

信诚中证 500 指数分级证券投资基金
2020 年年度报告

2020 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

报告送出日期：2021 年 03 月 26 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 2021 年 03 月 25 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 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	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9	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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	审计报告	13
6.1	审计报告基本信息	13
6.2	审计报告的基本内容	13
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	18
§ 8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3	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	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	58

8.6	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.....	59
8.7	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.....	59
8.8	报告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.....	59
8.9	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.....	59
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12	投资组合报告附注	60
§ 9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	期末上市基金前十名持有人	61
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4	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情况	63
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 10	开放式基金份额变动	63
§ 11	重大事件揭示	64
11.1	基金份额持有人大会决议	64
11.2	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	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4	基金投资策略的改变	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8	其他重大事件	68
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1	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	75
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13	备查文件目录	75
13.1	备查文件目录	75
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§ 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	133,346,992.28 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 年 03 月 14 日		
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	10,183,436.00 份	15,275,155.00 份	107,888,401.28 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	<p>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%。</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</p>

	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 500A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	信诚中证 500B 份额具有高风险、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。

注:2021 年 1 月 1 日,《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效,基金名称变更为“中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)”。2021 年 1 月 4 日,信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500 B 份额终止上市。

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	李申
	联系电话	021-68649788	021-60637102
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637111
传真		021-50120888	021-60635778
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	中国证券报
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
------------	---------------

2.5 其他相关资料

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 号东方广场毕马威大楼八层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	51,902,045.27	22,882,717.28	-74,523,695.24
本期利润	60,169,088.72	47,997,609.63	-77,333,399.78
加权平均基金份额本期利润	0.3514	0.2666	-0.3594
本期加权平均净值利润率	27.18%	25.46%	-32.31%
本期基金份额净值增长率	33.77%	30.50%	-29.48%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	65,050,934.10	34,669,277.96	5,598,496.33
期末可供分配基金份额利润	0.4878	0.1618	0.0346
期末基金资产净值	198,664,997.23	242,843,281.26	143,631,528.33
期末基金份额净值	1.490	1.134	0.887
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	91.73%	43.33%	9.83%

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

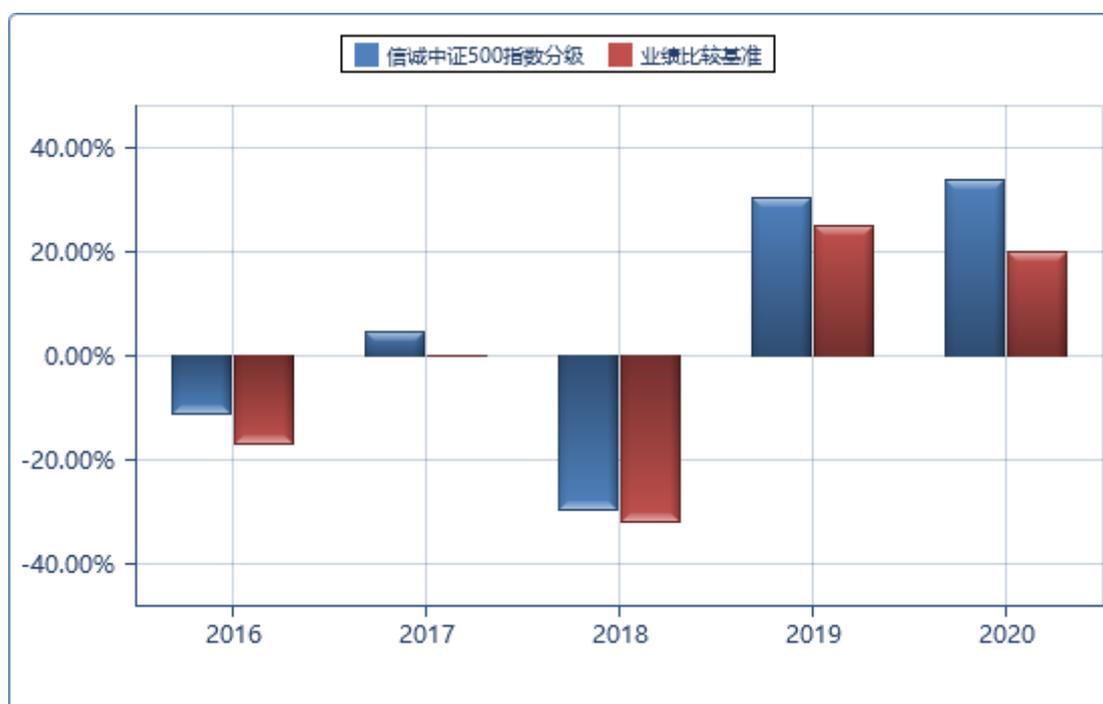
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.08%	1.10%	2.70%	1.10%	2.38%	0.00%
过去六个月	16.04%	1.35%	8.20%	1.38%	7.84%	-0.03%
过去一年	33.77%	1.51%	19.94%	1.54%	13.83%	-0.03%
过去三年	23.10%	1.42%	2.29%	1.46%	20.81%	-0.04%
过去五年	14.53%	1.41%	-14.94%	1.44%	29.47%	-0.03%
自基金合同生	91.73%	1.58%	35.16%	1.58%	56.57%	0.00%

效起至今					
------	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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



3.2.3 过去五年/自基金合同生效/自基金转型以来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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§ 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。

2020 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中基金为 74 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、中信保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）、中信保诚景华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、信诚中证建筑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）、中信保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、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保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、中信保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、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、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、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智慧金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月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、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄稚	本基金基金经理	2018 年 07 月	-	9	理学硕士。曾任职于中

		25 日			<p>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,历任金融工程师、基金经理助理。现任信诚中证 500 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、信诚中证 TMT 产业主题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、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	------	--	--	---

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 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 500 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 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,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》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,

规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 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。

4.3.3 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 2020 年,受新冠疫情影响,我国经济遭遇了重大挑战。一季度国内经济受疫情冲击呈现断崖式下跌,宏观政策逆周期调控持续发力,流动性维持宽裕,推动国内经济改善。得益于有力的疫情防控,国内复工复产逐步推进,二季度开始经济数据明显好转;海外疫情不断扩散和反复,出口、进口替代也持续拉动国内经济的增长,国内经济逐步回到正常水平。

报告期内,上证指数上涨 13.87%,沪深 300 上涨 27.21%,中证 500 上涨 20.87%,创业板指上涨 64.96%,其中休闲服务、电气设备、食品饮料等行业涨幅居前,而房地产、通信、建筑装饰等行业表现较差。

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数。报告期内,本基金在严格控制指数跟踪偏离的基础上,采用数量化方法构建指数化投资组合,实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对投资者日常申购、赎回,根据市场情况、成分股停复牌等合理安排权益仓位和头寸,有效管理跟踪误差。本基金运用股指期货进行多头套保以提高投资效率,同时,积极参与网下新股申购,以提高基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 33.77%,同期业绩比较基准收益率为 19.94%。

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 2021 年,随着新冠疫苗接种的推进,全球经济活动有望逐步回归正常化,叠加补库存需求推动经济增长,全球复苏将是大概率的事件。在本轮疫情冲击下,海内外供给和需求错配为中国出口产业优化全球竞争格局提供了重大机会,海外复苏还将继续拉动中国经济的外需增长;国内经济复苏和企业盈利修复的趋势将延续,在需求端、制造业投资驱动下,有望和海外复苏形成共振。宏观政策今年大概率将稳步转向,货币政策经过年初宽松窗口后有再度收紧的风险,值得密切关注。

去年在宽松流动性支持下,A股龙头公司估值持续抬升,市场内估值结构分化较为严重,部分

景气度向好的板块和个股当前估值处于历史高位。2021 年 A 股市场整体波动可能加大，我们对于部分高估值权益资产走势相对比较谨慎，未来需要从更长期角度寻找成长空间较大、估值处于合理区间的优质资产。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管规范要求，坚持保护基金份额持有人利益，继续致力于完善公司内部合规与内控机制，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司规章制度建设，完善公司规章制度体系；开展内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作；完成并提交监察稽核定期项目，对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，根据法规要求对董事、高级管理人员、基金经理任免事项进行备案；规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易，维护持有人、本公司和股东的合法权益；严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；开展合规培训、法规咨询、更新法规汇编，对产品、采购与行政合同进行审核；完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规向监管部门进行数据报送并开展日常联络等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强公司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、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，可申请召开估值决策委员会临时会议，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 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二百人)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关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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
报告编号	毕马威华振审字第 2101779 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚中证 500 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的信诚中证 500 指数分级证券投资基金(以下简称“信诚中证 500 基金”)财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了信诚中证 500 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于信诚中证 500 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>信诚中证 500 基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括信诚中证 500 基金 2020 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估信诚中证 500 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非信诚中证 500 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督信诚中证 500 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p>

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对信诚中证 500 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信诚中证 500 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠、叶凯韵
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼八层
审计报告日期	2021 年 03 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	14,275,366.96	15,651,173.35
结算备付金	-	1,714,627.28	2,410,499.66
存出保证金	-	412,634.37	607,352.05
交易性金融资产	7.4.7.2	184,447,974.80	225,307,886.52
其中: 股票投资	-	184,443,374.80	224,861,586.52
债券投资	-	4,600.00	446,300.00
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款	-	10,436.13	-
应收利息	7.4.7.5	1,629.23	3,728.22
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	584,688.76	586,548.61
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计	-	201,447,357.53	244,567,188.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	2,071,386.19	757,377.90
应付管理人报酬	-	166,728.57	199,457.07
应付托管费	-	36,680.30	43,880.57
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	7.4.7.7	125,169.51	193,864.86
应交税费	-	15,093.26	2,156.30
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	367,302.47	527,170.45
负债合计	-	2,782,360.30	1,723,907.15
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	103,568,999.92	169,381,332.50
未分配利润	7.4.7.10	95,095,997.31	73,461,948.76
所有者权益合计	-	198,664,997.23	242,843,281.26
负债和所有者权益总计	-	201,447,357.53	244,567,188.41

注：截止本报告期末，基金份额总额 133,346,992.28 份，信诚中证 500 指数分级的基金份额净值 1.490 元，基金份额总额 107,888,401.28 份。下属分级基金：信诚中证 500 指数分级 A 的基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 10,183,436.00 份；信诚中证 500 指数分级 B 的基金份额净值 1.788 元，基金份额总额 15,275,155.00 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日 至 2019 年 12 月 31 日
一、收入	-	64,290,365.55	52,002,941.18
1. 利息收入	-	100,885.22	113,017.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	100,549.37	112,893.11
债券利息收入	-	335.85	124.47
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	55,489,946.09	26,689,943.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	52,357,913.27	24,295,899.19
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	312,195.61	49,948.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	765,747.57	127,184.46
股利收益	7.4.7.15	2,054,089.64	2,216,911.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	8,267,043.45	25,114,892.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	432,490.79	85,087.61
减：二、费用	-	4,121,276.83	4,005,331.55
1. 管理人报酬	-	2,214,956.35	1,881,845.20
2. 托管费	-	487,290.41	414,005.93
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	922,160.40	1,155,808.14
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 税金及附加	-	2,757.65	439.38
7. 其他费用	7.4.7.19	494,112.02	553,232.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	60,169,088.72	47,997,609.63
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	60,169,088.72	47,997,609.63

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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）	169,381,332.50	73,461,948.76	242,843,281.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	60,169,088.72	60,169,088.72
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）	-65,812,332.58	-38,535,040.17	-104,347,372.75
其中：1. 基金申购款	127,665,003.09	84,635,869.80	212,300,872.89
2. 基金赎回款	-193,477,335.67	-123,170,909.97	-316,648,245.64
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）	103,568,999.92	95,095,997.31	198,664,997.23
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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）	130,666,020.38	12,965,507.95	143,631,528.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	47,997,609.63	47,997,609.63
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）	38,715,312.12	12,498,831.18	51,214,143.30
其中：1. 基金申购款	89,272,088.65	28,601,503.71	117,873,592.36
2. 基金赎回款	-50,556,776.53	-16,102,672.53	-66,659,449.06
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）	169,381,332.50	73,461,948.76	242,843,281.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

唐世春

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中证 500 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”）《关于核准信诚中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可

[2010]1877 号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原“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《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2011 年 2 月 11 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 374,254,300.10 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]第 76 号文审核同意,本基金信诚 500A 份额 10,134,545.00 份及信诚 500B 为 15,201,819.00 份基金份额于 2011 年 3 月 14 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 500 指数分级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,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2021 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》和《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告》,本基金于 2020 年 12 月 31 日终止分级运作,《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效。于 2021 年 1 月 1 日,《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,基金名称由“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)”,取消分级机制,产品类别仍为指数型,存续期为不定期,因此本基金以持续经营为基础编制财务报表。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的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，

以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和指数使用费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金（包括信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额）不进行收益分配。经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 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。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司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，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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	14,275,366.96	15,651,173.35
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	14,275,366.96	15,651,173.35

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	164,781,339.57	184,443,374.80	19,662,035.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	4,600.00	4,600.00	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	4,600.00	4,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		164,785,939.57	184,447,974.80	19,662,035.23
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		213,521,108.70	224,861,586.52	11,340,477.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	446,300.00	446,300.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	446,300.00	446,300.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		213,967,408.70	225,307,886.52	11,340,477.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,368,800.00	-	-	-
IC2106	2,368,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,368,800.00	-	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,047,520.00	-	-	-
IC2003	3,024,120.00	-	-	-
IC2006	1,023,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,047,520.00	-	-	-

注：1、于本期末，本基金持有 2 手中证 500 股指期货 IC2106，合约市值为 2,440,960.00 元，公

允价值变动为 72,160.00 元。

2、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	1,259.47	3,100.64
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	359.34	162.50
应收债券利息	0.42	57.79
应收资产支持证券利息	-	-
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	10.00	407.29
合计	1,629.23	3,728.22

注:其他包括应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	125,169.51	193,864.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	125,169.51	193,864.86

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,702.47	2,070.45
应付审计费	90,000.00	150,000.00
应付信息披露费	220,000.00	320,000.00
应付指数使用费	50,600.00	50,600.00
应付账户维护费	-	4,500.00
合计	367,302.47	527,170.45

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,211,367.86	169,381,332.50
本期申购	19,523,277.48	15,436,393.67
本期赎回（以“-”号填列）	-8,918,974.51	-7,052,010.23
2020 年 02 月 03 日基金拆分/份额折算前	224,815,670.83	177,765,715.94
基金拆分/份额折算调整	4,062,804.13	-
本期申购	144,496,126.38	112,228,609.42
本期赎回（以“-”号填列）	-240,027,609.06	-186,425,325.44
本期末	133,346,992.28	103,568,999.92

注：1、申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2020 年 2 月 3 日为份额折算基准日，对本基金实施定期份额折算。

3、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

		本报告期末		上年度末	
基金代码	基金名称	场内	场外	场内	场外
150028	中证500A	10,183,436.00	-	20,827,212.00	-
150029	中证500B	15,275,155.00	-	31,240,819.00	-
165511	信诚500	8,667,475.00	99,220,926.28	12,365,167.00	149,778,169.86

7.4.7.10 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	34,669,277.96	38,792,670.80	73,461,948.76
本期利润	51,902,045.27	8,267,043.45	60,169,088.72
本期基金份额交易产生的变动数	-21,520,389.13	-17,014,651.04	-38,535,040.17
其中：基金申购款	42,872,790.41	41,763,079.39	84,635,869.80
基金赎回款	-64,393,179.54	-58,777,730.43	-123,170,909.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,050,934.10	30,045,063.21	95,095,997.31

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	85,336.72	95,473.97
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	14,799.24	5,686.17
其他	413.41	11,732.97
合计	100,549.37	112,893.11

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	359,778,890.24	396,263,167.35
减：卖出股票成本总额	307,420,976.97	371,967,268.16
买卖股票差价收入	52,357,913.27	24,295,899.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
债券投资收益—买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	312,195.61	49,948.32
债券投资收益—赎回差价收入	-	-
债券投资收益—申购差价收入	-	-
合计	312,195.61	49,948.32

7.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	1,717,296.71	369,418.97

成交总额		
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,404,700.00	319,400.00
减：应收利息总额	401.10	70.65
买卖债券差价收入	312,195.61	49,948.32

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年可比期间收益金额
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
股指期货投资收益	765,747.57	127,184.46

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,054,089.64	2,216,911.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,054,089.64	2,216,911.67

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	8,321,557.41	24,949,532.35
--股票投资	8,321,557.41	24,949,532.35
--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	-52,160.00	165,360.00
--权证投资	-	-

—期货投资	-52,160.00	165,360.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	2,353.96	-
合计	8,267,043.45	25,114,892.35

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
基金赎回费收入	432,388.99	84,964.93
转换费收入	101.80	122.68
合计	432,490.79	85,087.61

注：1、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不高于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

2、本基金的场内赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不高于其总额的 25% 归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	921,767.64	1,154,889.28
银行间市场交易费用	-	-
期货交易费用	392.76	918.86
合计	922,160.40	1,155,808.14

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
审计费用	90,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
指数使用费	201,300.00	201,250.00
银行费用	4,812.02	3,982.90
账户维护费	18,000.00	18,000.00
基金上市费	60,000.00	60,000.00
合计	494,112.02	553,232.90

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2020 年 12 月 31 日发布的《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告》以及于 2021 年 1 月 5 日发布的《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额基金份额折算结果的公告》，信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作，并以 2020 年 12 月 31 日作为基金份额折算日折算为信诚中证 500 份额。本基金的基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)。《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

除以上情况外，截至本财务报告批准报出日，本基金无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

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。

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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股票交易。

7.4.10.1.2 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权证交易。

7.4.10.1.3 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债券交易。

7.4.10.1.4 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债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

7.4.10.1.6 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,214,956.35	1,881,845.20
其中：支付销售机构的客户维护费	744,779.15	570,693.15

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	487,290.41	414,005.93

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金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。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内与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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，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。

7.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本报告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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2020年01月01日至2020年12月31日		2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	14,275,366.96	85,336.72	15,651,173.35	95,473.97

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末 2020 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年01月06日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年01月04日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020年08月06日	2021年02月24日	锁定期股票	138.02	126.67	45	6,210.90	5,700.15	-
300861	美畅股份	2020年08月06日	2021年02月24日	锁定期股票	43.76	51.10	144	6,301.44	7,358.40	-
300868	杰美特	2020年08月12日	2021年02月24日	锁定期股票	41.26	43.28	146	6,023.96	6,318.88	-
300869	康泰医学	2020年08月12日	2021年02月24日	锁定期股票	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020年08月13日	2021年02月24日	锁定期股票	36.81	65.67	359	13,214.79	23,575.53	-
300876	蒙泰高新	2020年08月14日	2021年02月25日	锁定期股票	20.09	36.62	236	4,741.24	8,642.32	-
300878	维康药业	2020年08月17日	2021年03月03日	锁定期股票	41.34	48.72	149	6,159.66	7,259.28	-

		日	日							
300884	狄耐克	2020 年 11 月 05 日	2021 年 05 月 12 日	锁定期 股票	24.87	33.51	265	6,590.55	8,880.15	-
300886	华业 香料	2020 年 09 月 08 日	2021 年 03 月 16 日	锁定期 股票	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼 测试	2020 年 09 月 09 日	2021 年 03 月 16 日	锁定期 股票	44.47	74.52	128	5,692.16	9,538.56	-
300889	爱克 股份	2020 年 09 月 09 日	2021 年 03 月 16 日	锁定期 股票	27.97	30.12	231	6,461.07	6,957.72	-
300890	翔丰 华	2020 年 09 月 10 日	2021 年 03 月 18 日	锁定期 股票	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云 钛业	2020 年 09 月 10 日	2021 年 03 月 17 日	锁定期 股票	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥 食品	2020 年 09 月 11 日	2021 年 03 月 24 日	锁定期 股票	26.66	60.01	185	4,932.10	11,101.85	-
300893	松原 股份	2020 年 09 月 17 日	2021 年 03 月 24 日	锁定期 股票	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星 人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 06 月 30 日	锁定期 股票	14.07	36.97	490	6,894.30	18,115.30	-
300895	铜牛 信息	2020 年 09 月 17 日	2021 年 03 月 24 日	锁定期 股票	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美 客	2020 年 09 月 21 日	2021 年 03 月 29 日	锁定期 股票	118.27	603.36	57	6,741.39	34,391.52	-
300898	熊猫 乳品	2020 年 10 月 09 日	2021 年 04 月 16 日	锁定期 股票	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300902	国安 达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 04 月 29 日	锁定期 股票	15.38	24.26	518	7,966.84	12,566.68	-
300907	康平 科技	2020 年 11 月 11 日	2021 年 05 月 18 日	锁定期 股票	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-

300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年05月24日	锁定期股票	39.74	60.44	168	6,676.32	10,153.92	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年05月27日	锁定期股票	30.26	47.87	237	7,171.62	11,345.19	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年06月03日	锁定期股票	24.35	33.06	297	7,231.95	9,818.82	-
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年06月07日	锁定期股票	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年06月21日	锁定期股票	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年06月22日	锁定期股票	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年06月23日	锁定期股票	24.60	61.51	217	5,338.20	13,347.67	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年06月25日	锁定期股票	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年06月30日	锁定期股票	20.08	37.33	300	6,024.00	11,199.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年01月07日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月07日	锁定期股票	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	锁定期股票	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年01月07日	新发未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年01月06日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688063	派能	2020年	2021年	锁定期	56.00	189.24	1,288	72,128.00	243,741.12	-

	科技	12月22日	06月30日	股票							
688069	德林海	2020年07月15日	2021年01月22日	锁定期股票	67.20	62.45	675	45,360.00	42,153.75	-	
688160	步科股份	2020年11月04日	2021年05月12日	锁定期股票	20.34	31.29	2,252	45,805.68	70,465.08	-	
688165	埃夫特	2020年07月07日	2021年01月15日	锁定期股票	6.35	13.10	8,790	55,816.50	115,149.00	-	
688229	博睿数据	2020年08月07日	2021年02月18日	锁定期股票	65.82	101.25	730	48,048.60	73,912.50	-	
688308	欧科亿	2020年12月03日	2021年06月10日	锁定期股票	23.99	23.41	2,334	55,992.66	54,638.94	-	
688508	芯朋微	2020年07月15日	2021年01月22日	锁定期股票	28.30	91.91	1,443	40,836.90	132,626.13	-	
688595	芯海科技	2020年09月18日	2021年03月29日	锁定期股票	22.82	60.59	2,643	60,313.26	160,139.37	-	
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年01月07日	新发未上市	74.46	74.46	769	57,259.74	57,259.74	-	
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年07月01日	锁定期股票	78.49	170.53	854	67,030.46	145,632.62	-	

7.4.12.1.2 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
128142	新乳转债	2020年12月18日	2021年01月19日	新发未上市	100.00	100.00	46	4,600.00	4,600.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 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
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项	3.23	2021年01月07日	3.40	66,900	362,784.83	216,087.00	-

注：本基金本报告期末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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于跟踪指数的股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票等，股票资产占基金资产的比例较高。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

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；公司设立独立的监察稽核部和风险管理部，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。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险，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对风险进行持续监控。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	26,000.00
AAA 以下	4,600.00	420,300.00
未评级	-	-
合计	4,600.00	446,300.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公

司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。）

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	14,275,366.96	-	-	-	-	-	14,275,366.96
结算备付金	1,714,627.28	-	-	-	-	-	1,714,627.28
存出保证金	22,080.77	-	-	-	-	390,553.60	412,634.37
交易性金融资产	-	-	-	-	4,600.00	184,443,374.80	184,447,974.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收证券清算款						10,436.13	10,436.13
应收利息						1,629.23	1,629.23
应收股利						-	-
应收申购款						584,688.76	584,688.76
递延所得税资产						-	-
其他资产						-	-
资产总计	16,012,075.01				4,600.00	185,430,682.52	201,447,357.53
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						2,071,386.19	2,071,386.19
应付管理人报酬						166,728.57	166,728.57
应付托管费						36,680.30	36,680.30
应付销售服务费							
应付交易费用						125,169.51	125,169.51
应交税费						15,093.26	15,093.26
应付利息							
应付利润							
其他负债						367,302.47	367,302.47
负债总计						2,782,360.30	2,782,360.30
利率敏感度缺口	16,012,075.01				4,600.00	182,648,322.22	198,664,997.23
上年度末 2019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	15,651,173.35						15,651,173.35
结算备付金	2,410,499.66						2,410,499.66
存出保证金	23,294.45					584,057.60	607,352.05
交易性金融资产					446,300.00	224,861,586.52	225,307,886.52

衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收证券清算款							
应收利息					3,728.22	3,728.22	
应收股利							
应收申购款					586,548.61	586,548.61	
递延所得税资产							
其他资产							
资产总计	18,084,967.46				446,300.00	226,035,920.95	244,567,188.41
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					757,377.90	757,377.90	
应付管理人报酬					199,457.07	199,457.07	
应付托管费					43,880.57	43,880.57	
应付销售服务费							
应付交易费用					193,864.86	193,864.86	
应交税费					2,156.30	2,156.30	
应付利息							
应付利润							
其他负债					527,170.45	527,170.45	
负债总计					1,723,907.15	1,723,907.15	
利率敏感度缺口	18,084,967.46				446,300.00	224,312,013.80	242,843,281.26

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负债的账面价值，并按照合同约定规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指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价格风险。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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

本基金持有有一定比例的证券交易所上市的股票, 因此存在相应的其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	184,443,374.80	92.84	224,861,586.52	92.60
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	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	184,443,374.80	92.84	224,861,586.52	92.60

注: 其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下, 期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 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(2020 年 12 月 31 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	9,265,041.49	10,944,292.41
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-9,265,041.49	-10,944,292.41

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

于本报告期末, 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 182,596,765.38 元,属于第二层次的余额为 1,851,209.42 元,无属于第三层次的余额(上年度末:第一层次 224,200,096.88 元,第二层次 1,107,789.64 元,无第三层次)

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,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时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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,确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末:无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、卖出回购金融资产、应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	184,443,374.80	91.56
	其中:股票	184,443,374.80	91.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,600.00	0.00
	其中:债券	4,600.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,989,994.24	7.94
8	其他各项资产	1,009,388.49	0.50
9	合计	201,447,357.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,461,547.00	0.74
B	采矿业	5,833,776.96	2.94
C	制造业	117,387,397.43	59.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,172,474.70	2.10
E	建筑业	2,743,688.20	1.38
F	批发和零售业	6,897,695.05	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,519,910.72	1.77

H	住宿和餐饮业	875,432.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,795,941.85	6.94
J	金融业	11,100,062.46	5.59
K	房地产业	5,373,862.62	2.70
L	租赁和商务服务业	1,824,797.80	0.92
M	科学研究和技术服务业	1,685,846.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	1,695,201.69	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	147,136.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,636,428.00	0.82
R	文化、体育和娱乐业	1,493,224.24	0.75
S	综合	877,484.00	0.44
	合计	182,521,906.72	91.87

8.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,594,724.86	0.80
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	11,101.85	0.01
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	249,273.77	0.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,538.56	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	42,153.75	0.02
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	5,700.15	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,921,468.08	0.97

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	33,100	2,392,468.00	1.20
2	300012	华测检测	54,000	1,477,980.00	0.74
3	600426	华鲁恒升	37,000	1,380,100.00	0.69
4	002074	国轩高科	33,200	1,298,784.00	0.65
5	600089	特变电工	120,200	1,220,030.00	0.61
6	600079	人福医药	35,000	1,185,800.00	0.60
7	603882	金城医学	9,000	1,153,080.00	0.58
8	000547	航天发展	41,700	1,146,750.00	0.58
9	300285	国瓷材料	25,000	1,127,750.00	0.57
10	300496	中科创达	9,600	1,123,200.00	0.57
11	300207	欣旺达	36,200	1,111,702.00	0.56
12	002709	天赐材料	10,340	1,073,292.00	0.54
13	601233	桐昆股份	48,500	998,615.00	0.50
14	600143	金发科技	57,700	988,978.00	0.50
15	600739	辽宁成大	39,800	967,936.00	0.49
16	002185	华天科技	70,600	961,572.00	0.48
17	002797	第一创业	95,200	947,240.00	0.48
18	600132	重庆啤酒	7,900	940,021.00	0.47
19	002385	大北农	95,400	921,564.00	0.46
20	600885	宏发股份	16,900	916,318.00	0.46
21	002568	百润股份	8,700	907,323.00	0.46
22	601799	星宇股份	4,500	902,250.00	0.45
23	601099	太平洋	220,600	900,048.00	0.45
24	002340	格林美	124,300	868,857.00	0.44
25	603806	福斯特	9,980	852,292.00	0.43
26	300595	欧普康视	9,900	811,008.00	0.41
27	601966	玲珑轮胎	22,974	807,995.58	0.41
28	603589	口子窖	11,700	806,130.00	0.41
29	688002	睿创微纳	7,200	799,200.00	0.40
30	600316	洪都航空	14,000	796,180.00	0.40
31	600486	扬农化工	6,000	792,000.00	0.40
32	000636	风华高科	23,300	785,210.00	0.40
33	300357	我武生物	10,200	782,340.00	0.39
34	002625	光启技术	34,900	776,525.00	0.39
35	002507	涪陵榨菜	18,300	774,090.00	0.39
36	600529	山东药玻	15,400	772,310.00	0.39
37	002080	中材科技	31,700	766,506.00	0.39
38	601168	西部矿业	61,900	766,322.00	0.39

39	600201	生物股份	36,400	760,396.00	0.38
40	300699	光威复材	8,400	748,020.00	0.38
41	600219	南山铝业	232,100	733,436.00	0.37
42	603345	安井食品	3,800	732,906.00	0.37
43	002078	太阳纸业	50,700	731,601.00	0.37
44	000750	国海证券	123,350	722,831.00	0.36
45	002013	中航机电	63,100	722,495.00	0.36
46	603816	顾家家居	10,240	722,022.40	0.36
47	300088	长信科技	79,500	706,755.00	0.36
48	002030	达安基因	19,950	684,285.00	0.34
49	600862	中航高科	22,600	680,260.00	0.34
50	600699	均胜电子	26,560	673,561.60	0.34
51	600884	杉杉股份	36,835	664,135.05	0.33
52	002081	金螳螂	70,600	662,934.00	0.33
53	002131	利欧股份	218,600	662,358.00	0.33
54	601997	贵阳银行	83,300	662,235.00	0.33
55	601128	常熟银行	89,000	656,820.00	0.33
56	002353	杰瑞股份	18,700	654,500.00	0.33
57	603486	科沃斯	7,380	653,056.20	0.33
58	002465	海格通信	59,900	648,717.00	0.33
59	002212	天融信	30,500	640,805.00	0.32
60	600460	士兰微	25,600	640,000.00	0.32
61	603338	浙江鼎力	6,280	635,473.20	0.32
62	000009	中国宝安	83,800	631,014.00	0.32
63	300316	晶盛机电	20,900	628,672.00	0.32
64	002075	沙钢股份	57,300	628,581.00	0.32
65	002500	山西证券	70,010	626,589.50	0.32
66	300146	汤臣倍健	25,600	618,240.00	0.31
67	600867	通化东宝	46,100	616,818.00	0.31
68	000630	铜陵有色	239,400	615,258.00	0.31
69	002683	宏大爆破	17,000	611,150.00	0.31
70	600511	国药股份	12,300	606,513.00	0.31
71	000988	华工科技	26,100	605,259.00	0.30
72	002791	坚朗五金	4,200	604,800.00	0.30
73	300482	万孚生物	6,700	597,707.00	0.30
74	603444	吉比特	1,400	596,400.00	0.30
75	600038	中直股份	9,500	595,745.00	0.30
76	600733	北汽蓝谷	67,800	587,826.00	0.30
77	300463	迈克生物	12,600	587,160.00	0.30
78	300168	万达信息	27,000	585,630.00	0.29
79	002250	联化科技	24,000	575,760.00	0.29

80	300001	特锐德	19,400	569,584.00	0.29
81	600909	华安证券	70,300	562,400.00	0.28
82	300223	北京君正	6,100	558,089.00	0.28
83	002223	鱼跃医疗	19,550	551,505.50	0.28
84	300070	碧水源	72,000	550,800.00	0.28
85	002156	通富微电	21,600	545,184.00	0.27
86	002444	巨星科技	17,500	544,425.00	0.27
87	000021	深科技	28,600	543,686.00	0.27
88	603866	桃李面包	9,100	537,810.00	0.27
89	600754	锦江酒店	10,400	535,912.00	0.27
90	002299	圣农发展	20,100	533,454.00	0.27
91	002557	洽洽食品	9,900	533,115.00	0.27
92	300418	昆仑万维	26,700	532,665.00	0.27
93	002926	华西证券	42,600	531,648.00	0.27
94	603737	三棵树	3,500	530,250.00	0.27
95	600879	航天电子	70,700	528,836.00	0.27
96	688099	晶晨股份	6,700	527,491.00	0.27
97	600380	健康元	37,900	527,189.00	0.27
98	601689	拓普集团	13,660	524,953.80	0.26
99	600418	江淮汽车	42,900	524,667.00	0.26
100	600779	水井坊	6,300	523,026.00	0.26
101	600516	方大炭素	73,900	522,473.00	0.26
102	600155	华创阳安	39,600	522,324.00	0.26
103	000039	中集集团	34,680	519,853.20	0.26
104	002670	国盛金控	37,600	517,000.00	0.26
105	002138	顺络电子	21,000	514,920.00	0.26
106	002572	索菲亚	19,700	510,230.00	0.26
107	300271	华宇软件	21,200	506,044.00	0.25
108	002603	以岭药业	19,600	499,800.00	0.25
109	300024	机器人	40,500	498,150.00	0.25
110	000623	吉林敖东	30,200	497,394.00	0.25
111	002373	千方科技	25,700	491,384.00	0.25
112	600372	中航电子	25,000	491,250.00	0.25
113	000513	丽珠集团	12,050	488,025.00	0.25
114	600415	小商品城	88,400	487,084.00	0.25
115	300244	迪安诊断	14,100	483,348.00	0.24
116	300115	长盈精密	19,500	480,675.00	0.24
117	000878	云南铜业	33,100	478,957.00	0.24
118	600563	法拉电子	4,400	473,220.00	0.24
119	600166	福田汽车	150,000	472,500.00	0.24
120	000050	深天马 A	31,900	470,206.00	0.24

121	000975	银泰黄金	54,076	465,594.36	0.23
122	300618	寒锐钴业	4,900	465,059.00	0.23
123	601615	明阳智能	24,400	463,112.00	0.23
124	600549	厦门钨业	27,400	461,690.00	0.23
125	688088	虹软科技	6,600	461,472.00	0.23
126	002273	水晶光电	39,540	458,268.60	0.23
127	300315	掌趣科技	89,605	457,881.55	0.23
128	600765	中航重机	18,300	457,500.00	0.23
129	600801	华新水泥	22,160	457,160.80	0.23
130	600153	建发股份	55,600	456,476.00	0.23
131	300009	安科生物	31,080	456,254.40	0.23
132	002019	亿帆医药	24,100	456,213.00	0.23
133	002064	华峰化学	45,200	456,068.00	0.23
134	002920	德赛西威	5,400	454,356.00	0.23
135	600667	太极实业	47,900	452,655.00	0.23
136	000686	东北证券	45,600	447,792.00	0.23
137	000739	普洛药业	19,182	446,556.96	0.22
138	600598	北大荒	23,112	444,906.00	0.22
139	002511	中顺洁柔	21,258	443,654.46	0.22
140	002831	裕同科技	14,420	441,540.40	0.22
141	002705	新宝股份	10,400	439,400.00	0.22
142	300017	网宿科技	63,700	438,893.00	0.22
143	002124	天邦股份	29,800	435,080.00	0.22
144	600535	天士力	29,400	434,826.00	0.22
145	600170	上海建工	144,100	433,741.00	0.22
146	000401	冀东水泥	30,600	432,990.00	0.22
147	600895	张江高科	25,200	429,408.00	0.22
148	000540	中天金融	136,000	428,400.00	0.22
149	603858	步长制药	18,500	426,795.00	0.21
150	000738	航发控制	18,600	426,498.00	0.21
151	000830	鲁西化工	33,300	425,574.00	0.21
152	002506	协鑫集成	99,100	421,175.00	0.21
153	002195	二三四五	185,960	420,269.60	0.21
154	603883	老百姓	6,675	419,390.25	0.21
155	002152	广电运通	39,100	417,588.00	0.21
156	600642	申能股份	79,900	417,078.00	0.21
157	002648	卫星石化	15,900	415,308.00	0.21
158	002966	苏州银行	53,900	413,952.00	0.21
159	000690	宝新能源	56,500	412,450.00	0.21
160	600409	三友化工	40,100	411,025.00	0.21
161	600859	王府井	12,600	410,508.00	0.21

162	002056	横店东磁	26,700	405,573.00	0.20
163	600392	盛和资源	45,600	405,384.00	0.20
164	600008	首创股份	143,050	404,831.50	0.20
165	601456	国联证券	18,800	401,004.00	0.20
166	601992	金隅集团	134,900	400,653.00	0.20
167	603638	艾迪精密	5,800	399,852.00	0.20
168	002028	思源电气	19,800	397,188.00	0.20
169	600497	驰宏锌锗	82,700	396,960.00	0.20
170	600580	卧龙电驱	25,400	396,240.00	0.20
171	002281	光迅科技	13,600	394,944.00	0.20
172	002382	蓝帆医疗	18,700	394,383.00	0.20
173	000060	中金岭南	81,200	391,384.00	0.20
174	000729	燕京啤酒	45,800	390,216.00	0.20
175	002690	美亚光电	8,800	389,664.00	0.20
176	300212	易华录	12,680	388,642.00	0.20
177	300058	蓝色光标	64,700	388,200.00	0.20
178	002595	豪迈科技	13,000	385,450.00	0.19
179	603290	斯达半导	1,600	385,440.00	0.19
180	002294	信立泰	13,600	385,288.00	0.19
181	601866	中远海发	128,800	382,536.00	0.19
182	000807	云铝股份	50,800	382,524.00	0.19
183	600315	上海家化	11,000	382,030.00	0.19
184	002372	伟星新材	20,420	381,854.00	0.19
185	600827	百联股份	26,100	381,060.00	0.19
186	002221	东华能源	37,500	380,250.00	0.19
187	600528	中铁工业	43,300	378,442.00	0.19
188	000581	威孚高科	16,300	377,997.00	0.19
189	002429	兆驰股份	60,800	376,960.00	0.19
190	000983	山西焦煤	66,550	375,342.00	0.19
191	600256	广汇能源	131,600	372,428.00	0.19
192	601717	郑煤机	33,859	370,078.87	0.19
193	300296	利亚德	57,800	367,608.00	0.19
194	000997	新大陆	23,900	365,192.00	0.18
195	000960	锡业股份	32,556	364,627.20	0.18
196	600875	东方电气	36,100	359,917.00	0.18
197	600704	物产中大	82,200	359,214.00	0.18
198	300630	普利制药	8,505	356,274.45	0.18
199	603605	珀莱雅	2,000	356,000.00	0.18
200	600160	巨化股份	43,670	354,163.70	0.18
201	600260	凯乐科技	32,400	353,160.00	0.18
202	600811	东方集团	96,560	352,444.00	0.18

203	002745	木林森	24,100	351,619.00	0.18
204	002396	星网锐捷	15,200	350,512.00	0.18
205	600839	四川长虹	120,000	348,000.00	0.18
206	600728	佳都科技	45,600	346,104.00	0.17
207	002092	中泰化学	55,800	343,170.00	0.17
208	002368	太极股份	13,139	343,059.29	0.17
209	600515	海航基础	50,800	342,900.00	0.17
210	300474	景嘉微	4,900	342,559.00	0.17
211	600325	华发股份	55,030	341,736.30	0.17
212	600258	首旅酒店	16,000	339,520.00	0.17
213	600167	联美控股	29,780	338,003.00	0.17
214	603317	天味食品	4,100	337,184.00	0.17
215	600737	中粮糖业	34,700	335,896.00	0.17
216	600967	内蒙一机	27,300	331,968.00	0.17
217	600820	隧道股份	61,300	331,633.00	0.17
218	002242	九阳股份	10,300	330,012.00	0.17
219	000012	南玻 A	44,590	329,074.20	0.17
220	603927	中科软	8,200	328,738.00	0.17
221	600881	亚泰集团	105,500	327,050.00	0.16
222	002085	万丰奥威	49,700	326,032.00	0.16
223	300002	神州泰岳	63,700	325,507.00	0.16
224	600597	光明乳业	19,800	321,948.00	0.16
225	002390	信邦制药	37,900	321,392.00	0.16
226	002268	卫士通	19,100	318,970.00	0.16
227	600446	金证股份	19,600	317,716.00	0.16
228	000999	华润三九	12,700	316,738.00	0.16
229	600410	华胜天成	35,700	316,302.00	0.16
230	600567	山鹰国际	104,500	315,590.00	0.16
231	600804	鹏博士	46,500	312,480.00	0.16
232	603712	七一二	7,500	312,375.00	0.16
233	002174	游族网络	23,700	311,892.00	0.16
234	600282	南钢股份	99,400	310,128.00	0.16
235	000877	天山股份	20,400	308,040.00	0.16
236	000709	河钢股份	137,500	308,000.00	0.16
237	601179	中国西电	66,600	307,026.00	0.15
238	000930	中粮科技	36,400	306,488.00	0.15
239	600435	北方导航	33,900	305,100.00	0.15
240	002387	维信诺	26,700	304,380.00	0.15
241	603000	人民网	18,000	304,200.00	0.15
242	000629	攀钢钒钛	139,500	302,715.00	0.15
243	002807	江阴银行	70,580	302,082.40	0.15

244	600273	嘉化能源	32,600	301,224.00	0.15
245	300166	东方国信	27,400	300,030.00	0.15
246	600026	中远海能	44,900	299,932.00	0.15
247	600216	浙江医药	21,900	297,840.00	0.15
248	000301	东方盛虹	31,400	297,672.00	0.15
249	001914	招商积余	13,800	297,114.00	0.15
250	002233	塔牌集团	23,200	295,568.00	0.15
251	600718	东软集团	28,300	294,603.00	0.15
252	600060	海信视像	25,500	292,740.00	0.15
253	600908	无锡银行	48,000	291,840.00	0.15
254	600037	歌华有线	31,600	290,720.00	0.15
255	002985	北摩高科	1,500	289,950.00	0.15
256	002925	盈趣科技	4,500	289,485.00	0.15
257	600188	兖州煤业	28,700	289,009.00	0.15
258	600064	南京高科	28,100	288,587.00	0.15
259	000778	新兴铸管	77,800	286,304.00	0.14
260	600572	康恩贝	60,700	285,897.00	0.14
261	000932	华菱钢铁	59,700	285,366.00	0.14
262	002004	华邦健康	51,500	285,310.00	0.14
263	000400	许继电气	19,700	284,862.00	0.14
264	600755	厦门国贸	42,500	283,900.00	0.14
265	000027	深圳能源	46,380	282,454.20	0.14
266	601975	招商南油	112,400	282,124.00	0.14
267	601005	重庆钢铁	190,600	282,088.00	0.14
268	600039	四川路桥	62,000	279,620.00	0.14
269	000598	兴蓉环境	58,200	279,360.00	0.14
270	000887	中鼎股份	23,800	278,698.00	0.14
271	002128	露天煤业	25,000	273,500.00	0.14
272	603198	迎驾贡酒	7,800	272,220.00	0.14
273	000089	深圳机场	33,300	272,061.00	0.14
274	002701	奥瑞金	54,900	271,206.00	0.14
275	600398	海澜之家	41,900	268,998.00	0.14
276	300026	红日药业	58,600	268,388.00	0.14
277	002110	三钢闽光	39,850	268,190.50	0.13
278	601118	海南橡胶	55,600	267,992.00	0.13
279	600158	中体产业	21,800	267,268.00	0.13
280	000825	太钢不锈	74,000	267,140.00	0.13
281	601106	中国一重	89,100	266,409.00	0.13
282	002191	劲嘉股份	28,600	263,978.00	0.13
283	002563	森马服饰	26,300	263,526.00	0.13
284	000970	中科三环	27,728	262,029.60	0.13

285	300072	三聚环保	45,800	260,144.00	0.13
286	600120	浙江东方	43,376	258,954.72	0.13
287	600171	上海贝岭	18,300	256,566.00	0.13
288	000488	晨鸣纸业	39,800	255,516.00	0.13
289	600022	山东钢铁	177,800	254,254.00	0.13
290	002936	郑州银行	56,910	253,818.60	0.13
291	002048	宁波华翔	16,300	253,791.00	0.13
292	002867	周大生	9,500	253,175.00	0.13
293	601699	潞安环能	38,900	252,850.00	0.13
294	600195	中牧股份	19,707	252,446.67	0.13
295	000090	天健集团	42,480	252,331.20	0.13
296	000967	盈峰环境	30,800	250,712.00	0.13
297	002839	张家港行	41,100	250,710.00	0.13
298	603228	景旺电子	8,312	250,606.80	0.13
299	601860	紫金银行	59,500	250,495.00	0.13
300	000402	金融街	38,800	250,260.00	0.13
301	002217	合力泰	60,700	248,870.00	0.13
302	600056	中国医药	17,353	248,668.49	0.13
303	000528	柳工	33,540	246,854.40	0.12
304	300133	华策影视	39,900	246,582.00	0.12
305	600673	东阳光	49,000	246,470.00	0.12
306	000883	湖北能源	63,400	245,992.00	0.12
307	600376	首开股份	41,900	245,953.00	0.12
308	601333	广深铁路	110,200	244,644.00	0.12
309	603077	和邦生物	172,100	244,382.00	0.12
310	688321	微芯生物	6,600	244,266.00	0.12
311	000563	陕国投 A	64,400	242,788.00	0.12
312	600021	上海电力	34,000	242,080.00	0.12
313	600507	方大特钢	34,874	242,025.56	0.12
314	000990	诚志股份	20,400	241,944.00	0.12
315	600928	西安银行	43,200	240,192.00	0.12
316	300376	易事特	30,100	239,596.00	0.12
317	688029	南微医学	1,300	239,213.00	0.12
318	000685	中山公用	28,800	239,040.00	0.12
319	601000	唐山港	96,300	238,824.00	0.12
320	601200	上海环境	21,850	238,165.00	0.12
321	600782	新钢股份	51,800	237,762.00	0.12
322	000898	鞍钢股份	77,900	236,816.00	0.12
323	300180	华峰超纤	40,000	236,400.00	0.12
324	600500	中化国际	44,830	236,254.10	0.12
325	601865	福莱特	5,900	235,410.00	0.12

326	002266	浙富控股	52,300	235,350.00	0.12
327	002203	海亮股份	31,700	234,263.00	0.12
328	002317	众生药业	21,200	233,624.00	0.12
329	600970	中材国际	33,900	233,232.00	0.12
330	002155	湖南黄金	27,300	232,323.00	0.12
331	600126	杭钢股份	43,900	232,231.00	0.12
332	002244	滨江集团	50,500	231,795.00	0.12
333	603568	伟明环保	12,233	231,570.69	0.12
334	300113	顺网科技	13,500	231,525.00	0.12
335	000559	万向钱潮	42,900	229,515.00	0.12
336	000758	中色股份	44,800	227,584.00	0.11
337	600466	蓝光发展	49,120	227,425.60	0.11
338	000519	中兵红箭	22,600	226,452.00	0.11
339	601598	中国外运	51,100	224,840.00	0.11
340	600266	城建发展	43,984	223,438.72	0.11
341	600649	城投控股	41,100	223,173.00	0.11
342	601016	节能风电	64,800	222,264.00	0.11
343	601098	中南传媒	23,308	222,125.24	0.11
344	600373	中文传媒	22,000	221,980.00	0.11
345	300010	豆神教育	22,600	220,576.00	0.11
346	000028	国药一致	4,800	219,840.00	0.11
347	600348	阳泉煤业	39,100	219,351.00	0.11
348	600073	上海梅林	21,300	219,177.00	0.11
349	600546	山煤国际	25,700	218,707.00	0.11
350	603885	吉祥航空	19,200	218,304.00	0.11
351	300182	捷成股份	66,900	216,087.00	0.11
352	601718	际华集团	71,300	216,039.00	0.11
353	002458	益生股份	19,300	215,195.00	0.11
354	600959	江苏有线	65,000	215,150.00	0.11
355	000078	海王生物	53,600	214,936.00	0.11
356	600388	龙净环保	24,200	214,896.00	0.11
357	600901	江苏租赁	38,900	214,339.00	0.11
358	002183	怡亚通	48,300	210,588.00	0.11
359	002399	海普瑞	12,200	210,084.00	0.11
360	002505	鹏都农牧	82,800	209,484.00	0.11
361	002440	闰土股份	22,400	208,768.00	0.11
362	600094	大名城	51,800	208,236.00	0.10
363	002640	跨境通	40,500	208,170.00	0.10
364	600645	中源协和	10,600	207,866.00	0.10
365	002249	大洋电机	46,100	207,450.00	0.10
366	600633	浙数文化	25,400	206,756.00	0.10

367	600808	马钢股份	77,500	206,150.00	0.10
368	600835	上海机电	10,500	204,330.00	0.10
369	600062	华润双鹤	16,900	202,631.00	0.10
370	002038	双鹭药业	20,000	202,000.00	0.10
371	000564	供销大集	77,700	201,243.00	0.10
372	600141	兴发集团	18,100	199,643.00	0.10
373	002468	申通快递	19,800	199,584.00	0.10
373	600675	中华企业	59,400	199,584.00	0.10
375	002010	传化智联	42,300	199,233.00	0.10
376	600643	爱建集团	26,362	198,242.24	0.10
377	000959	首钢股份	51,500	197,245.00	0.10
378	601778	晶科科技	27,000	196,020.00	0.10
379	601958	金钼股份	31,400	194,994.00	0.10
380	002434	万里扬	21,800	194,456.00	0.10
381	600863	内蒙华电	75,500	194,035.00	0.10
382	601880	大连港	100,500	193,965.00	0.10
383	000158	常山北明	31,200	193,440.00	0.10
384	002408	齐翔腾达	23,100	193,116.00	0.10
385	000415	渤海租赁	80,400	192,960.00	0.10
386	000869	张裕 A	4,400	191,840.00	0.10
387	600729	重庆百货	6,600	190,740.00	0.10
388	600312	平高电气	26,416	188,610.24	0.09
389	000826	启迪环境	27,900	188,604.00	0.09
390	002544	杰赛科技	11,200	187,936.00	0.09
391	601611	中国核建	25,800	187,824.00	0.09
392	600717	天津港	39,124	187,012.72	0.09
393	000031	大悦城	41,800	183,920.00	0.09
394	600776	东方通信	15,500	183,675.00	0.09
395	002583	海能达	29,900	183,586.00	0.09
396	300459	金科文化	57,106	182,168.14	0.09
397	002424	贵州百灵	22,900	179,307.00	0.09
398	002589	瑞康医药	34,200	178,866.00	0.09
399	000681	视觉中国	13,700	178,100.00	0.09
400	600259	广晟有色	5,900	178,003.00	0.09
401	002635	安洁科技	10,300	177,469.00	0.09
402	002002	鸿达兴业	58,900	176,700.00	0.09
402	603650	彤程新材	5,700	176,700.00	0.09
404	600566	济川药业	8,700	176,001.00	0.09
405	000501	鄂武商 A	15,000	174,750.00	0.09
406	000718	苏宁环球	49,300	169,099.00	0.09
407	600648	外高桥	12,100	169,037.00	0.09

408	600823	世茂股份	36,600	168,726.00	0.08
409	300324	旋极信息	39,849	168,561.27	0.08
410	603708	家家悦	7,900	168,270.00	0.08
411	000717	韶钢松山	39,300	167,811.00	0.08
412	600307	酒钢宏兴	101,700	167,805.00	0.08
413	600339	中油工程	54,400	167,552.00	0.08
414	002815	崇达技术	11,500	166,060.00	0.08
415	000046	泛海控股	50,600	165,968.00	0.08
416	600582	天地科技	53,800	165,704.00	0.08
417	600131	国网信通	11,600	165,068.00	0.08
418	600329	中新药业	9,300	162,936.00	0.08
419	002375	亚厦股份	21,800	162,192.00	0.08
420	000008	神州高铁	63,200	160,528.00	0.08
421	000156	华数传媒	18,600	159,216.00	0.08
422	002948	青岛银行	26,800	158,924.00	0.08
423	600985	淮北矿业	14,100	157,779.00	0.08
424	600968	海油发展	66,000	157,740.00	0.08
425	601928	凤凰传媒	24,800	156,984.00	0.08
426	600664	哈药股份	48,900	155,991.00	0.08
427	000061	农产品	22,100	155,805.00	0.08
428	600338	西藏珠峰	14,820	155,313.60	0.08
429	600707	彩虹股份	23,300	155,178.00	0.08
430	000543	皖能电力	36,800	153,824.00	0.08
430	603260	合盛硅业	4,600	153,824.00	0.08
432	300257	开山股份	11,100	151,515.00	0.08
433	002416	爱施德	20,100	149,946.00	0.08
434	603515	欧普照明	4,950	149,539.50	0.08
435	600556	天下秀	11,700	148,005.00	0.07
436	600748	上实发展	30,000	147,300.00	0.07
437	603377	东方时尚	7,600	147,136.00	0.07
438	601298	青岛港	22,800	146,604.00	0.07
439	002302	西部建设	16,400	143,992.00	0.07
440	600869	远东股份	36,000	143,640.00	0.07
441	000937	冀中能源	34,400	143,104.00	0.07
442	601127	小康股份	8,200	140,056.00	0.07
443	600006	东风汽车	14,800	139,712.00	0.07
444	600639	浦东金桥	11,000	136,400.00	0.07
445	601139	深圳燃气	18,700	135,388.00	0.07
446	002503	搜于特	60,300	135,072.00	0.07
447	600277	亿利洁能	44,500	133,055.00	0.07
448	600787	中储股份	28,600	131,846.00	0.07

449	000600	建投能源	23,300	130,713.00	0.07
450	600545	卓郎智能	36,900	129,150.00	0.07
451	300134	大富科技	12,500	129,125.00	0.06
452	000813	德展健康	29,100	128,913.00	0.06
453	603888	新华网	6,750	128,250.00	0.06
454	000062	深圳华强	10,220	127,136.80	0.06
455	603225	新凤鸣	9,100	126,490.00	0.06
456	600640	号百控股	10,300	126,175.00	0.06
457	600350	山东高速	20,200	124,836.00	0.06
458	600517	国网英大	20,400	124,032.00	0.06
459	601828	美凯龙	14,400	122,256.00	0.06
460	600871	石化油服	61,700	120,932.00	0.06
461	600291	西水股份	21,300	120,771.00	0.06
462	002093	国脉科技	16,400	119,556.00	0.06
463	603056	德邦股份	9,400	119,286.00	0.06
464	002419	天虹股份	15,600	119,184.00	0.06
465	600575	淮河能源	50,500	117,160.00	0.06
466	002051	中工国际	16,100	114,149.00	0.06
467	000537	广宇发展	18,200	114,114.00	0.06
468	603379	三美股份	5,940	113,454.00	0.06
469	600657	信达地产	27,800	112,590.00	0.06
470	601228	广州港	33,000	110,880.00	0.06
471	000553	安道麦 A	14,100	110,262.00	0.06
472	603893	瑞芯微	1,500	108,525.00	0.05
473	601869	长飞光纤	4,000	108,160.00	0.05
474	000732	泰禾集团	32,300	105,621.00	0.05
475	600623	华谊集团	18,100	104,980.00	0.05
476	603328	依顿电子	13,000	103,350.00	0.05
477	002901	大博医疗	1,400	103,222.00	0.05
478	002946	新乳业	5,500	96,855.00	0.05
479	603786	科博达	1,400	94,668.00	0.05
480	600903	贵州燃气	7,400	93,980.00	0.05
481	601801	皖新传媒	19,400	92,150.00	0.05
482	002653	海思科	5,200	91,104.00	0.05
483	603983	丸美股份	1,700	88,757.00	0.04
484	601003	柳钢股份	16,700	86,673.00	0.04
485	603719	良品铺子	1,400	82,138.00	0.04
486	600053	九鼎投资	4,200	82,110.00	0.04
487	603355	莱克电气	2,700	81,621.00	0.04
488	601969	海南矿业	12,700	75,946.00	0.04
489	603868	飞科电器	1,600	74,848.00	0.04

490	002941	新疆交建	6,300	69,300.00	0.03
491	002818	富森美	4,860	68,671.80	0.03
492	002957	科瑞技术	2,700	55,215.00	0.03
493	603256	宏和科技	5,700	50,331.00	0.03
494	002423	中粮资本	3,400	32,912.00	0.02
495	601512	中新集团	3,100	30,814.00	0.02
496	001872	招商港口	1,600	25,472.00	0.01
497	600917	重庆燃气	2,900	19,894.00	0.01
498	601068	中铝国际	4,700	16,732.00	0.01

8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688063	派能科技	1,288	243,741.12	0.12
2	300894	火星人	4,897	234,058.30	0.12
3	688595	芯海科技	2,643	160,139.37	0.08
4	688686	奥普特	854	145,632.62	0.07
5	688508	芯朋微	1,443	132,626.13	0.07
6	688165	埃夫特	8,790	115,149.00	0.06
7	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.05
8	688229	博睿数据	730	73,912.50	0.04
9	688160	步科股份	2,252	70,465.08	0.04
10	688617	惠泰医疗	769	57,259.74	0.03
11	688308	欧科亿	2,334	54,638.94	0.03
12	688069	德林海	675	42,153.75	0.02
13	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.02
14	300896	爱美客	57	34,391.52	0.02
15	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
16	300870	欧陆通	359	23,575.53	0.01
17	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.01
18	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
19	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
20	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
21	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
22	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
23	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.01
24	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
25	300919	中伟股份	217	13,347.67	0.01
26	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
27	300907	康平科技	473	12,700.05	0.01
28	300902	国安达	518	12,566.68	0.01

29	300910	瑞丰新材	237	11,345.19	0.01
30	300925	法本信息	300	11,199.00	0.01
31	300892	品渥食品	185	11,101.85	0.01
32	300908	仲景食品	168	10,153.92	0.01
33	300911	亿田智能	297	9,818.82	0.00
34	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
35	300887	谱尼测试	128	9,538.56	0.00
36	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
37	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
38	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
39	300884	狄耐克	265	8,880.15	0.00
40	300876	蒙泰高新	236	8,642.32	0.00
41	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
42	300861	美畅股份	144	7,358.40	0.00
43	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
44	300878	维康药业	149	7,259.28	0.00
45	300889	爱克股份	231	6,957.72	0.00
46	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
47	300868	杰美特	146	6,318.88	0.00
48	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
49	300860	锋尚文化	45	5,700.15	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600529	山东药玻	1,689,803.00	0.70
2	002028	思源电气	1,666,766.00	0.69
3	002081	金螳螂	1,649,259.00	0.68
4	300558	贝达药业	1,469,721.00	0.61
5	300595	欧普康视	1,386,655.30	0.57
6	300482	万孚生物	1,365,004.00	0.56
7	300251	光线传媒	1,343,670.00	0.55
8	300182	捷成股份	1,340,148.00	0.55
9	002901	大博医疗	1,332,614.00	0.55
10	000739	普洛药业	1,327,393.96	0.55
11	300357	我武生物	1,320,711.16	0.54
12	002185	华天科技	1,293,139.00	0.53
13	601128	常熟银行	1,274,382.00	0.52
14	001914	招商积余	1,177,882.98	0.49
15	000089	深圳机场	1,159,107.01	0.48

16	600859	王府井	1,154,554.70	0.48
17	300630	普利制药	1,138,810.99	0.47
18	002127	南极电商	1,124,419.00	0.46
19	000807	云铝股份	1,119,961.00	0.46
20	002156	通富微电	1,116,418.39	0.46

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。

8.4.2 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	600745	闻泰科技	2,378,174.00	0.98
2	002127	南极电商	2,363,206.00	0.97
3	688981	中芯国际	2,308,881.28	0.95
4	002821	凯莱英	2,223,786.13	0.92
5	002129	中环股份	2,199,283.00	0.91
6	600161	天坛生物	2,077,624.58	0.86
7	300014	亿纬锂能	2,047,846.88	0.84
8	002371	北方华创	1,926,930.16	0.79
9	002028	思源电气	1,924,327.00	0.79
10	300253	卫宁健康	1,896,529.30	0.78
11	600298	安琪酵母	1,785,500.00	0.74
12	300251	光线传媒	1,778,854.00	0.73
13	603939	益丰药房	1,768,721.09	0.73
14	002463	沪电股份	1,637,086.00	0.67
15	600845	宝信软件	1,623,414.84	0.67
16	600584	长电科技	1,619,489.00	0.67
17	002384	东山精密	1,617,435.00	0.67
18	601128	常熟银行	1,576,537.00	0.65
19	300383	光环新网	1,560,684.51	0.64
20	300012	华测检测	1,536,699.82	0.63

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。

8.4.3 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	258,681,207.84
卖出股票收入(成交)总额	359,778,890.24

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。

8.5 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（可交换债）	4,600.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,600.00	0.00

8.6 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（%）
1	128142	新乳转债	46	4,600.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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	公允价值变动	风险说明
IC2106	IC2106	2	2,440,960.00	72,160.00	-
公允价值变动总额合计					72,160.00
股指期货投资本期收益					765,747.57
股指期货投资本期公允价值变动					-54,261.75

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

8.10.2 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

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。

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。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

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。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	412,634.37
2	应收证券清算款	10,436.13
3	应收股利	-
4	应收利息	1,629.23
5	应收申购款	584,688.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,009,388.49

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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	688063	派能科技	243,741.12	0.12	锁定期股票
2	688595	芯海科技	160,139.37	0.08	锁定期股票
3	688686	奥普特	145,632.62	0.07	锁定期股票
4	688508	芯朋微	132,626.13	0.07	锁定期股票
5	300894	火星人	18,115.30	0.01	锁定期股票

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 500 指数分 级 A	415	24,538.40	4,090,766.00	40.17%	6,092,670.00	59.83%
信诚中证 500 指数分 级 B	2,997	5,096.82	456,759.00	2.99%	14,818,396.00	97.01%
信诚中证 500 指数分 级	47,998	2,247.77	187,269.66	0.17%	107,701,131.62	99.83%
合计	51,410	2,593.79	4,734,794.66	3.55%	128,612,197.62	96.45%

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证 500 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	李宁	3,573,300.00	35.09%

2	华金证券—兴业银行—华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划	2,000,491.00	19.64%
3	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	1,300,000.00	12.77%
4	陈松长	1,033,660.00	10.15%
5	北京城建集团有限责任公司企业年金计划—中信银行股份有限公司	423,618.00	4.16%
6	中国银河证券股份有限公司	366,637.00	3.60%
7	黄丹妮	155,671.00	1.53%
8	罗杰	108,467.00	1.07%
9	刘辉荣	100,000.00	0.98%
10	吴家英	89,744.00	0.88%

信诚中证 500 指数分级 B:

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	王晓刚	443,324.00	2.90%
2	陈胜华	430,000.00	2.82%
3	广州市广百股份有限公司	384,000.00	2.51%
4	杨胜华	345,247.00	2.26%
5	张凤英	339,416.00	2.22%
6	加建民	338,302.00	2.21%
7	杨晓梅	303,914.00	1.99%
8	王晶	272,168.00	1.78%
9	段肖力	253,861.00	1.66%
10	管恩聚	226,428.00	1.48%

信诚中证 500 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	杨丽	2,600,000.00	2.41%
2	马琳	778,432.09	0.72%
3	池航钊	602,096.97	0.56%
4	杨海峰	571,579.52	0.53%
5	陈丽珍	566,355.89	0.52%
6	李紫龙	544,872.51	0.51%
7	温东明	537,246.84	0.50%
8	林福国	499,900.00	0.46%
9	勒斌	498,456.62	0.46%
10	邵常红	459,280.00	0.43%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	----	------------	----------

	级别		
基金管理人所有从业人员持有本基金	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	109,373.72	0.10%
	合计	109,373.72	0.08%

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。

9.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	信诚中证 500 指数分级 A	0
	信诚中证 500 指数分级 B	0
	信诚中证 500 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 500 指数分级 A	0
	信诚中证 500 指数分级 B	0
	信诚中证 500 指数分级	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日（2011 年 02 月 11 日）基金份额总额	10,134,545.00	15,201,819.00	348,917,936.10
本报告期期初基金份额总额	20,827,212.00	31,240,819.00	162,143,336.86
本报告期基金总申购份额	-	-	164,019,403.86
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	248,946,583.57

本报告期基金拆分变动份额	-10,643,776.00	-15,965,664.00	30,672,244.13
报告期期末基金份额总额	10,183,436.00	15,275,155.00	107,888,401.28

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。根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算业务的公告》，基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2020 年 2 月 3 日（折算基准日）对本基金信诚中证 500 指数分级基金进行基金份额折算。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议投票表决起止时间自 2020 年 9 月 26 日起至 2020 年 10 月 26 日 17:00 止。本次会议未达到法定召开条件，会议详情请见 2020 年 10 月 29 日在规定媒介发布的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

11.2 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 90,000.00 元。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	3	4,349,028.17	0.72%	4,050.27	0.87%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	13,795,946.00	2.28%	9,813.18	2.12%	-

长江证券	2	5,844,748.28	0.97%	5,443.31	1.17%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	150,910,870.71	24.96%	107,343.90	23.15%	-
东方证券	1	10,996,484.06	1.82%	10,240.85	2.21%	-
东吴证券	2	18,487,649.41	3.06%	17,217.75	3.71%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	607,626.58	0.10%	444.38	0.10%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	146,744.54	0.02%	136.67	0.03%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	57,098,628.13	9.44%	52,887.49	11.41%	-
华西证券	2	115,739,836.63	19.14%	82,326.15	17.75%	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	20,167,440.29	3.34%	18,378.62	3.96%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	35,303,760.95	5.84%	25,087.83	5.41%	-

天风证券	3	40,203,890.31	6.65%	36,637.87	7.90%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	29,144,935.90	4.82%	21,313.66	4.60%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	816,149.52	0.13%	743.75	0.16%	-
野村东方 国际证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	100,707,586.81	16.65%	71,633.88	15.45%	-
中信建投	2	396,256.00	0.07%	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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。

11.7.2 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		基金	
	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	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	23,171.50	0.86%	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

长江证券	115,576.00	4.31%	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	592,600.90	22.11%	-	-	-	-	-	-
东方证券	96,000.00	3.58%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	253,914.20	9.47%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	35,465.00	1.32%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	578,607.20	21.59%	-	-	-	-	-	-
华西证券	18,961.40	0.71%	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	20,974.23	0.78%	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	88,946.60	3.32%	-	-	-	-	-	-
天风证券	23,860.80	0.89%	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	501,860.46	18.72%	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	330,358.42	12.33%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 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	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 01 日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	同上	2020 年 01 月 17 日
3	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第四季度报告	同上	2020 年 01 月 17 日
4	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	同上	2020 年 01 月 21 日
5	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性	同上	2020 年 01 月 30 日

	公告		
6	中信保诚基金管理有限公司关于顺延办理信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算业务的提示性公告	同上	2020 年 01 月 31 日
7	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间中证 500A 份额停复牌的公告	同上	2020 年 02 月 04 日
8	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之中证 500A 份额年约定收益率设定的公告	同上	2020 年 02 月 04 日
9	中信保诚基金管理有限公司关于中证 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	同上	2020 年 02 月 05 日
10	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	同上	2020 年 02 月 05 日
11	信诚中证 500 指数分级证券投资基金托管协议	同上	2020 年 02 月 07 日
12	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书	同上	2020 年 02 月 07 日
13	信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同	同上	2020 年 02 月 07 日
14	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	同上	2020 年 02 月 07 日
15	《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》修订前后对照表	同上	2020 年 02 月 07 日
16	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	同上	2020 年 02 月 07 日
17	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020 年 02 月 19 日
18	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道基金赎回费率优惠活动的公告	同上	2020 年 02 月 19 日
19	信诚中证 500 指数分级证券投资基金暂停场外大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	同上	2020 年 03 月 05 日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	同上	2020 年 03 月 06 日
21	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加济安财富基金申购费率优惠	同上	2020 年 03 月 12 日

	活动的公告		
22	中信保诚基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	同上	2020 年 03 月 21 日
23	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书	同上	2020 年 03 月 24 日
24	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	同上	2020 年 03 月 24 日
25	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020 年 04 月 13 日
26	中信保诚基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	同上	2020 年 04 月 14 日
27	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020 年 04 月 21 日
28	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	同上	2020 年 04 月 22 日
29	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年第一季度报告	同上	2020 年 04 月 22 日
30	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年度报告提示性公告	同上	2020 年 04 月 25 日
31	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	同上	2020 年 04 月 25 日
32	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2020 年 05 月 18 日
33	中信保诚基金管理有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告	同上	2020 年 06 月 15 日
34	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第二季度报告提示性公告	同上	2020 年 07 月 21 日
35	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年第二季度报告	同上	2020 年 07 月 21 日
36	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	同上	2020 年 08 月 28 日
37	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告	同上	2020 年 08 月 28 日
38	信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2020 年 09 月 01 日
39	关于以通讯方式召开信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	同上	2020 年 09 月 25 日
40	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基	同上	2020 年 09 月 25

	金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告		日
41	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	同上	2020 年 09 月 28 日
42	关于以通讯方式召开信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2020 年 09 月 28 日
43	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	同上	2020 年 09 月 29 日
44	关于以通讯方式召开信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	同上	2020 年 09 月 29 日
45	关于召开信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的补充公告	同上	2020 年 10 月 17 日
46	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第三季度报告提示性公告	同上	2020 年 10 月 28 日
47	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年第三季度报告	同上	2020 年 10 月 28 日
48	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之中证 500 A、中证 500 B 份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	同上	2020 年 10 月 28 日
49	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	同上	2020 年 10 月 29 日
50	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 10 月 30 日
51	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 02 日
52	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 03 日
53	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 04 日
54	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 05 日
55	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 06 日
56	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 09 日
57	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 10 日
58	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 11 日

59	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 12 日
60	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 13 日
61	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 16 日
62	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 17 日
63	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金修订基金合同的公告	同上	2020 年 11 月 18 日
64	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 18 日
65	信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同	同上	2020 年 11 月 18 日
66	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 19 日
67	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 20 日
68	信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书	同上	2020 年 11 月 21 日
69	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 23 日
70	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 24 日
71	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 25 日
72	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 26 日
73	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 27 日
74	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 11 月 30 日
75	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 12 月 01 日

76	信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告	同上	2020 年 12 月 02 日
77	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 02 日
78	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2020 年 12 月 02 日
79	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2020 年 12 月 02 日
80	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 03 日
81	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 04 日
82	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 07 日
83	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 08 日
84	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 09 日
85	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 10 日
86	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 11 日
87	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 14 日
88	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中	同上	2020 年 12 月 15 日

	证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告		日
89	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 16 日
90	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 17 日
91	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 18 日
92	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 21 日
93	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 22 日
94	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 23 日
95	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 24 日
96	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 25 日
97	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 28 日
98	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 29 日
99	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基	同上	2020 年 12 月 29

	金暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告		日
100	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额基金份额折算的公告	同上	2020 年 12 月 29 日
101	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 30 日
102	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告	同上	2020 年 12 月 31 日
103	中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议投票表决起止时间自 2020 年 9 月 26 日起至 2020 年 10 月 26 日 17:00 止。本次会议未达到法定召开条件，会议详情请见 2020 年 10 月 29 日在规定媒介发布的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关规定，基金管理人于 2020 年 11 月 18 日发布《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》，就信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的终止运作、终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排。

2020 年 12 月 2 日，基金管理人发布《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请本基金两级子份额退市。根据上述安排，基金管理人于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）对信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额办理向场内信诚中证 500 份额的折算业务，《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于基金折算基准日次日即 2021 年 1 月 1 日生效，《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证 500 指数分级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

13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 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.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2021 年 03 月 26 日