

信诚沪深 300 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	11
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	12
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	12
§ 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	17
7.4	报表附注	18
§ 8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12	投资组合报告附注	54
§ 9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末上市基金前十名持有人	56
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	58
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	58
§ 10	开放式基金份额变动	58
§ 11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8	其他重大事件	63
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13	备查文件目录	72
13.1	备查文件目录	72
13.2	存放地点	72
13.3	查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	信诚沪深 300 指数分级		
场内简称	信诚 300		
基金主代码	165515		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 02 月 01 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	246,216,048.76 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	2012 年 02 月 17 日		
下属分级基金的基金简称	信诚沪深 300 指数分级 A	信诚沪深 300 指数分级 B	信诚沪深 300 指数分级
下属分级基金场内简称	沪深 300A	沪深 300B	信诚 300
下属分级基金的交易代码	150051	150052	165515
报告期末下属分级基金的份额总额	63,726,655.00 份	63,726,655.00 份	118,762,738.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过对沪深 300 指数的跟踪复制,为投资人提供一个投资沪深 300 指数的有效工具。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法跟踪指数,即按照沪深 300 指数中成份股组成及在权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争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效跟踪标的指数的风险。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

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。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚沪深 300 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征;信诚沪深 300 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	B 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,《中信保诚沪深300指数型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》失效,基金名称变更为“中信保诚沪深300指数型证券投资基金(LOF)”。2021年1月4日,信诚沪深300指数分级证券投资基金之沪深300 A 份额和沪深300 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	证券日报
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	97,573,030.65	25,329,035.97	-10,922,506.95
本期利润	124,322,050.31	103,401,918.24	-73,968,657.13
加权平均基金份额本期利润	0.3267	0.2394	-0.2224
本期加权平均净值利润率	32.59%	27.74%	-26.07%
本期基金份额净值增长率	34.89%	34.73%	-22.34%
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	57,513,293.74	-13,410,258.39	-38,525,150.99
期末可供分配基金份额利润	0.2336	-0.0323	-0.0915
期末基金资产净值	299,747,962.15	381,927,216.56	294,569,061.74
期末基金份额净值	1.217	0.920	0.700
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	119.40%	62.65%	20.72%

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

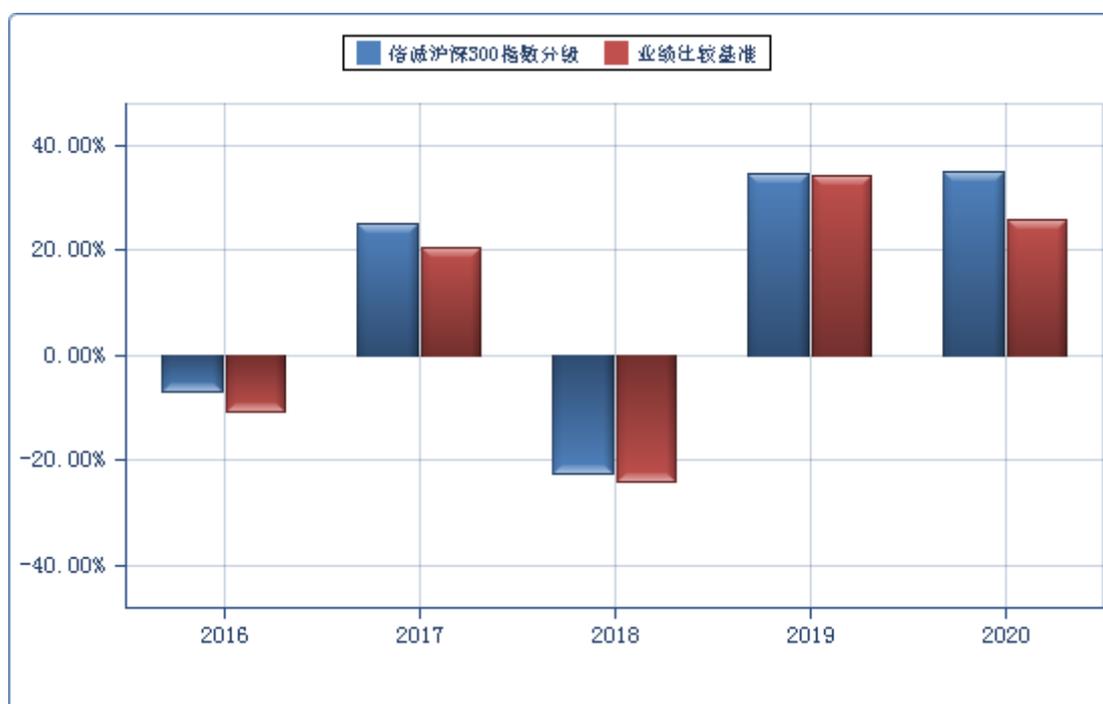
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.59%	0.94%	12.90%	0.94%	1.69%	0.00%
过去六个月	31.60%	1.25%	23.83%	1.28%	7.77%	-0.03%
过去一年	34.89%	1.35%	25.87%	1.36%	9.02%	-0.01%
过去三年	41.13%	1.26%	28.16%	1.28%	12.97%	-0.02%
过去五年	64.44%	1.18%	38.22%	1.18%	26.22%	0.00%
自基金合同生	119.40%	1.37%	106.59%	1.37%	12.81%	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		
HAN YILING	本基金基金经理、量	2018 年 04 月	-	7	计算机学硕士、信息技

	化二部副总监	10 日			术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术研究院,担任研究员;于中信保诚基金管理有限公司,担任量化投资部金融工程师;于华宝兴业基金管理有限公司,担任量化部投资经理。2016 年 6 月重新加入中信保诚基金管理有限公司,历任投资经理、基金经理助理。现任量化二部副总监,信诚沪深 300 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的基金经理。
--	--------	------	--	--	---

注: 1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚沪深 300 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 年经济,疫情对经济的影响越来越小,全球经济复苏趋势形成。随着全球范围内的复工复产拉动上游原材料价格不断上扬,最终将传递到下游消费品。四季度,有色金属、电气设备、食品饮料、休闲服务(主要是免税板块)是领涨行业;传媒、商贸、TMT 等板块表现不佳。2020 年,沪深 300 指数涨幅约 27.2%;中证 500 指数涨幅约 21.5%;创业板指数涨幅约 65%。从资产结构来看,各行业的龙头股涨幅较大。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 34.89%,同期业绩比较基准收益率为 25.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,总体来说我们更加看好估值处于合理区间的行业龙头。从疫情中复工是中国相对世界其他国家更具确定性的情况,因此全球资本流入是大势所趋。风险在于中美的大国博弈或能产生对中国较为负面的影响。

估值体系整体的变化对未来资产的定价会起到关键性的作用。第一,在过去我们给资产定估值时通常会以“资产成长性”作为主要因子,我们认为这一点会逐步从“成长”转为“稳定”。在 2020 年以后,中国在全球扮演的角色将从“制造者”逐步转为“高端制造者”,这个转型的过程说明,在成长空间上,空间在渐渐减小,提升制造难度精度,是未来的重点。第二,相对过去的资产估值,基本面属性更好的资产将获得相对更高的估值,这一点可能会成为未来给估值的关键点。也就是说,资产质量更好,估值就能给的更高,相对基本面差的公司而言,行业估值分化或成为常态。而原因很多,全球的货币政策是这个问题的根本。在未来,MMT(现代货币理论)越来越获得各经济体当局的认可,保就业的潜在问题就是对通胀不加抑制。所有资产的估值相对就会提升,而提升的过程就会是高质量资产提升更快的过程。

综上,从行业角度看我们持续看好消费、医药以及电子科技对股市的带动作用,其中核心资产的估值提升将是未来提高收益的关键。对于科创板以及未来创业板的改革抱有正向预期,未来将长期持有在科创板及创业板上市的科技龙头企业。

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 2101783 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	信诚沪深 300 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沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“信诚沪深 300 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,公允反映了信诚沪深 300 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。
形成审计意见的基础	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,我们独立于信诚沪深 300 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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>信诚沪深 300 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。其他信息包括信诚沪深 300 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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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 S 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沪深 300 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，除非信诚沪深 300 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沪深 300 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对信诚沪深 300 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沪深 300 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：信诚沪深 300 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	上年度末
		2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	23,339,938.87	21,172,433.29

结算备付金	-	266,153.43	316,002.85
存出保证金	-	55,755.83	23,220.72
交易性金融资产	7.4.7.2	288,911,251.08	361,618,569.45
其中：股票投资	-	288,051,499.98	361,537,308.65
债券投资	-	859,751.10	81,260.80
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	-	-	-
应收利息	7.4.7.5	2,877.64	4,276.27
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	7,543.04	14,737.21
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计	-	312,583,519.89	383,149,239.79
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	-	2,079.03	-
应付赎回款	-	11,904,817.70	211,011.49
应付管理人报酬	-	290,375.69	315,001.45
应付托管费	-	63,882.64	69,300.33
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	7.4.7.7	159,585.58	91,468.87
应交税费	-	3.50	0.44
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	414,813.60	535,240.65
负债合计	-	12,835,557.74	1,222,023.23
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	136,492,624.90	234,700,101.32
未分配利润	7.4.7.10	163,255,337.25	147,227,115.24
所有者权益合计	-	299,747,962.15	381,927,216.56
负债和所有者权益总计	-	312,583,519.89	383,149,239.79

注：截止本报告期末，基金份额总额 246,216,048.76 份，信诚沪深 300 指数分级的基金份额净值 1.217 元，基金份额总额 118,762,738.76 份。下属分级基金：信诚沪深 300 指数分级 A 的基金份额净值 1.002 元，基金份额总额 63,726,655.00 份；信诚沪深 300 指数分级 B 的基金份额净值 1.432 元，基金份额总额 63,726,655.00 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚沪深 300 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	-	130,929,244.10	109,570,836.59
1. 利息收入	-	129,166.63	166,181.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	128,536.06	165,885.95
债券利息收入	-	630.57	295.68
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）	-	103,776,741.17	31,213,046.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	95,892,793.85	23,010,792.47
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	287,565.45	223,563.00
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	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,596,381.87	7,978,690.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	26,749,019.66	78,072,882.27
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	274,316.64	118,726.66
减：二、费用	-	6,607,193.79	6,168,918.35
1. 管理人报酬	-	3,806,106.47	3,719,139.22
2. 托管费	-	837,343.37	818,210.62
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,461,244.04	1,069,910.10
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 税金及附加	-	2.25	0.34
7. 其他费用	7.4.7.19	502,497.66	561,658.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	124,322,050.31	103,401,918.24
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	124,322,050.31	103,401,918.24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚沪深 300 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）	234,700,101.32	147,227,115.24	381,927,216.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	124,322,050.31	124,322,050.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-98,207,476.42	-108,293,828.30	-206,501,304.72
其中：1. 基金申购款	42,922,422.80	21,728,766.56	64,651,189.36
2. 基金赎回款	-141,129,899.22	-130,022,594.86	-271,152,494.08
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）	136,492,624.90	163,255,337.25	299,747,962.15
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）	243,942,226.39	50,626,835.35	294,569,061.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	103,401,918.24	103,401,918.24
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）	-9,242,125.07	-6,801,638.35	-16,043,763.42
其中：1. 基金申购款	37,532,329.30	16,427,164.85	53,959,494.15
2. 基金赎回款	-46,774,454.37	-23,228,803.20	-70,003,257.57
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）	234,700,101.32	147,227,115.24	381,927,216.56

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

信诚沪深 300 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”）《关于核准信诚沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1472 号文）和《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2012]42 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》等相关法规和《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2012 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币

390,308,688.61 元。上述募集资金已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》，经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准，公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”，并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，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： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 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《信诚沪深 300 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《关于信诚沪深 300 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，《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》失效。于 2021 年 1 月 1 日，《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金名称由“信诚沪深 300 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚沪深 300 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（包括信诚沪深 300 份额、信诚沪深 300A 份额、信诚沪深 300B 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，如果终止信诚沪深 300A 份额与信诚沪深 300B 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	23,339,938.87	21,172,433.29
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	23,339,938.87	21,172,433.29

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	226,081,462.74	288,051,499.98	61,970,037.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	615,000.00	859,751.10
	银行间市场	-	-
	合计	615,000.00	859,751.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	226,696,462.74	288,911,251.08	62,214,788.34
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	326,088,800.77	361,537,308.65	35,448,507.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	64,000.00	81,260.80
	银行间市场	-	-
	合计	64,000.00	81,260.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	326,152,800.77	361,618,569.45	35,465,768.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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	2,462.60	4,181.31
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	53.13	23.30
应收债券利息	336.81	8.42
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	25.10	63.24
合计	2,877.64	4,276.27

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	159,585.58	91,468.87
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	159,585.58	91,468.87

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	44,813.60	740.65
应付审计费	100,000.00	160,000.00
应付信息披露费	220,000.00	320,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
应付账户维护费	-	4,500.00
合计	414,813.60	535,240.65

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	415,180,554.45	234,700,101.32
本期申购	75,526,868.51	42,702,886.99
本期赎回（以“-”号填列）	-202,076,849.78	-114,240,906.33
2020 年 12 月 15 日基金拆分/份额折算前	288,630,573.18	163,162,081.98
基金拆分/份额折算调整	5,690,869.70	-
本期申购	395,977.90	219,535.81
本期赎回（以“-”号填列）	-48,501,372.02	-26,888,992.89
本期末	246,216,048.76	136,492,624.90

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 12 月 15 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场外基金份额如下：

		单位：份			
基金代码	基金名称	本报告期末		上年度末	
		场内	场外	场内	场外
150051	沪深300A	63,726,655.00	-	145,751,122.00	-
150052	沪深300B	63,726,655.00	-	145,751,122.00	-
165515	信诚300	39,867,934.00	78,894,804.76	38,843,244.00	84,835,066.45

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	-13,410,258.39	160,637,373.63	147,227,115.24
本期利润	97,573,030.65	26,749,019.66	124,322,050.31
本期基金份额交易产生的变动数	-26,649,478.52	-81,644,349.78	-108,293,828.30
其中：基金申购款	-20,730.41	21,749,496.97	21,728,766.56
基金赎回款	-26,628,748.11	-103,393,846.75	-130,022,594.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,513,293.74	105,742,043.51	163,255,337.25

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	120,715.04	156,040.64
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	6,226.41	5,486.00
其他	1,594.61	4,359.31
合计	128,536.06	165,885.95

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	564,985,415.66	379,539,765.09
减：卖出股票成本总额	469,092,621.81	356,528,972.62
买卖股票差价收入	95,892,793.85	23,010,792.47

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	287,565.45	223,563.00
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	287,565.45	223,563.00

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）成交总额	1,169,586.48	2,215,656.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	881,700.00	1,991,800.00
减：应收利息总额	321.03	293.24
买卖债券差价收入	287,565.45	223,563.00

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	7,596,381.87	7,978,690.56
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,596,381.87	7,978,690.56

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	26,749,019.66	78,072,882.27
-- 股票投资	26,521,529.36	78,055,621.47
-- 债券投资	227,490.30	17,260.80
-- 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	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	26,749,019.66	78,072,882.27

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	272,765.42	118,615.41
转换费收入	1,551.22	111.25
合计	274,316.64	118,726.66

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低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

2、本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 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 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
交易所市场交易费用	1,461,244.04	1,069,910.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,461,244.04	1,069,910.10

7.4.7.19 其他费用

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
----	---	--

审计费用	100,000.00	160,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	4,497.66	3,658.07
账户维护费	18,000.00	18,000.00
基金上市费	60,000.00	60,000.00
合计	502,497.66	561,658.07

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《关于信诚沪深 300 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《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额基金份额折算结果的公告》，信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 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沪深 300 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沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)。《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《信诚沪深 300 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,806,106.47	3,719,139.22
其中：支付销售机构的客户维护费	417,122.44	377,004.86

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	837,343.37	818,210.62

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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	23,339,938.87	120,715.04	21,172,433.29	156,040.64

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	152	20,979.04	19,253.84	-
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	460	20,129.60	23,506.00	-
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	453	18,690.78	19,605.84	-

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	478	17,595.18	31,390.26	-
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	350	7,031.50	12,817.00	-
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	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020年 08月25 日	2021年 03月01 日	锁定期 股票	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020年 08月25 日	2021年 03月05 日	锁定期 股票	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020年 08月27 日	2021年 03月10 日	锁定期 股票	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
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	499	12,410.13	16,721.49	-
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	210	9,338.70	15,649.20	-
300888	稳健医疗	2020年 09月09 日	2021年 03月17 日	锁定期 股票	74.30	156.39	2,805	208,411.50	438,673.95	-
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	479	13,397.63	14,427.48	-
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	2020年	2021年	锁定期	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-

	食品	09月11日	03月24日	股票						
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	628	8,835.96	23,217.16	-
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	138	16,321.26	83,263.68	-
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	551	8,474.38	13,367.26	-
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	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年05月18日	锁定期股票	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
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	466	14,101.16	22,307.42	-
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	309	7,524.15	10,215.54	-
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	399	9,815.40	24,542.49	-
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	353	7,088.24	13,177.49	-
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	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年01月14日	增发流通受限	4.59	5.46	52,530	241,112.70	286,813.80	-
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	-
688055	龙腾光电	2020年08月10日	2021年02月18日	锁定期股票	1.22	8.04	45,228	55,178.16	363,633.12	-
688057	金达莱	2020年11月04日	2021年05月11日	锁定期股票	25.84	28.71	9,876	255,195.84	283,539.96	-
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	1,643	108,142.26	166,353.75	-
688330	宏力达	2020年09月28日	2021年04月15日	锁定期股票	88.23	75.87	1,679	148,138.17	127,385.73	-
688526	科前生物	2020年09月15日	2021年03月22日	锁定期股票	11.69	39.24	12,384	144,768.96	485,948.16	-

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	1,305	97,170.30	97,170.30	-
--------	------	------------------	------------------	-------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

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
113044	大秦转债	2020 年 12 月 14 日	2021 年 01 月 15 日	新发未上市	100.00	100.00	2,380	238,000.00	238,000.00	-
113616	韦尔转债	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 22 日	新发未上市	100.00	100.00	180	18,000.00	18,000.00	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	841,751.10	81,260.80
AAA 以下	18,000.00	-
未评级	-	-
合计	859,751.10	81,260.80

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期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上市公司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度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	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	23,339,938.87	-	-	-	-	-	23,339,938.87
结算备付金	266,153.43	-	-	-	-	-	266,153.43
存出保证金	55,755.83	-	-	-	-	-	55,755.83
交易性金融资产	-	-	-	859,751.10	288,051,499.98	288,911,251.08	-
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	-	-	-	-	2,877.64	2,877.64	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	7,543.04	7,543.04	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,661,848.13	-	-	859,751.10	288,061,920.66	312,583,519.89	-
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	-	-	-	-	2,079.03	2,079.03	-
应付赎回款	-	-	-	-	11,904,817.70	11,904,817.70	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	290,375.69	290,375.69	-
应付托管费	-	-	-	-	63,882.64	63,882.64	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	159,585.58	159,585.58	-
应交税费	-	-	-	-	3.50	3.50	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	414,813.60	414,813.60	-
负债总计	-	-	-	-	12,835,557.74	12,835,557.74	-

利率敏感度缺口	23,661,848.13	-	-	-	859,751.10	275,226,362.92	299,747,962.15
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	21,172,433.29	-	-	-	-	-	21,172,433.29
结算备付金	316,002.85	-	-	-	-	-	316,002.85
存出保证金	23,220.72	-	-	-	-	-	23,220.72
交易性金融资产	-	-	-	-	81,260.80	361,537,308.65	361,618,569.45
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	-	-	-	-	-	4,276.27	4,276.27
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	14,737.21	14,737.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,511,656.86	-	-	-	81,260.80	361,556,322.13	383,149,239.79
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	-	-	-	-	-	211,011.49	211,011.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	315,001.45	315,001.45
应付托管费	-	-	-	-	-	69,300.33	69,300.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	91,468.87	91,468.87
应交税费	-	-	-	-	-	0.44	0.44
应付利息	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	535,240.65	535,240.65
负债总计	-	-	-	-	-	1,222,023.23	1,222,023.23
利率敏感度缺口	21,511,656.86	-	-	-	81,260.80	360,334,298.90	381,927,216.56

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公司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	288,051,499.98	96.10	361,537,308.65	94.66
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	288,051,499.98	96.10	361,537,308.65	94.66

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%	14,006,267.02	17,897,516.57

业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-14,006,267.02	-17,897,516.57
-------------------	----------------	----------------

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 285,641,565.74 元，属于第二层次的余额为 3,269,685.34 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 360,995,853.03 元，第二层次 622,716.42 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	288,051,499.98	92.15
	其中：股票	288,051,499.98	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	859,751.10	0.28
	其中：债券	859,751.10	0.28
	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	23,606,092.30	7.55
8	其他各项资产	66,176.51	0.02
9	合计	312,583,519.89	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	3,289,050.80	1.10
B	采矿业	6,324,171.64	2.11
C	制造业	149,395,968.02	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,766,273.11	1.59
E	建筑业	4,422,593.71	1.48
F	批发和零售业	2,086,865.44	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,528,335.47	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,834,454.48	2.95
J	金融业	75,061,955.19	25.04
K	房地产业	8,323,972.44	2.78
L	租赁和商务服务业	5,503,751.40	1.84
M	科学研究和技术服务业	2,837,969.60	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	361,839.00	0.12
Q	卫生和社会工作	4,392,648.44	1.47
R	文化、体育和娱乐业	1,389,893.24	0.46
S	综合	-	-
	合计	284,519,741.98	94.92

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	2,976,949.76	0.99
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	16,322.72	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	211,067.38	0.07
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	15,649.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	283,539.96	0.09

0	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	19,253.84	0.01
S	综合	-	-
	合计	3,531,758.00	1.18

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	600519	贵州茅台	7,315	14,615,370.00	4.88
2	601318	中国平安	157,775	13,723,269.50	4.58
3	000858	五粮液	28,257	8,246,805.45	2.75
4	600036	招商银行	180,315	7,924,844.25	2.64
5	000333	美的集团	71,568	7,045,153.92	2.35
6	600276	恒瑞医药	54,327	6,055,287.42	2.02
7	601166	兴业银行	211,827	4,420,829.49	1.47
8	000651	格力电器	70,050	4,338,897.00	1.45
9	601888	中国中免	14,256	4,026,607.20	1.34
10	600887	伊利股份	88,559	3,929,362.83	1.31
11	600030	中信证券	124,400	3,657,360.00	1.22
12	601012	隆基股份	38,492	3,548,962.40	1.18
13	002475	立讯精密	61,073	3,427,416.76	1.14
14	300059	东方财富	100,353	3,110,943.00	1.04
15	600031	三一重工	86,421	3,023,006.58	1.01
16	603288	海天味业	14,220	2,851,678.80	0.95
17	000002	万科A	99,178	2,846,408.60	0.95
18	000001	平安银行	141,600	2,738,544.00	0.91
19	002415	海康威视	54,498	2,643,697.98	0.88
20	002594	比亚迪	13,223	2,569,228.90	0.86
21	601398	工商银行	510,469	2,547,240.31	0.85
22	600900	长江电力	132,513	2,538,949.08	0.85
23	603259	药明康德	18,680	2,516,569.60	0.84
24	000568	泸州老窖	10,633	2,404,759.28	0.80
25	000725	京东方A	394,606	2,367,636.00	0.79
26	002352	顺丰控股	26,500	2,338,095.00	0.78
27	002714	牧原股份	27,300	2,104,830.00	0.70

28	600309	万华化学	22,898	2,084,633.92	0.70
29	002304	洋河股份	8,785	2,073,172.15	0.69
30	601601	中国太保	49,897	1,916,044.80	0.64
31	600809	山西汾酒	5,100	1,913,979.00	0.64
32	601899	紫金矿业	200,200	1,859,858.00	0.62
33	000661	长春高新	4,100	1,840,531.00	0.61
34	600585	海螺水泥	34,977	1,805,512.74	0.60
35	300015	爱尔眼科	24,036	1,800,056.04	0.60
36	601328	交通银行	400,200	1,792,896.00	0.60
37	600000	浦发银行	171,033	1,655,599.44	0.55
38	600048	保利地产	104,610	1,654,930.20	0.55
39	600690	海尔智家	55,174	1,611,632.54	0.54
40	600016	民生银行	309,916	1,611,563.20	0.54
41	002142	宁波银行	43,717	1,544,958.78	0.52
42	601688	华泰证券	85,733	1,544,051.33	0.52
43	601668	中国建筑	305,654	1,519,100.38	0.51
44	600438	通威股份	39,400	1,514,536.00	0.51
45	002027	分众传媒	149,660	1,477,144.20	0.49
46	603501	韦尔股份	6,300	1,455,930.00	0.49
47	600837	海通证券	112,547	1,447,354.42	0.48
48	000100	TCL 科技	204,410	1,447,222.80	0.48
49	300124	汇川技术	15,055	1,404,631.50	0.47
50	300122	智飞生物	9,300	1,375,563.00	0.46
51	300014	亿纬锂能	16,500	1,344,750.00	0.45
52	000063	中兴通讯	39,291	1,322,142.15	0.44
53	601288	农业银行	418,474	1,314,008.36	0.44
54	600570	恒生电子	12,151	1,274,639.90	0.43
55	600999	招商证券	54,065	1,261,877.10	0.42
56	600104	上汽集团	51,046	1,247,564.24	0.42
57	002241	歌尔股份	33,080	1,234,545.60	0.41
58	300347	泰格医药	7,600	1,228,236.00	0.41
59	300498	温氏股份	64,960	1,184,220.80	0.40
60	600436	片仔癀	4,400	1,177,044.00	0.39
61	601211	国泰君安	65,700	1,151,721.00	0.38
62	601229	上海银行	144,830	1,135,467.20	0.38
63	002460	赣锋锂业	11,100	1,123,320.00	0.37
64	000338	潍柴动力	69,844	1,102,836.76	0.37
65	002410	广联达	13,800	1,086,612.00	0.36
66	600009	上海机场	14,081	1,065,368.46	0.36
67	002230	科大讯飞	25,595	1,046,067.65	0.35
68	601169	北京银行	215,533	1,043,179.72	0.35

69	600588	用友网络	23,776	1,043,053.12	0.35
70	600660	福耀玻璃	20,397	980,075.85	0.33
71	601988	中国银行	306,971	976,167.78	0.33
72	600919	江苏银行	174,830	954,571.80	0.32
73	600196	复星医药	17,587	949,522.13	0.32
74	603986	兆易创新	4,780	944,050.00	0.31
75	601766	中国中车	177,207	940,969.17	0.31
76	601628	中国人寿	24,283	932,224.37	0.31
77	002271	东方雨虹	24,000	931,200.00	0.31
78	601818	光大银行	231,919	925,356.81	0.31
79	600893	航发动力	15,500	919,925.00	0.31
80	600763	通策医疗	3,300	912,516.00	0.30
81	002812	恩捷股份	6,400	907,392.00	0.30
82	600406	国电南瑞	33,645	893,947.65	0.30
83	600703	三安光电	32,669	882,389.69	0.29
84	300601	康泰生物	5,004	873,198.00	0.29
85	300142	沃森生物	22,500	867,600.00	0.29
86	601088	中国神华	47,997	864,425.97	0.29
87	600346	恒力石化	30,768	860,580.96	0.29
88	601919	中远海控	70,463	860,353.23	0.29
89	000538	云南白药	7,451	846,433.60	0.28
90	002049	紫光国微	6,200	829,622.00	0.28
91	002493	荣盛石化	29,500	814,495.00	0.27
92	603799	华友钴业	10,142	804,260.60	0.27
93	600028	中国石化	194,881	785,370.43	0.26
94	601390	中国中铁	148,307	781,577.89	0.26
95	600019	宝钢股份	129,715	771,804.25	0.26
96	002311	海大集团	11,700	766,350.00	0.26
97	000768	中航西飞	20,600	755,608.00	0.25
98	300413	芒果超媒	10,340	749,650.00	0.25
99	000876	新希望	32,782	734,316.80	0.24
100	000895	双汇发展	15,414	723,533.16	0.24
101	600745	闻泰科技	7,300	722,700.00	0.24
102	601336	新华保险	12,380	717,668.60	0.24
103	000625	长安汽车	32,508	711,275.04	0.24
104	000166	申万宏源	134,084	707,963.52	0.24
105	600958	东方证券	60,867	707,883.21	0.24
106	601009	南京银行	87,266	705,109.28	0.24
107	000776	广发证券	43,076	701,277.28	0.23
108	600584	长电科技	16,300	693,891.00	0.23
109	601633	长城汽车	18,100	684,361.00	0.23

110	601377	兴业证券	78,017	677,187.56	0.23
111	002129	中环股份	26,500	675,750.00	0.23
112	000157	中联重科	68,010	673,299.00	0.22
113	002007	华兰生物	15,930	672,883.20	0.22
114	600741	华域汽车	22,977	662,197.14	0.22
115	002050	三花智控	26,732	658,943.80	0.22
116	600926	杭州银行	44,120	658,270.40	0.22
117	603993	洛阳钼业	105,100	656,875.00	0.22
118	002371	北方华创	3,600	650,664.00	0.22
119	002001	新和成	19,200	646,656.00	0.22
120	002179	中航光电	8,220	643,543.80	0.21
121	601100	恒立液压	5,668	640,484.00	0.21
122	600547	山东黄金	27,080	639,629.60	0.21
123	601901	方正证券	61,192	634,561.04	0.21
124	601877	正泰电器	16,000	626,560.00	0.21
125	001979	招商蛇口	47,100	625,959.00	0.21
126	600176	中国巨石	31,300	624,748.00	0.21
127	600050	中国联通	138,373	617,143.58	0.21
128	000786	北新建材	15,100	604,755.00	0.20
129	300408	三环集团	16,200	603,450.00	0.20
130	300433	蓝思科技	19,549	598,394.89	0.20
131	002821	凯莱英	2,000	598,280.00	0.20
132	601857	中国石油	144,140	598,181.00	0.20
133	002555	三七互娱	18,899	590,215.77	0.20
134	601066	中信建投	14,000	588,000.00	0.20
135	002736	国信证券	42,925	585,497.00	0.20
136	002202	金风科技	41,068	585,219.00	0.20
137	600109	国金证券	35,931	584,597.37	0.20
138	600015	华夏银行	91,565	572,281.25	0.19
139	601006	大秦铁路	88,409	571,122.14	0.19
140	601989	中国重工	135,632	568,298.08	0.19
141	002841	视源股份	4,900	563,647.00	0.19
142	000860	顺鑫农业	7,700	558,558.00	0.19
143	002601	龙蟠佰利	18,100	556,937.00	0.19
144	601225	陕西煤业	59,497	555,701.98	0.19
145	688008	澜起科技	6,600	547,008.00	0.18
146	601186	中国铁建	68,325	539,767.50	0.18
147	601788	光大证券	29,094	538,820.88	0.18
148	603369	今世缘	9,300	533,634.00	0.18
149	002236	大华股份	26,748	532,017.72	0.18
150	002008	大族激光	12,435	531,596.25	0.18

151	603160	汇顶科技	3,400	528,870.00	0.18
152	600600	青岛啤酒	5,300	526,820.00	0.18
153	600352	浙江龙盛	38,664	526,603.68	0.18
154	600872	中炬高新	7,900	526,535.00	0.18
155	002624	完美世界	17,350	511,825.00	0.17
156	603019	中科曙光	14,840	507,973.20	0.17
157	002938	鹏鼎控股	10,100	501,667.00	0.17
158	300003	乐普医疗	18,442	501,253.56	0.17
159	000066	中国长城	25,600	486,144.00	0.16
160	603899	晨光文具	5,400	478,224.00	0.16
161	600760	中航沈飞	6,100	476,898.00	0.16
162	002600	领益智造	39,600	474,804.00	0.16
163	000783	长江证券	56,335	473,214.00	0.16
164	688012	中微公司	3,000	472,770.00	0.16
165	600183	生益科技	16,700	470,272.00	0.16
166	601108	财通证券	36,600	462,990.00	0.15
167	000596	古井贡酒	1,700	462,400.00	0.15
168	601155	新城控股	13,170	458,711.10	0.15
169	002044	美年健康	39,880	451,840.40	0.15
170	003816	中国广核	160,100	451,482.00	0.15
171	601985	中国核电	90,638	445,938.96	0.15
172	601555	东吴证券	45,180	445,474.80	0.15
173	600383	金地集团	32,884	443,934.00	0.15
174	601669	中国电建	111,100	431,068.00	0.14
175	000938	紫光股份	20,789	425,135.05	0.14
176	000069	华侨城 A	59,704	423,301.36	0.14
177	601360	三六零	26,900	422,599.00	0.14
178	002024	苏宁易购	54,244	418,221.24	0.14
179	600111	北方稀土	31,797	416,222.73	0.14
180	002456	欧菲光	31,377	413,548.86	0.14
181	002384	东山精密	15,600	405,600.00	0.14
182	300144	宋城演艺	22,867	405,203.24	0.14
183	601878	浙商证券	26,300	402,390.00	0.13
184	300136	信维通信	11,200	401,856.00	0.13
185	601933	永辉超市	55,474	398,303.32	0.13
186	600029	南方航空	66,787	398,050.52	0.13
187	000977	浪潮信息	14,800	397,824.00	0.13
188	601138	工业富联	28,900	395,641.00	0.13
189	600010	包钢股份	332,000	388,440.00	0.13
190	601800	中国交建	53,305	386,994.30	0.13
191	600522	中天科技	35,700	386,988.00	0.13

192	300529	健帆生物	5,700	386,574.00	0.13
193	600795	国电电力	171,715	386,358.75	0.13
194	002602	世纪华通	54,264	385,817.04	0.13
195	300033	同花顺	3,100	384,338.00	0.13
196	000425	徐工机械	71,017	381,361.29	0.13
197	002607	中公教育	10,300	361,839.00	0.12
198	601600	中国铝业	98,948	359,181.24	0.12
199	002414	高德红外	8,600	359,050.00	0.12
200	603833	欧派家居	2,640	355,080.00	0.12
201	600705	中航资本	81,056	355,025.28	0.12
202	600161	天坛生物	8,500	354,450.00	0.12
203	600061	国投资本	25,586	353,854.38	0.12
204	000963	华东医药	13,213	350,937.28	0.12
205	600886	国投电力	40,588	350,680.32	0.12
206	601838	成都银行	32,800	349,976.00	0.12
207	002463	沪电股份	18,300	343,857.00	0.11
208	000703	恒逸石化	26,850	343,680.00	0.11
209	000728	国元证券	38,163	341,940.48	0.11
210	601111	中国国航	45,258	338,982.42	0.11
211	601607	上海医药	17,425	334,560.00	0.11
212	600066	宇通客车	19,339	327,215.88	0.11
213	002157	正邦科技	19,100	325,464.00	0.11
214	600606	绿地控股	55,300	322,399.00	0.11
215	300676	华大基因	2,500	321,400.00	0.11
216	600115	东方航空	67,783	317,224.44	0.11
217	600362	江西铜业	15,705	313,314.75	0.10
218	600340	华夏幸福	23,688	306,285.84	0.10
219	601021	春秋航空	5,500	304,865.00	0.10
220	688036	传音控股	2,000	304,280.00	0.10
221	601162	天风证券	49,600	302,560.00	0.10
222	600177	雅戈尔	42,015	302,087.85	0.10
223	600487	亨通光电	21,460	300,225.40	0.10
224	300628	亿联网络	4,100	299,792.00	0.10
225	600011	华能国际	66,400	297,472.00	0.10
226	603658	安图生物	2,000	290,360.00	0.10
227	601816	京沪高铁	51,100	289,226.00	0.10
228	601727	上海电气	53,204	287,301.60	0.10
229	000656	金科股份	40,500	287,145.00	0.10
230	002422	科伦药业	14,700	285,768.00	0.10
231	601618	中国中冶	103,982	283,870.86	0.09
232	002508	老板电器	6,955	283,624.90	0.09

233	002252	上海莱士	38,300	283,420.00	0.09
234	002916	深南电路	2,620	283,117.20	0.09
235	601198	东兴证券	20,900	278,388.00	0.09
236	600118	中国卫星	8,600	276,748.00	0.09
237	002673	西部证券	26,500	268,710.00	0.09
238	600637	东方明珠	29,870	267,037.80	0.09
239	002120	韵达股份	16,915	265,565.50	0.09
240	600068	葛洲坝	40,241	264,785.78	0.09
241	600369	西南证券	48,400	260,392.00	0.09
242	600498	烽火通信	10,600	255,248.00	0.09
243	601216	君正集团	51,238	253,628.10	0.08
244	600004	白云机场	17,900	252,927.00	0.08
245	002773	康弘药业	5,250	252,787.50	0.08
246	000961	中南建设	28,600	252,538.00	0.08
247	600332	白云山	8,526	249,385.50	0.08
248	600489	中金黄金	28,286	249,199.66	0.08
249	601658	邮储银行	51,800	247,604.00	0.08
250	601881	中国银河	19,500	243,945.00	0.08
251	600018	上港集团	52,568	240,235.76	0.08
252	600390	五矿资本	34,040	237,599.20	0.08
253	601998	中信银行	46,400	237,104.00	0.08
254	002739	万达电影	13,000	235,040.00	0.08
255	600845	宝信软件	3,200	220,736.00	0.07
256	600233	圆通速递	19,100	219,650.00	0.07
257	601117	中国化学	36,700	215,429.00	0.07
258	002958	青农商行	41,300	210,217.00	0.07
259	600271	航天信息	16,518	208,126.80	0.07
260	601319	中国人保	31,000	203,670.00	0.07
261	002558	巨人网络	11,600	202,188.00	0.07
262	600998	九州通	11,100	201,576.00	0.07
263	601231	环旭电子	10,400	201,136.00	0.07
264	600655	豫园股份	22,600	200,914.00	0.07
265	603156	养元饮品	7,652	197,727.68	0.07
266	600208	新湖中宝	62,578	193,991.80	0.06
267	601990	南京证券	15,600	191,412.00	0.06
268	600085	同仁堂	7,976	190,626.40	0.06
269	002032	苏泊尔	2,400	187,176.00	0.06
270	600482	中国动力	10,200	182,784.00	0.06
271	600297	广汇汽车	63,760	182,353.60	0.06
272	601238	广汽集团	13,500	179,415.00	0.06
273	002939	长城证券	13,600	175,032.00	0.06

274	600848	上海临港	8,700	174,174.00	0.06
275	600027	华电国际	51,200	174,080.00	0.06
276	601916	浙商银行	42,400	172,992.00	0.06
277	000671	阳光城	25,900	168,868.00	0.06
278	002146	荣盛发展	25,318	165,326.54	0.06
279	600918	中泰证券	8,500	157,250.00	0.05
280	002153	石基信息	5,033	156,475.97	0.05
281	000723	美锦能源	23,300	155,644.00	0.05
282	000627	天茂集团	31,000	150,970.00	0.05
283	601577	长沙银行	15,500	147,560.00	0.05
284	603195	公牛集团	700	143,703.00	0.05
285	601236	红塔证券	7,600	141,284.00	0.05
286	600150	中国船舶	7,500	132,675.00	0.04
287	688009	中国通号	22,200	130,092.00	0.04
288	600989	宝丰能源	10,900	127,530.00	0.04
289	600025	华能水电	27,200	121,312.00	0.04
290	601698	中国卫通	6,400	116,096.00	0.04
291	601808	中海油服	9,000	114,930.00	0.04
292	601077	渝农商行	21,800	98,100.00	0.03
293	601872	招商轮船	11,800	66,670.00	0.02
294	603392	万泰生物	300	60,459.00	0.02
295	002945	华林证券	3,900	58,773.00	0.02
296	600299	安迪苏	4,300	49,493.00	0.02

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	688526	科前生物	12,384	485,948.16	0.16
2	300888	稳健医疗	2,805	438,673.95	0.15
3	688055	龙腾光电	45,228	363,633.12	0.12
4	688686	奥普特	1,515	328,452.00	0.11
5	300894	火星人	6,279	300,116.16	0.10
6	688057	金达莱	9,876	283,539.96	0.09
7	688229	博睿数据	1,643	166,353.75	0.06
8	688330	宏力达	1,679	127,385.73	0.04
9	300922	天秦装备	2,863	108,883.46	0.04
10	688617	惠泰医疗	1,305	97,170.30	0.03
11	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
12	300896	爱美客	138	83,263.68	0.03
13	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
14	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01

15	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
16	300919	中伟股份	399	24,542.49	0.01
17	300861	美畅股份	460	23,506.00	0.01
18	300910	瑞丰新材	466	22,307.42	0.01
19	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.01
20	300868	杰美特	453	19,605.84	0.01
21	300878	维康药业	401	19,536.72	0.01
22	300860	锋尚文化	152	19,253.84	0.01
23	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
24	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
25	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
26	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.01
27	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.01
28	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
29	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
30	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.01
31	300909	汇创达	386	15,698.62	0.01
32	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.01
33	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.01
34	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
35	603260	合盛硅业	420	14,044.80	0.00
36	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
37	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
38	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
39	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
40	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
41	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
42	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
43	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
44	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
45	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
46	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
47	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
48	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
49	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
50	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
51	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
52	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
53	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	000858	五 粮 液	22,439,255.06	5.88
2	600547	山东黄金	12,093,306.19	3.17
3	601318	中国平安	11,111,919.53	2.91
4	002714	牧原股份	10,443,790.40	2.73
5	600519	贵州茅台	9,635,553.94	2.52
6	600030	中信证券	8,887,557.61	2.33
7	603259	药明康德	8,185,396.08	2.14
8	300498	温氏股份	7,409,659.80	1.94
9	600887	伊利股份	7,137,078.00	1.87
10	300347	泰格医药	6,716,858.00	1.76
11	601012	隆基股份	6,628,264.71	1.74
12	600036	招商银行	5,974,531.00	1.56
13	300601	康泰生物	5,539,181.72	1.45
14	601601	中国太保	5,442,744.72	1.43
15	002007	华兰生物	4,507,069.00	1.18
16	601899	紫金矿业	4,444,806.00	1.16
17	600438	通威股份	4,282,177.00	1.12
18	600276	恒瑞医药	4,189,985.00	1.10
19	000876	新 希 望	4,008,538.00	1.05
20	600919	江苏银行	3,949,025.70	1.03

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	000858	五 粮 液	28,509,243.82	7.46
2	601318	中国平安	22,856,686.90	5.98
3	600519	贵州茅台	19,420,639.94	5.08
4	601012	隆基股份	16,495,005.00	4.32
5	600030	中信证券	11,101,898.41	2.91
6	600547	山东黄金	10,453,337.66	2.74
7	002714	牧原股份	10,402,375.50	2.72
8	600887	伊利股份	9,866,057.16	2.58
9	600036	招商银行	9,678,376.86	2.53
10	600438	通威股份	8,732,415.94	2.29
11	000333	美的集团	8,418,719.68	2.20
12	300498	温氏股份	8,382,693.56	2.19
13	600276	恒瑞医药	8,363,016.32	2.19

14	002475	立讯精密	7,710,400.70	2.02
15	000651	格力电器	7,057,504.99	1.85
16	603259	药明康德	6,990,013.00	1.83
17	688981	中芯国际	6,989,414.69	1.83
18	601601	中国太保	6,493,772.00	1.70
19	601899	紫金矿业	6,366,065.00	1.67
20	300347	泰格医药	6,289,930.22	1.65

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	369,085,283.78
卖出股票收入（成交）总额	564,985,415.66

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）	859,751.10	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	859,751.10	0.29

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	113038	隆 20 转债	3,090	544,736.10	0.18
2	113044	大秦转债	2,380	238,000.00	0.08
3	113043	财通转债	500	59,015.00	0.02
4	113616	韦尔转债	180	18,000.00	0.01

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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。

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

兴业银行股份有限公司于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日分别受到中国银保监会福建监管局、中国人民银行福州中心支行处罚(闽银保监罚决字(2020)24 号、福银罚字(2020)35 号),兴业银行因向同业投资用途不合规等违法违规行为被没收违法所得 6,361,807.97 元,并合计处以罚款 15,961,807.97 元;因向无证机构提供转接清算服务等违法违规行为被给予警告,没收违法所得 10,875,088.15 元,并处 13,824,431.23 元罚款。

对“兴业银行”的投资决策程序的说明:兴业银行为沪深 300 指数的成分股。该银行于 2020 年 8 月 31 日和 2020 年 9 月 4 日发生的违规事件受到监管部门处罚。基金经理对事件的影响做了分析后认为,此类类型的处罚事件不会对公司的企业经营和投资价值产生太大的影响;另外,根据量化模型,基金经理也控制了其在投资组合中的占比,防止意外风险发生。因此我们认为投资策略没有决策性问题。

除此之外，其余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	55,755.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,877.64
5	应收申购款	7,543.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,176.51

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	688526	科前生物	485,948.16	0.16	锁定期股票
2	300888	稳健医疗	438,673.95	0.15	锁定期股票
3	688055	龙腾光电	363,633.12	0.12	锁定期股票
4	300894	火星人	23,217.16	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
信诚沪深 300 指数分级 A	413	154,301.83	48,437,601.00	76.01%	15,289,054.00	23.99%
信诚沪深 300 指数分级 B	3,067	20,778.17	5,482,518.00	8.60%	58,244,137.00	91.40%
信诚沪深 300 指数分级	7,557	15,715.59	63,395,348.68	53.38%	55,367,390.08	46.62%
合计	11,037	22,308.24	117,315,467.68	47.65%	128,900,581.08	52.35%

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

信诚沪深 300 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	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽夏天量化套利 2 号私募证券投资基金	11,640,087.00	18.27%
2	中国银河证券股份有限公司	8,207,933.00	12.88%
3	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽艾比之路私募证券投资基金	6,582,000.00	10.33%
4	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽夏天 1 号私募证券投资基金	4,588,200.00	7.20%
5	陈斌	4,124,035.00	6.47%
6	华金证券—兴业银行—华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划	3,200,000.00	5.02%
7	华金证券—兴业银行—华金证券增利稳进 1 号集合资产管理计划	3,000,000.00	4.71%
8	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽夏天量化套利 3 号私募证券投资基金	2,885,000.00	4.53%
9	华金证券—兴业银行—华金证券股份有限公司量化	2,000,000.00	3.14%

	博睿 1 号集合资产管理计划		
10	上海斯诺波投资管理有限公司—汇海浩洋私募证券投资基金	1,974,500.00	3.10%

信诚沪深 300 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	薛宏飞	3,466,903.00	5.44%
2	鑫牛润瀛(天津)股权投资基金管理有限公司	2,870,500.00	4.50%
3	苏振华	1,796,618.00	2.82%
4	陈若州	1,715,500.00	2.69%
5	王晓刚	1,661,470.00	2.61%
6	陈志伟	1,462,719.00	2.30%
7	庄万云	1,447,627.00	2.27%
8	徐亚英	1,447,328.00	2.27%
9	深圳市康曼德资本管理有限公司—康曼德 201 号私募证券投资基金	1,362,431.00	2.14%
10	周云鹤	1,041,701.00	1.63%

信诚沪深 300 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	中国人寿保险股份有限公司	60,634,737.02	51.06%
2	胡勇	2,239,022.00	1.89%
3	童玲华	2,142,000.00	1.80%
4	朱群江	1,732,000.00	1.46%
5	中国人寿保险股份有限公司—分红账户	1,541,872.95	1.30%
6	金兆玮	1,492,956.00	1.26%
7	胡晔	1,480,000.00	1.25%
8	郑凯鹏	1,319,248.00	1.11%
9	田杰	1,110,358.00	0.93%
10	杨淼莹	1,103,700.00	0.93%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信诚沪深 300 指数分级 A	-	-
	信诚沪深 300 指数分级 B	-	-
	信诚沪深 300 指	150,070.87	0.13%

	数分级		
	合计	150,070.87	0.06%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	信诚沪深 300 指数分级 A	0
	信诚沪深 300 指数分级 B	0
	信诚沪深 300 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚沪深 300 指数分级 A	0
	信诚沪深 300 指数分级 B	0
	信诚沪深 300 指数分级	0
	合计	0

注：1、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

2、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。

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	信诚沪深 300 指数分级 A	信诚沪深 300 指数分级 B	信诚沪深 300 指数分级
基金合同生效日（2012 年 02 月 01 日）基金份额总额	83,336,256.00	83,336,257.00	223,636,175.61
本报告期期初基金份额总额	145,751,122.00	145,751,122.00	123,678,310.45
本报告期基金总申购份额	-	-	75,922,846.41
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	250,578,221.80
本报告期基金拆分变动份额	-82,024,467.00	-82,024,467.00	169,739,803.70
报告期期末基金份额总额	63,726,655.00	63,726,655.00	118,762,738.76

注：1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额以及因份额折算产生的份额。2. 根据《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》、《中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金办理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 12 月 15 日(折算基准日)对本基金进行了基金份额折算。3. 本报告期因折算导致的份额拆分变动情况, 详见本管理人届时发布的折算结果公告。

§ 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 24 日起至 2020 年 10 月 23 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 28 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沪深 300 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 100,000.00 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	1,022,329.02	0.11%	952.09	0.13%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	52,195,173.44	5.70%	48,609.17	6.42%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	2	56,404,610.32	6.16%	40,121.26	5.30%	-
东方证券	1	31,442,643.61	3.43%	29,282.06	3.87%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	38,486,123.54	4.20%	35,072.37	4.64%	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	118,959,342.34	12.99%	86,995.02	11.50%	-
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	59,532,497.53	6.50%	54,251.61	7.17%	-
国元证券	1	6,869,917.07	0.75%	4,714.20	0.62%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	20,673,789.99	2.26%	19,184.42	2.54%	-
华西证券	2	87,647,904.16	9.57%	62,343.70	8.24%	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	41,948,496.03	4.58%	38,946.73	5.15%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	5	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	70,389,064.72	7.69%	50,066.25	6.62%	-
天风证券	3	70,929,569.30	7.75%	64,637.95	8.54%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	61,323,114.85	6.70%	44,845.59	5.93%	-
西南证券	2	99,335,048.14	10.85%	92,390.10	12.21%	-

信达证券	2	49,603,132.12	5.42%	46,195.85	6.11%	-
兴业证券	2	16,726,725.32	1.83%	15,242.76	2.01%	-
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	31,872,026.94	3.48%	22,670.73	3.00%	-
中信建投	2	106,576.43	0.01%	97.13	0.01%	-
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	81,762.00	3.14%	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	256,000.00	9.84%	-	-	-	-	-	-
东方证券	93,000.00	3.57%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	423,000.00	16.25%	-	-	-	-	-	-
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	492,607.00	18.93%	-	-	-	-	-	-
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	462,700.00	17.78%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	148,000.00	5.69%	-	-	-	-	-	-
天风证券	54,294.59	2.09%	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	287,362.32	11.04%	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	303,560.57	11.67%	-	-	-	-	-	-
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	《证券日报》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	信诚沪深 300 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调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告	同上	2020 年 01 月 30 日
5	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议	同上	2020 年 02 月 07 日
6	信诚沪深 300 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
7	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同	同上	2020 年 02 月 07 日
8	信诚沪深 300 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
9	《信诚沪深 300 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
10	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
11	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
12	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	同上	2020 年 02 月 19 日

	活动的公告		
13	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
14	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活动的公告	同上	2020 年 03 月 12 日
15	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 20 日
16	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
17	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 23 日
18	信诚沪深 300 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
19	信诚沪深 300 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
20	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 交易价格波动提示公告	同上	2020 年 03 月 24 日
21	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 25 日
22	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 26 日
23	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 27 日
24	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 30 日
25	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 03 月 31 日
26	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 01 日
27	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 02 日
28	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 03 日
29	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 07 日
30	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 08 日
31	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 09 日
32	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 10 日

33	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 13 日
34	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
35	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 14 日
36	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
37	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 15 日
38	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 16 日
39	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 17 日
40	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
41	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
42	信诚沪深 300 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
43	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
44	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	同上	2020 年 04 月 25 日
45	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 04 月 30 日
46	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 05 月 06 日
47	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 05 月 07 日
48	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 05 月 08 日
49	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 05 月 11 日
50	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
51	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 07 月 03 日
52	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之	同上	2020 年 07 月 06 日

	沪深 300B 交易价格波动提示及停复牌公告		日
53	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 07 月 07 日
54	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 07 月 08 日
55	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300B 溢价风险提示公告	同上	2020 年 07 月 10 日
56	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
57	信诚沪深 300 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
58	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
59	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告	同上	2020 年 08 月 28 日
60	信诚沪深 300 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
61	关于信诚沪深 300 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 23 日
62	关于以通讯方式召开信诚沪深 300 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 23 日
63	关于信诚沪深 300 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 24 日
64	关于以通讯方式召开信诚沪深 300 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 24 日
65	关于以通讯方式召开信诚沪深 300 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 25 日
66	关于信诚沪深 300 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 25 日
67	关于信诚沪深 300 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
68	关于信诚沪深 300 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
69	关于召开信诚沪深 300 指数分级证券投	同上	2020 年 10 月 17

	资基金基金份额持有人大会的补充公告		日
70	关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之沪深 300A、沪深 300B 份额持有人大会会计票日停牌的提示性公告	同上	2020 年 10 月 27 日
71	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
72	信诚沪深 300 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
73	关于信诚沪深 300 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 28 日
74	关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金整改的提示性公告	同上	2020 年 10 月 29 日
75	关于信诚沪深 300 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
76	关于信诚沪深 300 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
77	关于信诚沪深 300 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
78	关于信诚沪深 300 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
79	关于信诚沪深 300 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
80	关于信诚沪深 300 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
81	关于信诚沪深 300 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
82	关于信诚沪深 300 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
83	关于信诚沪深 300 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
84	关于信诚沪深 300 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
85	关于信诚沪深 300 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
86	关于信诚沪深 300 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
87	关于信诚沪深 300 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
88	关于信诚沪深 300 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
89	关于信诚沪深 300 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
90	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基	同上	2020 年 11 月 18

	金合同		日
91	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
92	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
93	信诚沪深 300 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
94	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
95	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
96	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
97	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
98	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
99	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
100	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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
101	信诚沪深 300 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
102	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 02 日
103	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2020 年 12 月 02 日
104	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2020 年 12 月 02 日
105	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪	同上	2020 年 12 月 03 日

	深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告		
106	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 04 日
107	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 07 日
108	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 08 日
109	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 09 日
110	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 10 日
111	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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 12 月 10 日
112	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 11 日
113	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 14 日
114	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 15 日
115	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间沪深 300A 份额停复牌的公告	同上	2020 年 12 月 16 日
116	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额年约定收益率设定的公告	同上	2020 年 12 月 16 日

117	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 16 日
118	中信保诚基金管理有限公司关于沪深 300A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	同上	2020 年 12 月 17 日
119	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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 12 月 17 日
120	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 17 日
121	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 18 日
122	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 21 日
123	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 22 日
124	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 23 日
125	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 24 日
126	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 25 日
127	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 28 日
128	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪	同上	2020 年 12 月 29 日

	深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告		
129	关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	同上	2020 年 12 月 29 日
130	关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额基金份额折算的公告	同上	2020 年 12 月 29 日
131	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 30 日
132	中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额终止运作的特别风险提示公告	同上	2020 年 12 月 31 日
133	关于信诚沪深 300 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

§ 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

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	1	2020-12-14 至 2020-12-31	-	62,146,798.00	1,512,060.98	60,634,737.02	24.63%
个人							
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p>							

(4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
 (5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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 24 日起至 2020 年 10 月 23 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 28 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沪深 300 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《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》, 就信诚沪深 300A 份额与信诚沪深 300B 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《信诚沪深 300 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)对信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额办理向场内信诚沪深 300 份额的折算业务,《中信保诚沪深 300 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,《信诚沪深 300 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、信诚沪深 300 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、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚沪深 300 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