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 | | 10,957,631.90 | - |
| 应收利息 | | 5,377.83 | 3,527.52 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 138,018.18 | 83,659.33 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 204,692,972.69 | 297,822,765.92 |
| 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 | | - | 6,713.47 |
| 应付赎回款 | | 12,416,965.80 | 295,646.46 |
| 应付管理人报酬 | | 193,067.12 | 255,214.27 |
| 应付托管费 | | 42,474.76 | 56,147.14 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 71,291.40 | 205,948.83 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 609,988.98 | 721,017.14 |
| 负债合计 | | 13,333,788.06 | 1,540,687.31 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 210,847,721.59 | 277,487,725.94 |
| 未分配利润 | | -19,488,536.96 | 18,794,352.67 |
| 所有者权益合计 | | 191,359,184.63 | 296,282,078.61 |
| 负债和所有者权益总计 | | 204,692,972.69 | 297,822,765.92 |

注:截止本报告期末,信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之基础份额净值为1.023元,信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之中证TMTA份额净值为1.001元,信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之中证TMTB份额净值为1.045元;基金份额总额为187,082,009.53份,其中信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之基础份额为148,748,205.53份,信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之中证TMTA份额为19,166,902.00份,信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之中证TMTB份额为19,166,902.00份。

6.2利润表

会计主体:信诚中证TMT产业主题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 | | -38,844,941.26 | -4,991,624.94 |
| 1.利息收入 | | 62,489.68 | 169,564.59 |
| 其中:存款利息收入 | | 62,395.77 | 63,444.05 |
| 债券利息收入 | | 93.91 | 106,120.54 |
| 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) | | -19,173,956.77 | -50,634,831.25 |
| 其中:股票投资收益 | | -20,116,396.27 | -51,471,068.05 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 31,138.15 | - |
| 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 | | 911,301.35 | 836,236.80 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -19,944,617.35 | 45,346,374.18 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 211,143.18 | 127,267.54 |
| 减:二、费用 | | 2,180,321.13 | 3,820,651.58 |
| 1.管理人报酬 | | 1,310,593.01 | 1,868,002.07 |
| 2.托管费 | | 288,330.46 | 410,960.48 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 257,218.30 | 1,216,977.36 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | 0.35 | - |
| 7.其他费用 | | 324,179.01 | 324,711.67 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -41,025,262.39 | -8,812,276.52 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -41,025,262.39 | -8,812,276.52 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚中证TMT产业主题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) | 277,487,725.94 | 18,794,352.67 | 296,282,078.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -41,025,262.39 | -41,025,262.39 |
| 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) | -66,640,004.35 | 2,742,372.76 | -63,897,631.59 |
| 其中:1.基金申购款 | 34,630,331.11 | 1,276,730.50 | 35,907,061.61 |
| 2.基金赎回款 | -101,270,335.46 | 1,465,642.26 | -99,804,693.20 |
| 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) | 210,847,721.59 | -19,488,536.96 | 191,359,184.63 |

| 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) | 376,601,849.61 | 47,089,413.29 | 423,691,262.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -8,812,276.52 | -8,812,276.52 |
| 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) | -69,889,227.06 | -8,204,288.09 | -78,093,515.15 |
| 其中:1.基金申购款 | 26,784,917.72 | 2,928,661.28 | 29,713,579.00 |
| 2.基金赎回款 | -96,674,144.78 | -11,132,949.37 | -107,807,094.15 |
| 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) | 306,712,622.55 | 30,072,848.68 | 336,785,471.23 |

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:

吕海 陈逸平 刘乐

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TMT产业主题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[2014]81号《关于核准信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2014]123号《关于信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》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TMT产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证TMT产业主题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286,658,897.43元,业经普华永道中天验字(2014)第79号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金合同》于2014年11月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为286,752,222.32份基金份额,其中认购资金利息折合93,374.89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TMT产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金之基础份额》(以下简称"信诚TMT份额",基金代码"165522")、信诚中证TMT指数分级证券投资基金之信诚TMTA份额(以下简称"信诚TMTA份额",基金代码"150173")与信诚中证TMT指数分级证券投资基金之信诚TMTB份额(以下简称"信诚TMTB份额",基金代码"150174"),本基金通过场外、场内两种方式公开发售信诚TMT份额。投资人场外认购所得的信诚TMT份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的信诚只能家居份额份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为信诚TMTA份额和信诚TMTB份额。信诚TMTA份额和信诚TMTB份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,信诚TMT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TMTA份额和信诚TMTB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TMT份额与信诚TMTA份额和信诚TMTB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1份场内信诚TMT份额按照1:1的份额配比转换成1份信诚TMTA份额与1份信诚TMTB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TMTA份额与1份信诚TMTB份额按照1:1的基金份额配比转换成2份场内信诚TMT份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:信诚TMT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TMT份额、信诚TMTA份额、信诚TMTB份额数量的总和。本基金每份信诚TMTA份额与每份信诚TMTB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TMT份额的基金份额净值之和。信诚TMTA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TMTA份额的基金份额净值以1000元为基础,采用信诚TMTA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TMTA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TMTA份额的基金份额净值后,根据信诚TMT份额的基金份额净值与信诚TMTA份额、信诚TMTB份额之间的基金份额净值关系,可以计算出信诚TMTB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TMTA份额的基金份额净值调整为1000元,基金份额折算日折算前信诚TMTA份额的基金份额净值超出1000元的部分将折算为信诚TMT份额的场内份额分配给信诚TMTA份额持有人。信诚TMT份额持有人持有的每两份信诚TMT份额将按一份信诚TMTA份额获得新增信诚TMT份额的分配,经过上述份额折算后,信诚TMT份额的基金份额净值将相应调整。信诚TMTB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TMT份额的基金份额净值大于或等于1500元;当信诚TMTB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TMTA份额和信诚TMTB份额的比例仍保持1:1不变,份额折算后信诚TMT份额、信诚TMTA份额和信诚TMTB份额的基金份额净值均调整为1000元。当信诚TMT份额的基金份额净值大于或等于1500元时,基金份额折算日折算前信诚TMT份额、信诚TMTA份额和信诚TMTB份额的基金份额净值超出1000元的部分均将折算为信诚TMT份额分别分配给信诚TMT份额、信诚TMTA份额和信诚TMTB份额的持有人。当信诚TMTB份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,信诚TMT份额、信诚TMTA份额和信诚TMTB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")采证上字[2014]第472号文审核同意,本基金信诚TMTA份额(150173)10,003.00份基金份额和信诚TMTB份额(150174)10,003.00份基金份额于2014年12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转托管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TMT产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和最新公布的《信诚中证TMT产业主题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,包括股票、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TMT产业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TMT产业主题指数收益率+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TMT产业主题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