

## 信诚新兴产业混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：信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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 28 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

### 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	2
§ 2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
§ 4 管理人报告 .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
§ 5 托管人报告 .....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	11
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	14
§ 7 投资组合报告 .....	30
7.1 期末基金资产组合情况 .....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	40
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	42
§ 8 基金份额持有人信息 .....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
§ 9 开放式基金份额变动 .....	43
§ 10 重大事件揭示 .....	43
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
§ 12 备查文件目录 .....	46
12.1 备查文件名称 .....	46
12.2 备查文件存放地点 .....	47
12.3 备查文件查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚新兴产业混合型证券投资基金
基金简称	信诚新兴产业混合
场内简称	-
基金主代码	000209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 17 日
基金管理人	信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	16,084,018.89 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于新兴产业的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,力求超额收益与长期资本增值
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在大类资产配置过程中,将优先考虑对于股票类资产的配置,在采取精选策略构造股票组合的基础上,将剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产上。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1)行业配置策略</p> <p>本基金的行业配置,首先是基于以上对新兴产业的定义确定属于新兴产业的行业,并且,随着技术和经济的发展动态调整新兴产业的范围。本基金将研究社会发展趋势、经济发展趋势、科学技术发展趋势、消费者需求变化趋势,根据行业景气状况,新兴技术、新兴生产模式以及新兴商业模式等的成熟度,在充分考虑估值的原则下,实现不同行业的资产配置。重点配置于那些核心技术和模式适宜于大规模生产、产品符合市场趋势变化、具有较强带动作用、得到国家政策支持并且估值合理的子行业。</p> <p>(2)个股精选策略</p> <p>本基金在进行新兴产业相关行业个股筛选时,主要从定性和定量两个角度对行业内上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理</p>

	<p>内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p>
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。属于较高风险、较高收益的品种。

### 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		信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	hao.zhou@xcfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张翔燕	田国立

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信诚基金管理有限公司	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

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层
--------	---------------------	------------------------

### § 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(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,239,727.30
本期利润	-2,164,937.02
加权平均基金份额本期利润	-0.1366
本期加权平均净值利润率	-8.63%
本期基金份额净值增长率	-8.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,841,600.86
期末可供分配基金份额利润	0.4254
期末基金资产净值	24,280,914.82
期末基金份额净值	1.510
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.00%

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。

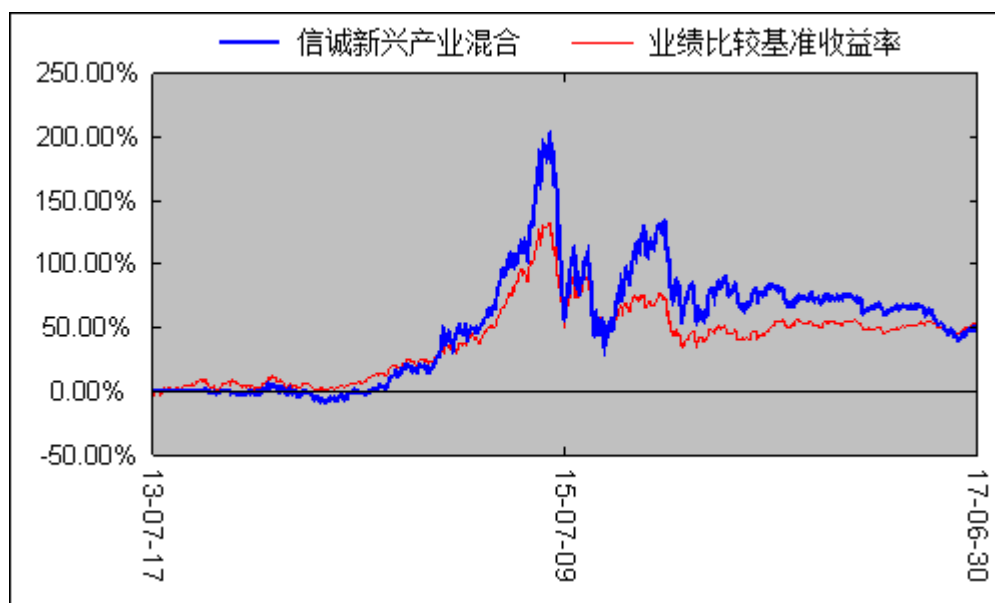
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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	6.41%	0.84%	6.36%	0.60%	0.05%	0.24%
过去三个月	-6.09%	0.95%	1.50%	0.64%	-7.59%	0.31%
过去六个月	-8.71%	0.86%	4.30%	0.59%	-13.01%	0.27%
过去一年	-16.94%	0.93%	5.09%	0.65%	-22.03%	0.28%
过去三年	52.68%	2.32%	46.14%	1.61%	6.54%	0.71%
自基金合同生效起至今	51.00%	2.08%	54.69%	1.50%	-3.69%	0.58%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:1、本基金建仓期自 2013 年 7 月 17 日至 2014 年 1 月 17 日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自 2015 年 10 月 1 日起, 本基金的业绩比较基准由“中证新兴产业指数收益率\*80%+中信标普全债指数收益率\*20%”变更为“中证新兴产业指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%”。

## § 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

本基金管理人信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%。截至 2017 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 70 只基金, 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、信诚经典优债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、信诚添金分级债券型证券投资基金、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、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、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、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、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、信诚中证建设工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚至益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、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、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫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、信诚主题轮动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、信诚永鑫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、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、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、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信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		
郑伟	本基金基金经理、信诚深度价值混合基金 (LOF)、信诚中小盘混合基金基金经理	2013 年 8 月 16 日	-	11	经济学硕士。曾任职于华泰资产管理有限公司，担任研究员。2009 年 8 月加入信诚基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理。现任信诚深度价值混合基金 (LOF)、信诚新兴产业混合基金和信诚中小盘混合基金基金经理。

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《信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同》、《信诚新兴产业混合型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 2017 年上半年,A 股市场在经历年初回调后逐步企稳,一季度持续震荡上涨,其中消费相关行业(如家用电器、食品饮料)以及基建投资相关行业(钢铁、建材、建筑等)表现较好。在二季度,A 股市场经历了一个探底回升的过程。各板块走势分化明显,绝对估值较低的家电、食品饮料、汽车、医药生物等消费板块在 4、5 月份继续强势上涨,而中小成长股板块表现不佳。首先,从经济基本面看,全球经济延续复苏态势,出口保持平稳增长。国内消费整体保持稳定。投资方面,基础设施建设明显放缓。通货膨胀整体压力不大,工业品价格震荡向下带动 PPI 环比转负,CPI 温和回升保持平稳。第二,从监管力度来看,4 月份市场关注的焦点集中在金融监管。银监会连发多文,全方位多角度加强银行监管,监管力度超出市场预期;同时证监会对高送转股票、次新股、雄安主题股的监管力度较强。4 月份 A 股市场震荡和中小盘股票承压。随后监管阶段性有所放松,新股发行放缓,减持新规的出台、A 股加入 MSCI 等都对市场风险偏好有提振作用。第三,外围压力有所降低。特朗普政策持续低于市场预期,美元指数走低,外汇储备有所上升。随着人民币贬值压力基本释放,外部流动性将会出现明显改善。

本基金适度控制股票仓位,一方面优选受益于政策和改革的行业、未来成长空间较大的行业和投资标的;另一方面,采用主动量化方法在新兴产业中优选个股,综合考量市场运行规律及个股盈利性、成长性及估值等因素选择投资标的,并通过分散持仓来控制系统风险。

##### 4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-8.71%,同期业绩比较基准收益率为 4.30%,基金落后业绩比较基准 13.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年,房地产和基建投资虽然有所回落,但目前仍处于高位,制造业投资弱企稳,外部经济的复苏有助于拉动出口,预计经济运行整体平稳,微观经济结构将继续优化。货币政策仍将保持高度灵活性,流动性短期内难以宽松。

我们对 A 股市场基本判断为将呈现整体震荡结构型行情,市场关注方向可能从绝对估值较低的蓝筹板块转向高业绩成长板块,具有真实确定性成长性的股票未来可能受到市场青睐,部分市场热点也存在交易性机会。

未来本基金将重点配置新能源产业链、消费电子、医药和高端装备领域。同时我们认为新兴产业和军工板块,价格已经出现扭曲,受益于改革持续推进的军工板块、代表新经济的计算机、传媒板块将逐步进入配置时点,将会择机择优配置

#### 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最严格的控制。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 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有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格。

## 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

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 25%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本报告期内未进行过利润分配,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,本基金自 2015 年 6 月 30 日起至 2017 年 6 月 30 日止基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## § 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”)在对信诚新兴产业混合型证券投资基金(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: 信诚新兴产业混合型证券投资基金

报告截止日: 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,588,009.73	5,841,184.50
结算备付金		249,463.23	110,401.94
存出保证金		17,186.03	14,194.56
交易性金融资产	6.4.7.2	19,642,541.28	20,559,561.57
其中: 股票投资		19,642,541.28	20,559,561.57
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	670,954.64
应收利息	6.4.7.5	914.74	1,043.70
应收股利		-	-
应收申购款		34,679.80	2,292.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		24,532,794.81	27,199,633.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	160,409.96
应付赎回款		1,158.47	192.83
应付管理人报酬		29,008.47	34,504.34

应付托管费		4,834.75	5,750.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	97,119.91	58,913.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,758.39	130,000.73
负债合计		251,879.99	389,772.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	16,084,018.89	16,208,439.43
未分配利润	6.4.7.10	8,196,895.93	10,601,421.54
所有者权益合计		24,280,914.82	26,809,860.97
负债和所有者权益总计		24,532,794.81	27,199,633.47

注：截至本报告期末，基金份额净值 1.51 元，基金份额总额 16,084,018.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚新兴产业混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-1,574,059.45	-8,220,408.82
1. 利息收入		19,599.89	17,419.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,970.43	17,419.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,629.46	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,669,991.99	-5,026,227.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,777,780.71	-5,091,440.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	107,788.72	65,213.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	74,790.28	-3,225,240.69

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,542.37	13,639.61
<b>减：二、费用</b>		590,877.57	530,251.99
1. 管理人报酬		186,514.77	246,623.40
2. 托管费		31,085.76	41,103.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	341,364.40	195,581.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	31,912.64	46,943.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,164,937.02	-8,750,660.81
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,164,937.02	-8,750,660.81

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚新兴产业混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6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）	16,208,439.43	10,601,421.54	26,809,860.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,164,937.02	-2,164,937.02
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）	-124,420.54	-239,588.59	-364,009.13
其中：1. 基金申购款	1,292,028.77	623,717.26	1,915,746.03
2. 基金赎回款	-1,416,449.31	-863,305.85	-2,279,755.16
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）	16,084,018.89	8,196,895.93	24,280,914.82
项目	上年度可比期间		

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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）	16,883,230.98	21,934,129.29	38,817,360.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,750,660.81	-8,750,660.81
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）	1,548,952.84	1,902,488.16	3,451,441.00
其中：1. 基金申购款	7,842,131.46	6,762,347.77	14,604,479.23
2. 基金赎回款	-6,293,178.62	-4,859,859.61	-11,153,038.23
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）	18,432,183.82	15,085,956.64	33,518,140.46

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

信诚新兴产业混合型证券投资基金（原“信诚新兴产业股票型证券投资基金”）（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”）《关于核准信诚新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]723号文）和《关于信诚新兴产业股票型证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2013]578号文）批准，由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》及其配套规则和《信诚新兴产业股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2013年7月17日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为信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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚新兴产业股票型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，自2015年8月3日起，本基金名称变更为“信诚新兴产业混合型证券投资基金”，基金类别变更为“混合型”，同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。

本基金于2013年6月17日至2013年7月12日期间通过销售机构公开发售，扣除认购费后的有效认购资金287,450,235.50元，利息转份额31,778.77元，募集规模为287,482,014.27份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所验证，并出具了普华永道中天验字(2013)第458号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同》和《信诚新兴产业混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支

持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,基金的投资组合比例为: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 60%-95%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 60%,其中投向新兴产业上市公司的比例不低于非现金基金资产的 80%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的 0-40%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证不超过基金资产净值的 3%。

本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### 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。

##### 6.4.4.1 会计年度

##### 6.4.4.2 记账本位币

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

##### 6.4.4.7 实收基金

##### 6.4.4.8 损益平准金

##### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 6.4.4.10 费用的确认和计量

##### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

##### 6.4.4.12 分部报告

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

#### 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25% 计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。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) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	4,588,009.73
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	4,588,009.73

注:其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产



单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,184,755.02	19,642,541.28	457,786.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	19,184,755.02	19,642,541.28	457,786.26

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			备注
		公允价值		
	合同/名义 金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

本基金于本报告期末,未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末,未持有任何买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末,未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	806.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	100.99

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.93
合计	914.74

注：其他指应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末, 未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	97,119.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,119.91

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.80
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	104,878.20
合计	119,758.39

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,208,439.43	16,208,439.43
本期申购	1,292,028.77	1,292,028.77
本期赎回(以“-”号填列)	-1,416,449.31	-1,416,449.31
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	16,084,018.89	16,084,018.89

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	9,265,305.11	1,336,116.43	10,601,421.54
本期利润	-2,239,727.30	74,790.28	-2,164,937.02
本期基金份额交易产生的变动数	-183,976.95	-55,611.64	-239,588.59
其中：基金申购款	603,840.46	19,876.80	623,717.26
基金赎回款	-787,817.41	-75,488.44	-863,305.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,841,600.86	1,355,295.07	8,196,895.93

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
活期存款利息收入	16,329.27	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,505.89	
其他	135.27	
合计	17,970.43	

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
卖出股票成交总额	113,104,794.87	
减：卖出股票成本总额	114,882,575.58	
买卖股票差价收入	-1,777,780.71	

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
申购差价收入	-

#### 6.4.7.12.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期未进行贵金属投资。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	107,788.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	107,788.72

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	74,790.28
——股票投资	74,790.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	74,790.28

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	1,266.37
转换费收入	276.00
合计	1,542.37

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	341,364.40
银行间市场交易费用	-
合计	341,364.40

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	14,878.20
银行费用	2,158.05
合计	31,912.64

#### 6.4.7.20 分部报告

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人

#### 6.4.10 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。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

##### 6.4.10.1.3 债券交易

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	186,514.77	246,623.40
其中:支付销售机构的客户维护费	95,747.77	124,697.77

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,085.76	41,103.93

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

#### 6.4.10.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。本基金的基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未投资过本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末	上年度末
	2017年6月30日	2016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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
-	-	-	-	-

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。本基金其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6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	4,588,009.73	16,329.27	2,821,577.58	16,248.06

注：本基金通过“中国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2017年6月30日的相关余额为人民币249,463.23元。（2016年6月30日余额为79,055.02元）

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券类别	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

#### 6.4.12.2 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
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项停牌	10.33	2017-08-02	11.36	3,450	37,563.00	35,638.50	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组停牌	17.02	2017-07-12	16.68	1,300	25,330.10	22,126.00	-
300322	硕贝德	2017-02-23	重大资产重组停牌	17.02	2017-08-07	15.32	300	5,340.00	5,106.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-

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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。



本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

于本报告期末,本基金未持有债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流

动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位:人民币元

上年度末 2016年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	6个月以内	3个月 -1年	6个月到1 年	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产									
资产总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债									
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,588,009.73	-	-	-	-	-	4,588,009.73
结算备付金	249,463.23	-	-	-	-	-	249,463.23
存出保证金	17,186.03	-	-	-	-	-	17,186.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,642,541.28	19,642,541.28
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收利息						914.74	914.74
应收股利						-	-
应收申购款						34,679.80	34,679.80
待摊费用						-	-
其他应收款						-	-
资产总计	4,854,658.99					19,678,135.82	24,532,794.81
负债							
卖出回购金融资产款						-	-
应付证券清算款						-	-
应付赎回款						1,158.47	1,158.47
应付管理人报酬						29,008.47	29,008.47
应付托管费						4,834.75	4,834.75
应付销售服务费						-	-
应付交易费用						97,119.91	97,119.91
应交税费						-	-
应付利息						-	-
应付利润						-	-
其他负债						119,758.39	119,758.39
负债总计						251,879.99	251,879.99
利率敏感度缺口	4,854,658.99					19,426,255.83	24,280,914.82

上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,841,184.50	-	-	-	-	-	5,841,184.50
结算备付金	110,401.94	-	-	-	-	-	110,401.94
存出保证金	14,194.56	-	-	-	-	-	14,194.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	20,559,561.57	20,559,561.57
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	670,954.64	670,954.64
应收利息	-	-	-	-	-	1,043.70	1,043.70
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,292.56	2,292.56
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,965,781.00	-	-	-	-	21,233,852.47	27,199,633.47
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	160,409.96	160,409.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	192.83	192.83

应付管理人报酬	-	-	-	-	34,504.34	34,504.34
应付托管费	-	-	-	-	5,750.72	5,750.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	58,913.92	58,913.92
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	130,000.73	130,000.73
负债总计	-	-	-	-	389,772.50	389,772.50
利率敏感度缺口	5,965,781.00	-	-	-	20,844,079.97	26,809,860.97

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	假设		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
-	-	-	-

本基金于期末及上年度末，未持有债券等受利率波动明显的金融资产，因此可认为市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	19,642,541.28	80.90	20,559,561.57	76.69
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-

金属投资				
衍生金融资产-权证投资				
其他				
合计	19,642,541.28	80.90	20,559,561.57	76.69

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	1,280,482.55	1,467,381.78
业绩比较基准中的股票指数下降5%	-1,280,482.55	-1,467,381.78	

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
假设	2. -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	-	-	-

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	19,642,541.28	80.07
	其中：股票	19,642,541.28	80.07
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	4,837,472.96	19.72
7	其他各项资产	52,780.57	0.22
8	合计	24,532,794.81	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	140,254.00	0.58
B	采矿业	150,516.00	0.62
C	制造业	14,851,198.18	61.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	565,815.00	2.33
E	建筑业	541,251.00	2.23
F	批发和零售业	517,138.60	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	183,820.00	0.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	877,720.50	3.61
J	金融业	310,823.00	1.28
K	房地产业	797,799.00	3.29
L	租赁和商务服务业	130,131.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	122,510.00	0.50
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	298,231.00	1.23
S	综合	155,334.00	0.64
	合计	19,642,541.28	80.90

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002635	安洁科技	16,300	590,386.00	2.43
2	300136	信维通信	13,600	544,272.00	2.24
3	002411	必康股份	18,300	529,236.00	2.18
4	300115	长盈精密	17,400	507,732.00	2.09
5	002456	欧菲光	25,500	463,335.00	1.91
6	002501	利源精制	37,000	420,690.00	1.73
7	002241	歌尔股份	20,900	402,952.00	1.66
8	002475	立讯精密	12,800	374,272.00	1.54
9	601231	环旭电子	20,000	314,200.00	1.29
10	002466	天齐锂业	5,600	304,360.00	1.25
11	002460	赣锋锂业	6,300	291,375.00	1.20
12	002108	沧州明珠	19,850	264,997.50	1.09
13	002448	中原内配	26,000	263,380.00	1.08
14	002415	海康威视	8,100	261,630.00	1.08
15	002019	亿帆医药	12,300	205,164.00	0.84
16	002087	新野纺织	35,800	202,270.00	0.83
17	002074	国轩高科	6,400	201,920.00	0.83
18	000404	华意压缩	23,900	188,093.00	0.77
19	002672	东江环保	11,100	187,479.00	0.77
20	300296	利亚德	9,700	182,360.00	0.75
21	002450	康得新	7,500	168,900.00	0.70
22	300265	通光线缆	13,200	167,640.00	0.69
23	600053	九鼎投资	4,300	150,328.00	0.62
24	002304	洋河股份	1,700	147,577.00	0.61
25	002408	齐翔腾达	13,100	145,148.00	0.60
26	002007	华兰生物	3,800	138,700.00	0.57

27	002230	科大讯飞	3,200	127,680.00	0.53
28	600380	健康元	14,000	127,120.00	0.52
29	600409	三友化工	12,400	124,868.00	0.51
30	002051	中工国际	6,000	124,380.00	0.51
31	300113	顺网科技	4,500	121,050.00	0.50
32	002078	太阳纸业	16,400	120,540.00	0.50
33	600597	光明乳业	9,300	118,575.00	0.49
34	601233	桐昆股份	8,300	115,038.00	0.47
35	002048	宁波华翔	5,500	114,730.00	0.47
36	000541	佛山照明	12,300	112,053.00	0.46
37	600067	冠城大通	16,100	110,607.00	0.46
38	002142	宁波银行	5,700	110,010.00	0.45
39	601801	皖新传媒	7,900	109,178.00	0.45
40	002002	鸿达兴业	13,900	108,837.00	0.45
41	600503	华丽家族	15,300	105,723.00	0.44
42	002185	华天科技	14,400	104,256.00	0.43
43	002285	世联行	11,900	95,438.00	0.39
44	002594	比亚迪	1,900	94,905.00	0.39
45	002366	台海核电	2,000	93,820.00	0.39
46	002673	西部证券	6,500	92,430.00	0.38
47	600175	美都能源	21,000	91,350.00	0.38
48	002008	大族激光	2,500	86,600.00	0.36
49	600183	生益科技	6,800	83,912.00	0.35
50	002146	荣盛发展	8,500	83,895.00	0.35
51	002308	威创股份	6,400	83,520.00	0.34
52	002736	国信证券	6,300	83,475.00	0.34
53	603766	隆鑫通用	11,400	82,992.00	0.34
54	600267	海正药业	7,100	82,928.00	0.34
55	002202	金风科技	5,300	81,991.00	0.34
56	002217	合力泰	8,200	81,016.00	0.33
57	000997	新大陆	3,500	79,415.00	0.33
58	600216	浙江医药	8,000	79,280.00	0.33
59	600487	亨通光电	2,800	78,540.00	0.32
60	000547	航天发展	7,500	78,375.00	0.32
61	600639	浦东金桥	4,200	76,104.00	0.31
62	600176	中国巨石	6,900	75,762.00	0.31
63	600292	远达环保	7,000	75,460.00	0.31
64	600856	中天能源	6,700	75,442.00	0.31
65	600872	中炬高新	4,100	75,030.00	0.31
66	002680	长生生物	4,900	74,921.00	0.31
67	600422	昆药集团	6,600	74,844.00	0.31



68	002407	多氟多	3,400	74,766.00	0.31
69	002271	东方雨虹	2,000	74,200.00	0.31
70	603808	歌力思	2,500	73,800.00	0.30
71	002092	中泰化学	5,800	73,660.00	0.30
72	002126	银轮股份	7,300	73,438.00	0.30
73	603818	曲美家居	4,600	73,278.00	0.30
74	002507	涪陵榨菜	6,513	73,206.12	0.30
75	300026	红日药业	15,500	73,005.00	0.30
76	002540	亚太科技	10,300	72,718.00	0.30
77	600079	人福医药	3,700	72,594.00	0.30
78	603338	浙江鼎力	1,100	72,523.00	0.30
79	300237	美晨科技	4,200	72,492.00	0.30
80	300182	捷成股份	7,500	71,700.00	0.30
81	002068	黑猫股份	8,500	71,485.00	0.29
82	600633	浙数文化	3,700	71,484.00	0.29
83	600312	平高电气	5,200	71,448.00	0.29
84	000739	普洛药业	9,700	71,198.00	0.29
85	002281	光迅科技	3,200	71,104.00	0.29
86	600323	瀚蓝环境	4,900	71,099.00	0.29
87	601311	骆驼股份	5,000	70,800.00	0.29
88	300203	聚光科技	2,500	70,300.00	0.29
89	603898	好莱客	2,000	69,900.00	0.29
90	002717	岭南园林	2,600	69,680.00	0.29
91	002121	科陆电子	8,100	69,660.00	0.29
92	600635	大众公用	12,600	68,670.00	0.28
93	000952	广济药业	4,500	67,635.00	0.28
94	600975	新五丰	10,300	65,920.00	0.27
95	000031	中粮地产	8,700	65,511.00	0.27
96	600995	文山电力	6,700	65,191.00	0.27
97	600889	南京化纤	6,800	64,532.00	0.27
98	002707	众信旅游	4,900	64,337.00	0.26
99	300130	新国都	3,400	64,226.00	0.26
100	000609	绵石投资	4,300	63,984.00	0.26
101	600969	郴电国际	4,500	63,900.00	0.26
102	600081	东风科技	5,100	63,495.00	0.26
103	600306	商业城	4,600	63,250.00	0.26
104	002452	长高集团	9,200	63,204.00	0.26
105	002065	东华软件	2,900	63,191.00	0.26
106	000789	万年青	8,900	63,101.00	0.26
107	300395	菲利华	4,300	62,995.00	0.26
108	603968	醋化股份	2,800	62,888.00	0.26

109	002357	富临运业	6,000	62,880.00	0.26
110	000421	南京公用	8,600	62,780.00	0.26
111	600368	五洲交通	10,800	62,532.00	0.26
112	002165	红宝丽	10,100	62,519.00	0.26
113	600644	乐山电力	8,200	62,238.00	0.26
114	600697	欧亚集团	2,200	61,952.00	0.26
115	000411	英特集团	2,800	61,264.00	0.25
116	002533	金杯电工	8,100	61,236.00	0.25
117	600052	浙江广厦	12,100	61,105.00	0.25
118	300390	天华超净	6,500	59,605.00	0.25
119	300420	五洋科技	7,200	59,472.00	0.24
120	002310	东方园林	3,500	58,520.00	0.24
121	300356	光一科技	6,700	58,357.00	0.24
122	002405	四维图新	2,900	57,304.00	0.24
123	002465	海格通信	5,200	55,848.00	0.23
124	002615	哈尔斯	4,900	55,370.00	0.23
125	002340	格林美	9,100	55,055.00	0.23
126	600511	国药股份	1,500	54,360.00	0.22
127	000685	中山公用	4,900	53,655.00	0.22
128	002242	九阳股份	2,700	53,109.00	0.22
129	002414	高德红外	2,900	53,070.00	0.22
130	002701	奥瑞金	8,100	51,759.00	0.21
131	000661	长春高新	400	51,644.00	0.21
132	002081	金螳螂	4,700	51,606.00	0.21
133	002491	通鼎互联	3,800	51,072.00	0.21
134	600260	凯乐科技	2,000	50,680.00	0.21
135	600525	长园集团	3,700	50,283.00	0.21
136	600073	上海梅林	5,198	49,640.90	0.20
137	600094	大名城	6,400	49,088.00	0.20
138	002573	清新环境	2,500	47,050.00	0.19
139	002385	大北农	7,300	45,917.00	0.19
140	002315	焦点科技	1,800	44,892.00	0.18
141	600392	盛和资源	3,400	44,846.00	0.18
142	002437	誉衡药业	6,052	44,058.56	0.18
143	600611	大众交通	7,900	43,608.00	0.18
144	002479	富春环保	3,600	42,840.00	0.18
145	000581	威孚高科	1,600	41,440.00	0.17
146	000501	鄂武商A	2,210	40,796.60	0.17
147	002027	分众传媒	2,900	39,904.00	0.16
148	300202	聚龙股份	2,400	39,648.00	0.16
149	002482	广田集团	4,400	39,556.00	0.16

150	600335	国机汽车	3,300	39,468.00	0.16
151	600282	南钢股份	10,600	39,326.00	0.16
152	600201	生物股份	1,100	39,127.00	0.16
153	600259	广晟有色	1,000	39,040.00	0.16
154	002444	巨星科技	2,500	38,950.00	0.16
155	002179	中航光电	1,230	38,363.70	0.16
156	600329	中新药业	2,100	38,031.00	0.16
157	000860	顺鑫农业	1,900	38,019.00	0.16
158	601699	潞安环能	4,800	37,536.00	0.15
159	600348	阳泉煤业	5,500	37,290.00	0.15
160	603369	今世缘	2,800	36,960.00	0.15
161	002470	金正大	4,900	36,897.00	0.15
162	002727	一心堂	2,000	36,800.00	0.15
163	600395	盘江股份	5,000	36,650.00	0.15
164	600557	康缘药业	2,200	36,542.00	0.15
165	001696	宗申动力	4,800	36,336.00	0.15
166	300043	星辉娱乐	4,400	36,124.00	0.15
167	002368	太极股份	1,300	35,997.00	0.15
168	600757	长江传媒	4,800	35,856.00	0.15
169	002663	普邦股份	6,600	35,838.00	0.15
170	000596	古井贡酒	700	35,665.00	0.15
171	002013	中航机电	3,450	35,638.50	0.15
172	002595	豪迈科技	1,600	35,568.00	0.15
173	002277	友阿股份	5,500	35,475.00	0.15
174	002195	二三四五	4,930	35,249.50	0.15
175	002440	闰土股份	2,300	35,098.00	0.14
176	002221	东华能源	3,200	34,912.00	0.14
177	600108	亚盛集团	8,000	34,480.00	0.14
178	002354	天神娱乐	1,600	34,400.00	0.14
179	002637	赞宇科技	3,200	34,240.00	0.14
180	603328	依顿电子	2,400	33,960.00	0.14
181	600862	中航高科	3,500	33,915.00	0.14
182	600059	古越龙山	3,600	33,300.00	0.14
183	002587	奥拓电子	4,400	33,176.00	0.14
184	601789	宁波建工	6,800	33,116.00	0.14
185	600740	山西焦化	4,700	33,088.00	0.14
186	002001	新和成	1,700	32,997.00	0.14
187	601678	滨化股份	4,700	32,665.00	0.13
188	002548	金新农	2,700	32,616.00	0.13
189	002106	莱宝高科	3,200	32,416.00	0.13
190	002508	老板电器	740	32,175.20	0.13

191	002004	华邦健康	4,100	32,103.00	0.13
192	002294	信立泰	900	32,094.00	0.13
193	002038	双鹭药业	1,100	32,065.00	0.13
194	603001	奥康国际	1,700	31,943.00	0.13
195	600184	光电股份	1,700	31,892.00	0.13
196	002063	远光软件	3,000	31,260.00	0.13
197	000635	英力特	1,800	30,510.00	0.13
198	600328	兰太实业	2,600	30,264.00	0.12
199	002410	广联达	1,600	30,080.00	0.12
200	600218	全柴动力	3,300	29,667.00	0.12
201	002394	联发股份	2,000	29,460.00	0.12
202	600880	博瑞传播	4,500	29,385.00	0.12
203	300047	天源迪科	2,300	29,003.00	0.12
204	002709	天赐材料	700	28,819.00	0.12
205	002266	浙富控股	5,900	28,792.00	0.12
206	002085	万丰奥威	1,480	28,786.00	0.12
207	002187	广百股份	2,300	28,681.00	0.12
208	002152	广电运通	3,450	28,669.50	0.12
209	600327	大东方	3,500	28,665.00	0.12
210	600268	国电南自	4,600	28,382.00	0.12
211	002030	达安基因	1,300	28,327.00	0.12
212	002439	启明星辰	1,500	27,900.00	0.11
213	603020	爱普股份	1,900	27,664.00	0.11
214	002624	完美世界	800	27,440.00	0.11
215	002311	海大集团	1,500	27,405.00	0.11
216	002191	劲嘉股份	2,900	27,144.00	0.11
217	600551	时代出版	1,700	26,843.00	0.11
218	002489	浙江永强	4,200	26,796.00	0.11
219	002104	恒宝股份	2,822	26,498.58	0.11
220	002183	怡亚通	3,000	25,890.00	0.11
221	002570	贝因美	1,900	25,840.00	0.11
222	002375	亚厦股份	2,900	25,839.00	0.11
223	002739	万达电影	500	25,485.00	0.10
224	002292	奥飞娱乐	1,500	25,350.00	0.10
225	002299	圣农发展	1,700	25,279.00	0.10
226	002153	石基信息	1,100	25,003.00	0.10
227	002500	山西证券	2,600	24,908.00	0.10
228	002223	鱼跃医疗	1,050	24,864.00	0.10
229	002422	科伦药业	1,500	24,780.00	0.10
230	002273	水晶光电	1,200	24,756.00	0.10
231	002022	科华生物	1,400	24,318.00	0.10

232	002224	三力士	2,100	23,310.00	0.10
233	002276	万马股份	2,200	22,198.00	0.09
234	002358	森源电气	1,300	22,126.00	0.09
235	002161	远望谷	2,700	21,870.00	0.09
236	600765	中航重机	1,500	20,670.00	0.09
237	002023	海特高新	2,000	20,540.00	0.08
238	002657	中科金财	700	20,293.00	0.08
239	600298	安琪酵母	700	18,109.00	0.07
240	600586	金晶科技	3,500	17,115.00	0.07
241	300199	翰宇药业	1,100	16,874.00	0.07
242	002284	亚太股份	1,500	16,650.00	0.07
243	600300	维维股份	3,100	16,554.00	0.07
244	600879	航天电子	1,878	16,507.62	0.07
245	000417	合肥百货	2,000	16,500.00	0.07
246	600284	浦东建设	1,500	16,080.00	0.07
247	603806	福斯特	500	16,005.00	0.07
248	600195	中牧股份	800	15,512.00	0.06
249	002463	沪电股份	3,400	15,470.00	0.06
250	002029	七匹狼	1,600	15,312.00	0.06
251	300039	上海凯宝	2,100	15,267.00	0.06
252	600596	新安股份	1,800	15,210.00	0.06
253	600628	新世界	1,300	15,015.00	0.06
254	601880	大连港	5,000	14,800.00	0.06
255	002041	登海种业	1,100	14,575.00	0.06
256	600039	四川路桥	3,400	14,144.00	0.06
257	002010	传化智联	900	13,734.00	0.06
257	600594	益佰制药	900	13,734.00	0.06
258	600720	祁连山	1,700	13,311.00	0.05
259	002327	富安娜	1,600	13,296.00	0.05
260	002123	梦网荣信	1,100	12,221.00	0.05
261	600522	中天科技	500	6,025.00	0.02
262	300322	硕贝德	300	5,106.00	0.02
263	603636	南威软件	300	3,642.00	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	600223	鲁商置业	1,512,931.00	5.64
2	002415	海康威视	1,244,973.25	4.64
3	002353	杰瑞股份	1,218,119.00	4.54

4	002172	澳洋科技	1,165,821.82	4.35
5	000039	中集集团	1,043,907.91	3.89
6	600761	安徽合力	1,041,871.00	3.89
7	002241	歌尔股份	979,497.00	3.65
8	002126	银轮股份	909,727.60	3.39
9	002144	宏达高科	878,312.08	3.28
10	300046	台基股份	865,636.38	3.23
11	600810	神马股份	832,324.82	3.10
12	002538	司尔特	817,720.00	3.05
13	300121	阳谷华泰	812,733.00	3.03
14	000976	春晖股份	805,233.00	3.00
15	002245	澳洋顺昌	798,744.00	2.98
16	000425	徐工机械	794,388.00	2.96
17	000756	新华制药	789,517.00	2.94
18	002055	得润电子	789,331.66	2.94
19	300241	瑞丰光电	777,457.94	2.90
20	300136	信维通信	768,863.47	2.87
21	000880	潍柴重机	760,053.00	2.83
22	600677	航天通信	750,269.00	2.80
23	002589	瑞康医药	744,791.22	2.78
24	002501	利源精制	724,601.91	2.70
25	002593	日上集团	723,893.17	2.70
26	002475	立讯精密	723,042.00	2.70
27	000567	海德股份	706,927.51	2.64
28	600148	长春一东	699,843.00	2.61
29	000915	山大华特	681,394.00	2.54
30	600566	济川药业	681,139.00	2.54
31	600641	万业企业	680,407.00	2.54
32	002456	欧菲光	663,514.00	2.47
33	600476	湘邮科技	650,792.14	2.43
34	002404	嘉欣丝绸	615,914.94	2.30
35	600731	湖南海利	606,953.68	2.26
36	002285	世联行	594,409.31	2.22
37	600889	南京化纤	550,403.00	2.05
38	300210	森远股份	544,628.00	2.03
39	002108	沧州明珠	541,276.00	2.02
40	600963	岳阳林纸	540,774.00	2.02
41	300220	金运激光	538,576.00	2.01
42	600686	金龙汽车	538,460.00	2.01

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	000811	烟台冰轮	1,629,496.80	6.08
2	600223	鲁商置业	1,477,483.93	5.51
3	002094	青岛金王	1,382,420.26	5.16
4	002353	杰瑞股份	1,370,871.00	5.11
5	300084	海默科技	1,293,573.84	4.82
6	601989	中国重工	1,267,530.00	4.73
7	002172	澳洋科技	1,158,023.00	4.32
8	600576	万家文化	1,141,090.16	4.26
9	000039	中集集团	1,122,982.00	4.19
10	002684	猛狮科技	1,121,494.00	4.18
11	002415	海康威视	1,070,863.00	3.99
12	600761	安徽合力	1,056,983.00	3.94
13	002599	盛通股份	1,009,856.31	3.77
14	000425	徐工机械	905,556.00	3.38
15	002519	银河电子	901,126.22	3.36
16	002126	银轮股份	843,485.20	3.15
17	600372	中航电子	843,290.00	3.15
18	002144	宏达高科	840,124.31	3.13
19	300046	台基股份	834,779.16	3.11
20	000333	美的集团	833,825.00	3.11
21	000756	新华制药	818,735.35	3.05
22	002245	澳洋顺昌	818,026.00	3.05
23	600305	恒顺醋业	806,524.00	3.01
24	000887	中鼎股份	803,470.00	3.00
25	600856	中天能源	799,468.00	2.98
26	600343	航天动力	796,109.20	2.97
27	002425	凯撒文化	795,014.00	2.97
28	002055	得润电子	793,369.00	2.96
29	000976	春晖股份	785,644.00	2.93
30	600482	中国动力	785,395.76	2.93
31	002468	申通快递	763,751.00	2.85
32	002534	杭锅股份	750,840.00	2.80
33	000880	潍柴重机	749,568.00	2.80
34	002588	史丹利	742,007.00	2.77
35	300241	瑞丰光电	739,154.98	2.76
36	300316	晶盛机电	738,958.00	2.76
37	300121	阳谷华泰	731,713.01	2.73
38	600677	航天通信	725,585.00	2.71
39	600691	阳煤化工	724,525.00	2.70

40	600810	神马股份	720,149.00	2.69
41	002538	司尔特	717,133.00	2.67
42	603808	歌力思	715,833.20	2.67
43	002589	瑞康医药	711,611.20	2.65
44	600476	湘邮科技	684,843.20	2.55
45	600566	济川药业	677,600.00	2.53
46	600641	万业企业	656,809.60	2.45
47	000915	山大华特	648,265.00	2.42
48	000567	海德股份	640,582.74	2.39
49	002593	日上集团	636,742.00	2.38
50	002404	嘉欣丝绸	633,705.00	2.36
51	002241	歌尔股份	601,157.33	2.24
52	600148	长春一东	600,468.00	2.24
53	600731	湖南海利	592,901.44	2.21
54	300322	硕贝德	572,037.00	2.13
55	600523	贵航股份	567,599.00	2.12
56	600686	金龙汽车	562,917.00	2.10
57	002146	荣盛发展	553,836.00	2.07
58	300349	金卡智能	551,382.00	2.06
59	600501	航天晨光	550,212.65	2.05

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	113,890,765.01
卖出股票收入（成交）总额	113,104,794.87

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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所有资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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**

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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**

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有权证。

**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**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	-
股指期货投资本期收益(元)				-	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-	-

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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

**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**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)			-		
国债期货投资本期收益(元)			-		
国债期货投资本期公允价值变动(元)			-		

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 本基金投资的前十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 本基金投资的前十名股票中,没有超过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	17,186.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	914.74
5	应收申购款	34,679.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,780.57

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-

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 期末前十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
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

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
1,311	12,268.51	-	-	16,084,018.89	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,968.33	0.04%

### 8.3 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

- 1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金的基金份额。
- 2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年7月17日)基金份额总额	287,482,014.27
本报告期期初基金份额总额	16,208,439.43
本报告期基金总申购份额	1,292,028.77
减:本报告期基金总赎回份额	1,416,449.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	16,084,018.89

## § 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、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	
国信证券	1	110,606,952.56	48.73%	100,796.62	48.43%	-
招商证券	2	53,845,836.67	23.72%	49,070.42	23.58%	-
中信证券	1	53,032,469.49	23.36%	49,390.57	23.73%	-
东方证券	1	7,638,686.46	3.37%	7,113.89	3.42%	-
中信建投	2	1,871,614.70	0.82%	1,743.21	0.84%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

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	
国信证券	-	-	-	-	-	-	
招商证券	-	-	-	-	-	-	
中信证券	-	-	2,500,000.00	100.00%	-	-	
东方证券	-	-	-	-	-	-	
中信建投	-	-	-	-	-	-	
安信证券	-	-	-	-	-	-	

大通证券	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-05
3	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华信证券为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-07
4	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-02-23
5	信诚新兴产业混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-03-01
6	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-03-07
7	关于旗下部分基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-04-17
8	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-04-22
9	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-04-27
10	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵州华阳众惠基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-04-27

11	信诚基金管理有限公司关于旗下信诚新兴产业混合型证券投资基金增加安信证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-05-18
12	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧财富管理有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-05-18
13	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-06-27
14	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-06-30

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件名称

- 1、(原)信诚新兴产业股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
- 3、信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同

4、信诚新兴产业混合型证券投资基金招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--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。

### 12.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 [www.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日