# 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金
# 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 04 月 25 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 2020 年 4 月 24 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 2019 年 01 月 01 日起至 2019 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 ..... 6
§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 ..... 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 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遵规守信情况声明 ..... 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 ..... 16
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 ..... 36
8.1 期末基金资产组合情况 ..... 36
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 36
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 ..... 38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 41
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 ..... 42

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 ..... 42
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 ..... 42
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 ..... 42
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 42
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 42
8.12 投资组合报告附注 ..... 42
§9 基金份额持有人信息 ..... 43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 43
9.2 期末上市基金前十名持有人 ..... 44
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 45
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 ..... 45
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 46
§10 开放式基金份额变动 ..... 46
§11 重大事件揭示 ..... 46
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 46
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 ..... 46
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 46
11.4 基金投资策略的改变 ..... 46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 47
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 ..... 47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 47
11.8 其他重大事件 ..... 50
§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 53
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 ..... 54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 54
§13 备查文件目录 ..... 54
13.1 备查文件目录 ..... 54
13.2 存放地点 ..... 54
13.3 查阅方式 ..... 54

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名称 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 | | |
| 场内简称 | 信诚 TMT | | |
| 基金主代码 | 165522 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 28 日 | | |
| 基金管理人 | 中信保诚基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 114,771,820.16 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 上市日期 | 2014 年 12 月 22 日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 A | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 |
| 下属分级基金场内简称 | TMT 中证 A | TMT 中证 B | 信诚 TMT |
| 下属分级基金的交易代码 | 150173 | 150174 | 165522 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,717,174.00 份 | 11,717,174.00 份 | 91,337,472.16 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 TMT 产业主题指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。 |
| 投资策略 | 本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。<br>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 指数的风险。 | | |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 TMT 产业主题指数收益率+5%×金融同业存款利率。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 | | |
| 下属分级基金的风险收益特征 | TMT 中证 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征 | TMT 中证 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征 | 本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

**2.3 基金管理人和基金托管人**

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 中信保诚基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周浩 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-68649788 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | hao.zhou@citicprufunds.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-666-0066 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-50120888 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 张翔燕 | 田国立 |

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。
本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

**2.4 信息披露方式**

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.citicprufunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

**2.5 其他相关资料**

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 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 | 2019 年 | 2018 年 | 2017 年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -7,271,344.12 | -54,256,129.14 | -57,330,776.40 |
| 本期利润 | 52,694,857.32 | -69,925,391.47 | -15,689,218.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4011 | -0.2842 | -0.0356 |
| 本期加权平均净值利润率 | 38.01% | -35.68% | -4.50% |
| 本期基金份额净值增长率 | 52.66% | -32.25% | -5.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配利润 | -159,416,249.14 | -178,213,995.22 | -257,792,529.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -1.3890 | -1.3667 | -0.6456 |
| 期末基金资产净值 | 138,451,029.97 | 104,908,952.73 | 296,282,078.61 |
| 期末基金份额净值 | 1.206 | 0.805 | 0.742 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.40% | -27.68% | 6.74% |

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。

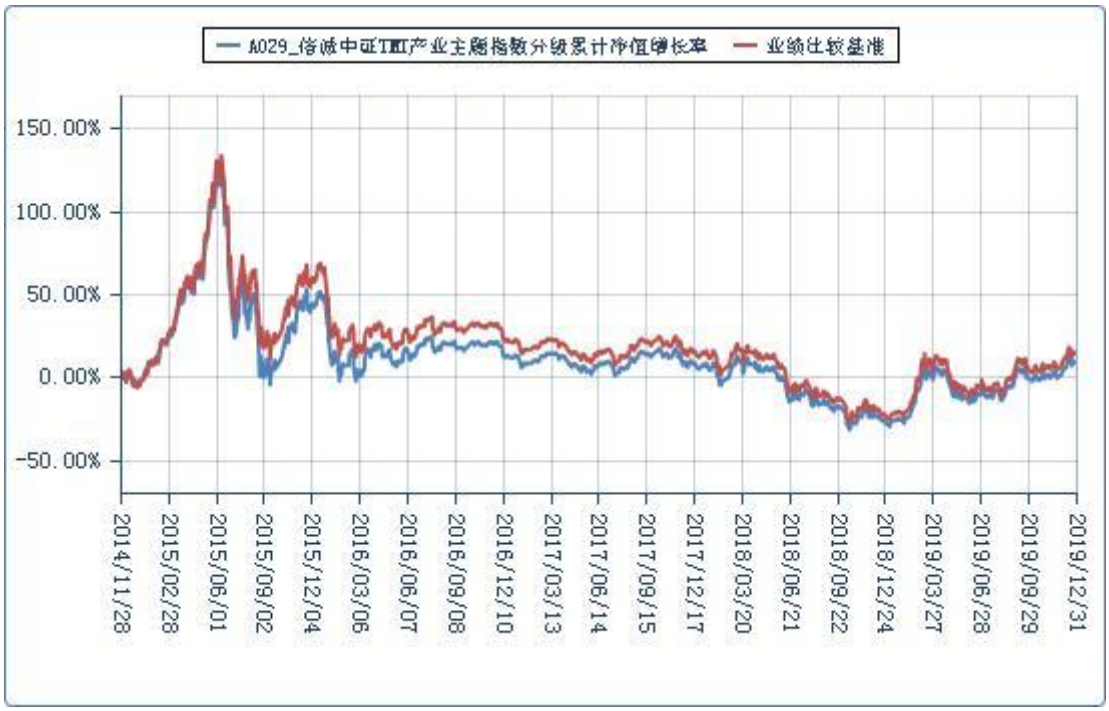
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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 | 10.42% | 1.29% | 10.33% | 1.30% | 0.09% | -0.01% |
| 过去六个月 | 22.16% | 1.49% | 22.36% | 1.51% | -0.20% | -0.02% |
| 过去一年 | 52.66% | 1.77% | 52.21% | 1.81% | 0.45% | -0.04% |
| 过去三年 | -1.85% | 1.56% | -4.71% | 1.58% | 2.86% | -0.02% |
| 过去五年 | 15.60% | 2.11% | 22.24% | 1.98% | -6.64% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.40% | 2.10% | 15.97% | 1.97% | -5.57% | 0.13% |

### 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。

截至 2019 年 12 月 31 日,本基金管理人管理的运作中基金为 69 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）、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 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。

**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，兼任信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚 | 2019 年 09 月 04 日 | - | 8 | 理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任信诚中证 500 指数 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 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。 | | | | 分级证券投资基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、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。 |
| 杨旭 | 本基金基金经理。 | 2015 年 02 月 05 日 | 2019 年 09 月 18 日 | 6 | 理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司,担任数量分析师;于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司,担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司,历任助理投资经理、专户投资经理、量化投资副总监、公募基金经理,于 2019 年 9 月离任。 |

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 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

**4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

**4.3.1 公平交易制度和控制方法**

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 2019 年，我国经济增长面临较大内外压力，全年 GDP 同比增长 6.1%，较 2018 年有所放缓。在经历了前一年的市场大幅调整之后，2019 年 A 股估值水平有所提升，A 股市场在一季度出现较大涨幅，随后维持震荡格局，总体呈现结构性行情，相对而言科技成长股表现较好，创业板指上涨 43.8%、中小板指上涨 41.0%、沪深 300 指数上涨 36.1%、中证 500 上涨 26.4%。分行业来看，电子、食品饮料、家用电器、建筑材料、计算机全年涨幅居前，而建筑装饰、钢铁、公用事业等周期性行业则表现较弱。

本基金跟踪的标的指数为中证 TMT 产业主题指数。报告期内，本基金在严格控制与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 52.66%，同期业绩比较基准收益率为 52.21%，基金超越业绩比较基准 0.45%。

### 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 2020 年，中国经济增长仍面临较大挑战，但随着产业结构调整，增长质量有望逐步提高。在 2019 年下半年，库存周期基本进入底部区域，从宽货币到宽信用链条逐步打通，国内经济和企业盈利出现企稳迹象。但 2020 年初新冠肺炎疫情对短期经济形成明显冲击、并对全年经济带来较大不确定性。防疫情和稳增长并行，影响今年经济增长目标。从宏观经济政策来看，预期将保持宽松环境，逆周期调节力度将进一步加大。中美贸易摩擦的不确定性仍存，但其影响市场已经逐渐消化，冲击也逐步减弱。在目前全球流动性宽松的大背景下，随着市场调整以及短期风险逐步释放，海外资金对 A 股权益市场关注程度和机构资金加仓意愿或将加强，资本市场政策鼓励中长期资金入市，有望为市场带来一定的增量资金。

目前 A 股估值相对于去年初已经有了明显的提升，未来 A 股预计仍以结构性行情为主。短期内市场主要矛盾仍是疫情进展，后续复工情况和市场预期差值得关注；未来重点关注国内宏观政策力度、国内经济和企业盈利的拐点、政策能否催化市场风险偏好继续提升等。疫情缓和之后，复工复产加速，信贷需求也将逐步恢复，经济回归正轨，一旦经济重新形成复苏预期，权益资产的吸引力将进一步提升。未来比较值得关注的方向有：短期事件受益的医药医疗、在线服务等方向；TMT 等中期产业基本面趋势向好、受疫情影响较小的科技成长方向；逆周期调节力度加大的情况下，前期调整幅度较大的基建和部分偏周期行业。

**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，坚持从保护基金份额持有人利益出发，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，及时梳理和更新内部规章制度和操作流程，进一步完善内控制度体系；开展对公司运作和基金业务的日常监察，防范内幕交易、利益输送，有效保障基金投资交易等各项业务合规运作；根据监管规定及监察稽核计划对各业务领域和关键业务部门开展定期全面稽核、专项稽核及合规检查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，完善内控措施；完成各项法定信息披露工作，保证信息披露的及时性、真实性、准确性和完整性；在基金募集、投资过程中及时进行合规检查与提示；通过合规咨询和形式多样的员工合规培训强化全员合规、主动合规理念，加强公司合规文化建设；根据监管要求及时向监管部门报送各类数据材料；高度重视反洗钱工作，在风险为本的理念下全面贯彻落实反洗钱监管要求，采取合理措施防控洗钱风险，从完善反洗钱体系机制及规范业务流程、切实履行客户身份识别义务要求、按照规定报送可疑交易报告、加强宣传培训和人才建设、加强系统建设提升反洗钱科技化水平等方面入手，将反洗钱工作贯穿于各项业务流程，有效提升公司反洗钱工作水平。

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 | 普华永道中天审字(2020)第 21639 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 TMT 产业主题指数分级证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一) 我们审计的内容<br>我们审计了信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金(以下简称“信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br><br>(二) 我们的意见<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中 |

| | |
|---|---|
| | 国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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。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。<br><br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金的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”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。<br><br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估信诚中证 TMT 产业主题指数分级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，除非基金管理人管理层计划清算信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br><br>基金管理人治理层负责监督信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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。<br><br>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：<br><br>(一) 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。<br>(二) 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。<br><br>(三) 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。<br><br>(四) 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，就可能导致对信诚中证 TMT 产业主题指数分级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 TMT 产业主题指数分级基金不能持续经营。<br><br>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br><br>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。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 陈熹、俞伟敏 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 审计报告日期 | 2020 年 04 月 21 日 |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金
报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 7,760,587.61 | 6,680,033.52 |
| 结算备付金 | - | - | - |
| 存出保证金 | - | 7,242.86 | 28,628.21 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 130,683,719.64 | 99,260,335.12 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：股票投资 | - | 130,644,719.64 | 99,260,335.12 |
| 债券投资 | - | 39,000.00 | - |
| 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 | - | 921,580.49 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,656.49 | 1,340.00 |
| 应收股利 | - | - | - |
| 应收申购款 | - | 64,043.91 | 30,935.29 |
| 递延所得税资产 | - | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | - | 139,438,831.00 | 106,001,272.14 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末 2019 年 12 月 31 日** | **上年度末 2018 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 | - | - | 119.07 |
| 应付赎回款 | - | 449,245.77 | 306,152.46 |
| 应付管理人报酬 | - | 117,856.48 | 94,839.14 |
| 应付托管费 | - | 25,928.43 | 20,864.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 59,342.90 | 44,693.97 |
| 应交税费 | - | 0.57 | 0.12 |
| 应付利息 | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 335,426.88 | 625,650.02 |
| 负债合计 | - | 987,801.03 | 1,092,319.41 |
| **所有者权益：** | - | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 125,319,163.82 | 145,081,383.16 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 13,131,866.15 | -40,172,430.43 |
| 所有者权益合计 | - | 138,451,029.97 | 104,908,952.73 |
| 负债和所有者权益总计 | - | 139,438,831.00 | 106,001,272.14 |

注：截止本报告期末，基金份额总额 114,771,820.16 份，信诚中证 TMT 产业主题指数分级的基金份额净值 1.206 元，基金份额总额 91,337,472.16 份。下属分级基金：信诚中证 TMT 产业主题指数分级 A 的基金份额净值 1.002 元，基金份额总额 11,717,174.00 份；信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B 的基金份额净值 1.410 元，基金份额总额 11,717,174.00 份。

**7.2 利润表**

会计主体：信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | - | 55,087,576.72 | -66,435,517.64 |
| 1.利息收入 | - | 63,503.89 | 97,346.74 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 63,413.76 | 97,244.38 |
| 债券利息收入 | - | 90.13 | 102.36 |
| 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） | - | -5,096,303.11 | -51,139,106.69 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -6,183,273.96 | -52,575,329.22 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 70,118.75 | 36,313.65 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 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 | 1,016,852.10 | 1,399,908.88 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 59,966,201.44 | -15,669,262.33 |
| 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 | 154,174.50 | 275,504.64 |
| **减：二、费用** | - | 2,392,719.40 | 3,489,873.83 |
| 1．管理人报酬 | - | 1,380,921.60 | 1,962,500.26 |
| 2．托管费 | - | 303,802.72 | 431,750.08 |
| 3．销售服务费 | - | - | - |
| 4．交易费用 | 7.4.7.18 | 246,889.97 | 439,619.90 |
| 5．利息支出 | - | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - | - |
| 6．税金及附加 | - | 0.33 | 0.39 |
| 7．其他费用 | 7.4.7.19 | 461,104.78 | 656,003.20 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | - | 52,694,857.32 | -69,925,391.47 |
| 减：所得税费用 | - | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | - | 52,694,857.32 | -69,925,391.47 |

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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） | 145,081,383.16 | -40,172,430.43 | 104,908,952.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 52,694,857.32 | 52,694,857.32 |
| 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） | -19,762,219.34 | 609,439.26 | -19,152,780.08 |
| 其中：1.基金申购款 | 83,457,965.88 | -628,857.48 | 82,829,108.40 |
| 2.基金赎回款 | -103,220,185.22 | 1,238,296.74 | -101,981,888.48 |
| 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） | 125,319,163.82 | 13,131,866.15 | 138,451,029.97 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 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） | 277,487,725.94 | 18,794,352.67 | 296,282,078.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -69,925,391.47 | -69,925,391.47 |
| 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） | -132,406,342.78 | 10,958,608.37 | -121,447,734.41 |
| 其中：1.基金申购款 | 52,795,932.21 | -1,732,018.24 | 51,063,913.97 |
| 2.基金赎回款 | -185,202,274.99 | 12,690,626.61 | -172,511,648.38 |
| 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） | 145,081,383.16 | -40,172,430.43 | 104,908,952.73 |

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 TMT 产业主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]131 号《关于核准信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2014]1723 号《关于信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 286,668,897.43 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 719 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 286,752,272.32 份基金份额,其中认购资金利息折合 83,374.89 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金份额包括信诚中证 TMT 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“信诚 TMT 份额”,基金代码“165522”)、信诚中证 TMT 指数分级证券投资基金之信诚 TMT A 份额(以下简称“信诚 TMT A 份额”,基金代码“150173”)与信诚中证 TMT 指数分级证券投资基金之信诚 TMT B 份额(以下简称“信诚 TMT B 份额”,基金代码“150174”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售信诚 TMT 份额。投资人场外认购所得的信诚 TMT 份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的信诚 TMT 份额,将按 1∶1 的基金份额配比自动分离为信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额。信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的数量保持 1：1 的比例不变。基金合同生效后,信诚 TMT 份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内信诚 TMT 份额与信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内信诚 TMT 份额按照 1∶1 的份额配比转换成 1 份信诚 TMT A 份额与 1 份信诚 TMT B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份信诚 TMT A 份额与 1 份信诚 TMT B 份额按照 1∶1 的基金份额配比转换成 2 份场内信诚 TMT 份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：信诚 TMT 份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额、信诚 TMT B 份额数量的总和。本基金每份信诚 TMT A 份额与每份信诚 TMT B 份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额净值之和等于 2 份信诚 TMT 份额的基金份额净值之和。信诚 TMT A 份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率(税后)+3%,信诚 TMT A 份额的基金份额净值以 1.000 元为基础,采用信诚 TMT A 份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算(信诚 TMT A 份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数),计算出信诚 TMT A 份额的基金份额净值后,根据信诚 TMT 份额的基金份额净值与信诚 TMT A 份额、信诚 TMT B 份额之间的基金份额净值关系,可以计算出信诚 TMT B 份额的基金份额净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日；基金合同生效不满 3 个月的除外),本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后信诚 TMT A 份额的基金份额净值调整为 1.000 元,基金份额折算日折算前信诚 TMT A 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚 TMT 份额的场内份额分配给信诚 TMT A 份额持有人。信诚 TMT 份额持有人持有的每两份信诚 TMT 份额将按一份信诚 TMT A 份额获得新增信诚 TMT 份额的分配,经过上述份额折算后,信诚 TMT 份额的基金份额净值将相应调整。信诚 TMT B 份额不进行定期份额折算,其基金份额净值和份额数保持不变。

除以上的定期份额折算外,当信诚 TMT 份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元；当信诚 TMT B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时,本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日,进行不定期份额折算：份额折算后信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的比例仍保持 1：1 不变,份额折算后信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当信诚 TMT 份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时,基金份额折算日折算前信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分均将折算为信诚 TMT 份额分别分配给信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的持有人。当信诚 TMT B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时,信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额和信诚 TMT B 份额的份额数将得到相应的调整。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2014]第 472 号文审核同意,本基金信诚 TMT A 份额(150173) 100,003.00 份基金份额和信诚 TMT B 份额(150174) 100,003.00 份基金份额于 2014 年 12 月 22 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将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》、《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和最新公布的《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证 TMT 产业主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金

资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准：95%×中证 TMT 产业主题指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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 2020 年 4 月 21 日批准报出。

**7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

**7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

**7.4.4 重要会计政策和会计估计**

**7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

**7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

**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**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并

进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

**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**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

**7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在存续期内，本基金(包括信诚 TMT 份额、信诚 TMT A 份额、信诚 TMT B 份额)不进行收益分配。

**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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经

营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

**7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监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。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

**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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 7,760,587.61 | 6,680,033.52 |
| 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 | 7,760,587.61 | 6,680,033.52 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 122,045,366.30 | 130,644,719.64 | 8,599,353.34 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 39,000.00 | 39,000.00 | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 39,000.00 | 39,000.00 | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 122,084,366.30 | 130,683,719.64 | 8,599,353.34 |
| 项目 | | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 150,627,183.22 | 99,260,335.12 | -51,366,848.10 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 150,627,183.22 | 99,260,335.12 | -51,366,848.10 |

**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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 1,651.14 | 1,327.10 |
| 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 | - | - |
| 应收债券利息 | 2.05 | - |
| 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 | 3.30 | 12.90 |
| 合计 | 1,656.49 | 1,340.00 |

注：其他包括应收结算保证金利息、应收中金所清算备付金利息。

**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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 59,342.90 | 44,693.97 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 59,342.90 | 44,693.97 |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 926.88 | 1,150.02 |
| 应付审计费 | 60,000.00 | 70,000.00 |
| 应付信息披露费 | 220,000.00 | 500,000.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 应付指数使用费 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 应付账户维护费 | 4,500.00 | 4,500.00 |
| 合计 | 335,426.88 | 625,650.02 |

**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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 130,392,751.86 | 145,081,383.16 |
| 本期申购 | 72,559,386.42 | 80,732,396.43 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -87,483,161.23 | -97,336,361.27 |
| 2019 年 12 月 13 日基金拆分/份额折算前 | 115,468,977.05 | 128,477,418.32 |
| 基金拆分/份额折算调整 | 2,194,907.54 | — |
| 本期申购 | 2,496,159.94 | 2,725,569.45 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,388,224.37 | -5,883,823.95 |
| 本期末 | 114,771,820.16 | 125,319,163.82 |

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，本基金管理人以 2019 年 12 月 13 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：

单位：份

| | | 本报告期末 | | 上年度末 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金代码 | 场内简称 | 场内 | 场外 | 场内 | 场外 |
| 150173 | TMT中证A | 11,717,174.00 | - | 17,957,460.00 | - |
| 150174 | TMT中证B | 11,717,174.00 | - | 17,957,460.00 | - |
| 165522 | 信诚TMT | 9,231,907.00 | 82,105,565.16 | 11,041,892.00 | 83,435,939.86 |

**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 | -178,213,995.22 | 138,041,564.79 | -40,172,430.43 |
| 本期利润 | -7,271,344.12 | 59,966,201.44 | 52,694,857.32 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 26,069,090.20 | -25,459,650.94 | 609,439.26 |
| 其中：基金申购款 | -104,401,455.42 | 103,772,597.94 | -628,857.48 |
| 基金赎回款 | 130,470,545.62 | -129,232,248.88 | 1,238,296.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -159,416,249.14 | 172,548,115.29 | 13,131,866.15 |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 62,227.79 | 94,918.23 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |

| | | |
|---|---|---|
| 结算备付金利息收入 | 1,000.44 | 1,923.09 |
| 其他 | 185.53 | 403.06 |
| 合计 | 63,413.76 | 97,244.38 |

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入、中金所清算备付金利息收入。

**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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 93,183,084.28 | 187,801,058.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 99,366,358.24 | 240,376,388.05 |
| 买卖股票差价收入 | -6,183,273.96 | -52,575,329.22 |

**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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018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 | 70,118.75 | 36,313.65 |
| 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 | 70,118.75 | 36,313.65 |

**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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 520,209.79 | 613,230.18 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 450,000.00 | 576,800.00 |
| 减：应收利息总额 | 91.04 | 116.53 |
| 买卖债券差价收入 | 70,118.75 | 36,313.65 |

**7.4.7.13.3 债券投资收益--赎回差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益--申购差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.13.5 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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,016,852.10 | 1,399,908.88 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 1,016,852.10 | 1,399,908.88 |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 59,966,201.44 | -15,669,262.33 |
| --股票投资 | 59,966,201.44 | -15,669,262.33 |
| --债券投资 | - | - |
| --资产支持证券投资 | - | - |
| --基金投资 | - | - |
| --贵金属投资 | - | - |
| --其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| --权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 59,966,201.44 | -15,669,262.33 |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 153,703.54 | 274,551.28 |
| 转换费收入 | 470.96 | 953.36 |
| 合计 | 154,174.50 | 275,504.64 |

注：1、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。

2、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。

**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 |
|---|---|---|

| | 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 246,889.97 | 439,619.90 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 246,889.97 | 439,619.90 |

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 60,000.00 | 70,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 300,000.00 |
| 指数使用费 | 200,000.00 | 200,000.00 |
| 银行费用 | 3,104.78 | 3,503.20 |
| 账户维护费 | 18,000.00 | 22,500.00 |
| 基金上市费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 合计 | 461,104.78 | 656,003.20 |

**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，本基金管理人以 2020 年 2 月 25 日为份额折算基准日，对本基金实施不定期份额折算。

除以上情况外，截至本财务报告批准报出日，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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,380,921.60 | 1,962,500.26 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 712,409.86 | 806,642.94 |

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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 303,802.72 | 431,750.08 |

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本基金基金合同公布的费率执行，本基金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本基金基金合同公布的费率执行，本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<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2018 年 01 月 01 日至 2018 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 | 7,760,587.61 | 62,227.79 | 6,680,033.52 | 94,918.23 |

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 2019 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 |
| 002973 | 侨银环保 | 2019 年 12 月 27 日 | 2020 年 01 月 06 日 | 新发未上市 | 5.74 | 5.74 | 1,146 | 6,578.04 | 6,578.04 | - |

| 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 |
| 128088 | 深南转债 | 2019 年 12 月 24 日 | 2020 年 01 月 16 日 | 新发未上市 | 100.00 | 100.00 | 390 | 39,000.00 | 39,000.00 | - |

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。

**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信用债券投资。

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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 39,000.00 | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 39,000.00 | - |

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约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、

流通受限制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 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 | 7,760,587.61 | - | - | - | - | - | 7,760,587.61 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 7,242.86 | - | - | - | - | - | 7,242.86 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 39,000.00 | 130,644,719.64 | 130,683,719.64 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 921,580.49 | 921,580.49 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,656.49 | 1,656.49 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 64,043.91 | 64,043.91 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 7,767,830.47 | - | - | - | 39,000.00 | 131,632,000.53 | 139,438,831.00 |
| 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 | - | - | - | - | - | 449,245.77 | 449,245.77 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 117,856.48 | 117,856.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 25,928.43 | 25,928.43 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 59,342.90 | 59,342.90 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 0.57 | 0.57 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 335,426.88 | 335,426.88 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 987,801.03 | 987,801.03 |
| 利率敏感度缺口 | 7,767,830.47 | - | - | - | 39,000.00 | 130,644,199.50 | 138,451,029.97 |
| 上年度末 2018 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 | 6,680,033.52 | - | - | - | - | - | 6,680,033.52 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 28,628.21 | - | - | - | - | - | 28,628.21 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 99,260,335.12 | 99,260,335.12 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,340.00 | 1,340.00 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 30,935.29 | 30,935.29 |
| 待摊费用 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他应收款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 6,708,661.73 | - | - | - | - | 99,292,610.41 | 106,001,272.14 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 119.07 | 119.07 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 306,152.46 | 306,152.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 94,839.14 | 94,839.14 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 20,864.63 | 20,864.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 44,693.97 | 44,693.97 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 0.12 | 0.12 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 625,650.02 | 625,650.02 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,092,319.41 | 1,092,319.41 |
| 利率敏感度缺口 | 6,708,661.73 | - | - | - | - | 98,200,291.00 | 104,908,952.73 |

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，并按照合约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 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2018 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 | 130,644,719.64 | 94.36 | 99,260,335.12 | 94.62 |
| 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 | 130,644,719.64 | 94.36 | 99,260,335.12 | 94.62 |

**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(2019 年 12 月 31 日) | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准中的股票指数上升 5% | 6,410,928.64 | 4,983,175.25 |
| | 业绩比较基准中的股票指数下降 5% | -6,410,928.64 | -4,983,175.25 |

**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) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，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 130,638,141.60 元，属于第二层次的余额为 45,578.04 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 96,991,846.47 元，第三层次 2,268,488.65 元，无第二层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2019 年 12 月 31 日，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，无归属于第三层次的余额。2019 年度，本基金转出第三层次的金额为 1,756,610.20 元，计入损益的损失为 511,878.45 元。

于 2018 年 12 月 31 日，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，归属于第三层次的余额为 2,268,488.65 元。2018 年度，本基金转入第三层次的金额为 2,268,488.65 元，出售第三层次的金额为 744,643.67 元，计入损益的利得为 139,375.67 元。

本基金于 2018 年 12 月 31 日仍持有的第三层次的金融资产，从年初起算计入 2018 年度公允价值变动损益的金额为-1,587,327.73 元。

于 2018 年 12 月 31 日，第三层次公允价值计量使用的估值技术为可比公司法，使用的重要不可观察输入值为市净率，市净率为 2.59，不可观察输入值与公允价值之间的关系为正相关。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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 | 130,644,719.64 | 93.69 |
| | 其中：股票 | 130,644,719.64 | 93.69 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 39,000.00 | 0.03 |
| | 其中：债券 | 39,000.00 | 0.03 |
| | 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 | 7,760,587.61 | 5.57 |
| 8 | 其他各项资产 | 994,523.75 | 0.71 |
| 9 | 合计 | 139,438,831.00 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 68,705,813.90 | 49.62 |
| 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 | - | - |
| 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 | 46,683,501.99 | 33.72 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,417,414.24 | 1.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 13,791,773.74 | 9.96 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 130,598,503.87 | 94.33 |

**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 | 39,637.73 | 0.03 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,578.04 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 46,215.77 | 0.03 |

**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 | 300773 | 拉卡拉 | 22,200 | 1,742,034.00 | 1.26 |
| 2 | 000156 | 华数传媒 | 148,556 | 1,550,924.64 | 1.12 |
| 3 | 300296 | 利亚德 | 199,000 | 1,526,330.00 | 1.10 |
| 4 | 002624 | 完美世界 | 33,600 | 1,483,104.00 | 1.07 |
| 5 | 600707 | 彩虹股份 | 351,400 | 1,475,880.00 | 1.07 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 28,240 | 1,472,716.00 | 1.06 |
| 7 | 601231 | 环旭电子 | 76,455 | 1,470,229.65 | 1.06 |
| 8 | 002236 | 大华股份 | 73,875 | 1,468,635.00 | 1.06 |
| 9 | 300251 | 光线传媒 | 123,124 | 1,452,863.20 | 1.05 |
| 10 | 002739 | 万达电影 | 79,000 | 1,433,850.00 | 1.04 |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 40,120 | 1,419,846.80 | 1.03 |
| 12 | 300033 | 同花顺 | 13,000 | 1,418,430.00 | 1.02 |
| 13 | 002027 | 分众传媒 | 226,424 | 1,417,414.24 | 1.02 |
| 14 | 600373 | 中文传媒 | 103,977 | 1,415,126.97 | 1.02 |
| 15 | 002456 | 欧菲光 | 90,600 | 1,413,360.00 | 1.02 |
| 16 | 002384 | 东山精密 | 60,900 | 1,409,835.00 | 1.02 |
| 17 | 002555 | 三七互娱 | 52,200 | 1,405,746.00 | 1.02 |
| 18 | 300418 | 昆仑万维 | 83,900 | 1,405,325.00 | 1.02 |
| 19 | 601698 | 中国卫通 | 124,100 | 1,404,812.00 | 1.01 |
| 20 | 601360 | 三六零 | 59,700 | 1,403,547.00 | 1.01 |
| 21 | 002180 | 纳思达 | 42,600 | 1,402,392.00 | 1.01 |
| 22 | 000725 | 京东方Ａ | 307,923 | 1,397,970.42 | 1.01 |
| 23 | 600271 | 航天信息 | 60,002 | 1,390,246.34 | 1.00 |
| 24 | 000100 | TCL 集团 | 310,200 | 1,386,594.00 | 1.00 |
| 25 | 600498 | 烽火通信 | 50,251 | 1,379,389.95 | 1.00 |
| 26 | 300408 | 三环集团 | 61,700 | 1,374,676.00 | 0.99 |
| 27 | 002439 | 启明星辰 | 40,532 | 1,369,981.60 | 0.99 |
| 28 | 300413 | 芒果超媒 | 39,100 | 1,366,936.00 | 0.99 |
| 29 | 300133 | 华策影视 | 184,270 | 1,363,598.00 | 0.98 |
| 30 | 002415 | 海康威视 | 41,625 | 1,362,802.50 | 0.98 |
| 31 | 000938 | 紫光股份 | 43,012 | 1,359,179.20 | 0.98 |
| 32 | 300136 | 信维通信 | 29,840 | 1,354,139.20 | 0.98 |
| 33 | 002230 | 科大讯飞 | 39,041 | 1,346,133.68 | 0.97 |
| 34 | 300166 | 东方国信 | 103,433 | 1,344,629.00 | 0.97 |
| 35 | 600776 | 东方通信 | 64,500 | 1,343,535.00 | 0.97 |
| 36 | 600703 | 三安光电 | 72,900 | 1,338,444.00 | 0.97 |
| 37 | 002217 | 合力泰 | 240,700 | 1,335,885.00 | 0.96 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 38 | 600570 | 恒生电子 | 17,168 | 1,334,468.64 | 0.96 |
| 39 | 601138 | 工业富联 | 72,900 | 1,331,883.00 | 0.96 |
| 40 | 601928 | 凤凰传媒 | 174,900 | 1,330,989.00 | 0.96 |
| 41 | 600446 | 金证股份 | 64,641 | 1,330,311.78 | 0.96 |
| 42 | 002153 | 石基信息 | 34,100 | 1,329,900.00 | 0.96 |
| 43 | 300017 | 网宿科技 | 139,229 | 1,326,852.37 | 0.96 |
| 44 | 600959 | 江苏有线 | 332,890 | 1,324,902.20 | 0.96 |
| 45 | 000050 | 深天马Ａ | 81,173 | 1,322,308.17 | 0.96 |
| 46 | 600487 | 亨通光电 | 81,280 | 1,321,612.80 | 0.95 |
| 47 | 002465 | 海格通信 | 121,948 | 1,320,696.84 | 0.95 |
| 48 | 600050 | 中国联通 | 224,098 | 1,319,937.22 | 0.95 |
| 49 | 600637 | 东方明珠 | 140,983 | 1,319,600.88 | 0.95 |
| 50 | 601098 | 中南传媒 | 110,400 | 1,318,176.00 | 0.95 |
| 51 | 002373 | 千方科技 | 73,000 | 1,316,920.00 | 0.95 |
| 52 | 002195 | 二三四五 | 406,600 | 1,313,318.00 | 0.95 |
| 53 | 603986 | 兆易创新 | 6,400 | 1,311,296.00 | 0.95 |
| 54 | 600037 | 歌华有线 | 145,451 | 1,310,513.51 | 0.95 |
| 55 | 600100 | 同方股份 | 148,991 | 1,306,651.07 | 0.94 |
| 56 | 603000 | 人民网 | 66,002 | 1,306,179.58 | 0.94 |
| 57 | 002558 | 巨人网络 | 72,300 | 1,305,738.00 | 0.94 |
| 58 | 600522 | 中天科技 | 156,925 | 1,302,477.50 | 0.94 |
| 59 | 002368 | 太极股份 | 33,463 | 1,302,379.96 | 0.94 |
| 60 | 002049 | 紫光国微 | 25,500 | 1,296,420.00 | 0.94 |
| 61 | 600728 | 佳都科技 | 138,208 | 1,296,391.04 | 0.94 |
| 62 | 002410 | 广联达 | 38,068 | 1,293,550.64 | 0.93 |
| 63 | 002925 | 盈趣科技 | 29,400 | 1,292,130.00 | 0.93 |
| 64 | 600718 | 东软集团 | 113,775 | 1,291,346.25 | 0.93 |
| 65 | 000997 | 新 大 陆 | 81,295 | 1,290,964.60 | 0.93 |
| 66 | 002268 | 卫 士 通 | 49,788 | 1,284,032.52 | 0.93 |
| 67 | 600977 | 中国电影 | 84,272 | 1,282,619.84 | 0.93 |
| 68 | 300027 | 华谊兄弟 | 275,743 | 1,276,690.09 | 0.92 |
| 69 | 300383 | 光环新网 | 63,600 | 1,276,452.00 | 0.92 |
| 70 | 002600 | 领益智造 | 117,500 | 1,274,875.00 | 0.92 |
| 71 | 002475 | 立讯精密 | 34,907 | 1,274,105.50 | 0.92 |
| 72 | 000503 | 国新健康 | 74,376 | 1,273,317.12 | 0.92 |
| 73 | 300454 | 深信服 | 11,100 | 1,269,729.00 | 0.92 |
| 74 | 600839 | 四川长虹 | 436,300 | 1,269,633.00 | 0.92 |
| 75 | 002179 | 中航光电 | 32,450 | 1,267,497.00 | 0.92 |
| 76 | 002371 | 北方华创 | 14,400 | 1,267,200.00 | 0.92 |
| 77 | 002841 | 视源股份 | 14,740 | 1,263,218.00 | 0.91 |
| 78 | 300433 | 蓝思科技 | 91,346 | 1,262,401.72 | 0.91 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 79 | 603228 | 景旺电子 | 28,700 | 1,257,634.00 | 0.91 |
| 80 | 002065 | 东华软件 | 121,830 | 1,257,285.60 | 0.91 |
| 81 | 002405 | 四维图新 | 78,000 | 1,255,800.00 | 0.91 |
| 82 | 603501 | 韦尔股份 | 8,700 | 1,247,580.00 | 0.90 |
| 83 | 603019 | 中科曙光 | 35,840 | 1,239,347.20 | 0.90 |
| 84 | 300628 | 亿联网络 | 17,100 | 1,238,211.00 | 0.89 |
| 85 | 600588 | 用友网络 | 43,507 | 1,235,598.80 | 0.89 |
| 86 | 002241 | 歌尔股份 | 61,840 | 1,231,852.80 | 0.89 |
| 87 | 300782 | 卓胜微 | 3,000 | 1,231,110.00 | 0.89 |
| 88 | 002463 | 沪电股份 | 55,300 | 1,228,213.00 | 0.89 |
| 89 | 600584 | 长电科技 | 55,783 | 1,226,110.34 | 0.89 |
| 90 | 002916 | 深南电路 | 8,600 | 1,222,060.00 | 0.88 |
| 91 | 603160 | 汇顶科技 | 5,900 | 1,217,170.00 | 0.88 |
| 92 | 000066 | 中国长城 | 78,200 | 1,216,792.00 | 0.88 |
| 93 | 000977 | 浪潮信息 | 40,129 | 1,207,882.90 | 0.87 |
| 94 | 600845 | 宝信软件 | 36,300 | 1,194,270.00 | 0.86 |
| 95 | 002583 | 海能达 | 141,100 | 1,186,651.00 | 0.86 |
| 96 | 002938 | 鹏鼎控股 | 25,700 | 1,153,930.00 | 0.83 |
| 97 | 600183 | 生益科技 | 54,500 | 1,140,140.00 | 0.82 |
| 98 | 600745 | 闻泰科技 | 10,300 | 952,750.00 | 0.69 |
| 99 | 000413 | 东旭光电 | 220,800 | 741,888.00 | 0.54 |

### 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 | 002972 | 科安达 | 1,075 | 21,532.25 | 0.02 |
| 2 | 603109 | 神驰机电 | 684 | 18,105.48 | 0.01 |
| 3 | 002973 | 侨银环保 | 1,146 | 6,578.04 | 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 | 600707 | 彩虹股份 | 1,965,842.28 | 1.87 |
| 2 | 002739 | 万达电影 | 1,679,541.46 | 1.60 |
| 3 | 002217 | 合力泰 | 1,636,222.00 | 1.56 |
| 4 | 601698 | 中国卫通 | 1,525,308.16 | 1.45 |
| 5 | 002373 | 千方科技 | 1,515,848.00 | 1.44 |
| 6 | 300782 | 卓胜微 | 1,457,189.47 | 1.39 |
| 7 | 002463 | 沪电股份 | 1,397,900.00 | 1.33 |
| 8 | 300773 | 拉卡拉 | 1,390,650.12 | 1.33 |
| 9 | 600776 | 东方通信 | 1,380,643.00 | 1.32 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 1,366,524.00 | 1.30 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 11 | 600745 | 闻泰科技 | 1,347,994.00 | 1.28 |
| 12 | 002195 | 二三四五 | 1,347,570.00 | 1.28 |
| 13 | 601928 | 凤凰传媒 | 1,330,073.84 | 1.27 |
| 14 | 002938 | 鹏鼎控股 | 1,316,031.00 | 1.25 |
| 15 | 603228 | 景旺电子 | 1,314,779.20 | 1.25 |
| 16 | 300628 | 亿联网络 | 1,307,289.00 | 1.25 |
| 17 | 600845 | 宝信软件 | 1,301,440.00 | 1.24 |
| 18 | 300413 | 芒果超媒 | 1,278,336.00 | 1.22 |
| 19 | 002916 | 深南电路 | 1,277,096.60 | 1.22 |
| 20 | 002371 | 北方华创 | 1,250,323.00 | 1.19 |

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 | 300315 | 掌趣科技 | 2,468,749.36 | 2.35 |
| 2 | 300113 | 顺网科技 | 2,303,706.00 | 2.20 |
| 3 | 002600 | 领益智造 | 2,258,083.96 | 2.15 |
| 4 | 002131 | 利欧股份 | 2,211,705.14 | 2.11 |
| 5 | 002241 | 歌尔股份 | 1,993,697.54 | 1.90 |
| 6 | 002429 | 兆驰股份 | 1,920,305.72 | 1.83 |
| 7 | 603986 | 兆易创新 | 1,825,612.00 | 1.74 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 1,825,108.00 | 1.74 |
| 9 | 603000 | 人民网 | 1,769,128.00 | 1.69 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,767,319.08 | 1.68 |
| 11 | 603888 | 新华网 | 1,688,526.80 | 1.61 |
| 12 | 000066 | 中国长城 | 1,680,115.42 | 1.60 |
| 13 | 603444 | 吉比特 | 1,582,509.00 | 1.51 |
| 14 | 000021 | 深科技 | 1,569,835.91 | 1.50 |
| 15 | 603160 | 汇顶科技 | 1,562,010.00 | 1.49 |
| 16 | 600183 | 生益科技 | 1,539,900.00 | 1.47 |
| 17 | 600060 | 海信电器 | 1,461,946.55 | 1.39 |
| 18 | 300115 | 长盈精密 | 1,424,763.25 | 1.36 |
| 19 | 300033 | 同花顺 | 1,422,472.00 | 1.36 |
| 20 | 300324 | 旋极信息 | 1,418,834.64 | 1.35 |

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 | 70,784,541.32 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 93,183,084.28 |

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） | 39,000.00 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 39,000.00 | 0.03 |

**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 | 128088 | 深南转债 | 390 | 39,000.00 | 0.03 |

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,如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

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**

本基金指数投资的前十名证券的发行主体及积极投资的前五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 | 7,242.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | 921,580.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,656.49 |
| 5 | 应收申购款 | 64,043.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 994,523.75 |

**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 | 002973 | 侨银环保 | 6,578.04 | 0.00 | 新发未上市 |

**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 TMT 产业主题指数分级 A | 301 | 38,927.49 | 2,179,518.00 | 18.60% | 9,537,656.00 | 81.40% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 4,550 | 2,575.20 | 118,046.00 | 1.01% | 11,599,128.00 | 98.99% |
| 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 | 11,734 | 7,784.00 | 1,687,604.66 | 1.85% | 89,649,867.50 | 98.15% |
| 合计 | 16,585 | 6,920.22 | 3,985,168.66 | 3.47% | 110,786,651.50 | 96.53% |

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 TMT 产业主题指数分级 A：

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 丁碧霞 | 3,012,179.00 | 25.71% |
| 2 | 赵从志 | 1,561,507.00 | 13.33% |
| 3 | 德邦基金－浙商银行－百年人寿保险－百年人寿保险股份有限公司－自有资金 | 1,234,096.00 | 10.53% |
| 4 | 李怡名 | 848,462.00 | 7.24% |
| 5 | 朱樱 | 662,865.00 | 5.66% |
| 6 | 郭涛 | 617,156.00 | 5.27% |
| 7 | 王少男 | 600,000.00 | 5.12% |
| 8 | 信达证券－兴业银行－信达证券睿丰 3 号集合资产管理计划 | 550,083.00 | 4.69% |
| 9 | 郭祖彬 | 449,199.00 | 3.83% |
| 10 | 余健鸿 | 262,870.00 | 2.24% |

信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B：

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 吴杰 | 409,769.00 | 3.50% |
| 2 | 刘红 | 360,000.00 | 3.07% |
| 3 | 张玉良 | 350,000.00 | 2.99% |
| 4 | 王骏 | 329,258.00 | 2.81% |
| 5 | 常燕海 | 300,000.00 | 2.56% |
| 6 | 唐菊萍 | 200,916.00 | 1.71% |
| 7 | 张美芳 | 167,302.00 | 1.43% |
| 8 | 杨艺峰 | 167,212.00 | 1.43% |
| 9 | 张修烽 | 161,328.00 | 1.38% |
| 10 | 骆风霞 | 147,622.00 | 1.26% |

信诚中证 TMT 产业主题指数分级：

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| 1 | 吴松 | 1,635,373.62 | 1.79% |
| 2 | 许冬 | 1,047,892.26 | 1.15% |
| 3 | 张一凡 | 1,009,708.41 | 1.11% |
| 4 | 德邦基金百年人寿明淇 1 号资产管理计划 | 632,145.83 | 0.69% |
| 5 | 任大彪 | 612,624.64 | 0.67% |
| 6 | 中国太平洋财产保险－传统－普通保险产品-013C-CT001 深 | 547,917.05 | 0.60% |
| 7 | 刘静 | 516,612.06 | 0.57% |
| 8 | 宋财琛 | 500,704.46 | 0.55% |
| 9 | 欧阳惠娟 | 433,989.31 | 0.48% |
| 10 | 段绕 | 422,224.23 | 0.46% |

**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 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 A | - | - |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 33.00 | 0.00% |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 | 63,186.63 | 0.07% |
| | 合计 | 63,219.63 | 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 A | 0 |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 0 |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 | 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 TMT 产业主题指数分级 A | 0 |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 0 |
| | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 | 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 TMT 产业主题指数分级 A | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 B | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 28 日）基金份额总额 | 100,003.00 | 100,003.00 | 286,552,266.32 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 17,957,460.00 | 17,957,460.00 | 94,477,831.86 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - | 75,055,546.36 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - | 92,871,385.60 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | -6,240,286.00 | -6,240,286.00 | 14,675,479.54 |
| 报告期期末基金份额总额 | 11,717,174.00 | 11,717,174.00 | 91,337,472.16 |

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及基金份额折算变动份额。

2.根据《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 TMT 产业主题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中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2019 年 12 月 13 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**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**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**

1、报告期内基金管理人的重大人事变动:

吕涛先生于 2019 年 3 月 6 日离任公司总经理职务，同日起公司董事长张翔燕女士代为履行总经理职务；唐世春先生于 2019 年 6 月 3 日新任公司总经理职务，同日起，唐世春先生离任公司副总经理职务、张翔燕女士不再代为履行总经理职务；陈逸辛先生于 2019 年 8 月 21 日新任公司首席信息官职务；潘颖女士于 2019 年 10 月 31 日新任公司副总经理职务。上述事项已按监管要求备案并公告。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

**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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 60,000.00 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**

本报告期内，基金管理人收到监管机构关于子公司管理问题对公司采取责令改正措施的决定、对相关责任人采取行政监管谈话措施的决定。基金管理人高度重视，及时向监管机构提交整改报告并已在一个月内完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

**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 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | 3,647,761.12 | 2.26% | 2,594.65 | 1.86% | - |
| 长江证券 | 2 | 4,299,645.80 | 2.66% | 3,918.25 | 2.81% | - |
| 川财证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 大通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | 35,210,222.45 | 21.80% | 26,303.75 | 18.87% | - |
| 东方证券 | 1 | 18,353,555.23 | 11.36% | 17,092.60 | 12.26% | - |
| 东吴证券 | 2 | 1,122,311.36 | 0.69% | 1,043.88 | 0.75% | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | 33,355,066.90 | 20.65% | 30,396.40 | 21.81% | - |
| 高盛高华 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | 7,402,952.72 | 4.58% | 5,265.76 | 3.78% | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | 2,788,338.08 | 1.73% | 2,540.95 | 1.82% | - |
| 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 | 2,962,341.34 | 1.83% | 2,699.59 | 1.94% | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 金通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 5 | 1,698,769.97 | 1.05% | 1,548.17 | 1.11% | - |
| 天风证券 | 3 | 1,795,897.23 | 1.11% | 1,672.49 | 1.20% | - |
| 万联证券 | 1 | 720,536.00 | 0.45% | 512.46 | 0.37% | - |
| 西部证券 | 2 | 1,388,569.00 | 0.86% | 1,015.55 | 0.73% | - |
| 西藏东财 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | 35,438,253.99 | 21.94% | 32,294.96 | 23.17% | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | 6,879,770.90 | 4.26% | 6,407.26 | 4.60% | - |
| 中投证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | 4,457,150.32 | 2.76% | 4,061.81 | 2.91% | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 66,332.07 | 6.57% | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 大通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 222,177.70 | 22.02% | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 高盛高华 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 51,445.37 | 5.10% | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 29,730.75 | 2.95% | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 170,000.00 | 16.84% | - | - | - | - | - | - |
| 金通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 63,419.00 | 6.28% | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东财 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 406,104.90 | 40.24% | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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 2018 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告 | 《证券时报》及公司网站 (www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 01 月 02 日 |
| 2 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书（2019 年第 1 次更新） | 公司网站 (www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 01 月 11 日 |
| 3 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书摘要（2019 年第 1 次更新） | 《证券时报》及公司网站 (www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 01 月 11 日 |
| 4 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2018 年第四季度报告 | 《证券时报》及公司网站 (www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 01 月 22 日 |
| 5 | 中信保诚基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 《证券时报》及公司网站 (www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 01 月 29 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 02 月 27 日 |
| 7 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停直销机构跨系统转托管（场外转场内）业务的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 06 日 |
| 8 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金恢复代销机构场外大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停办理基金跨系统转托管（场外转场内）业务的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 07 日 |
| 9 | 中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过东海证券办理定投业务最低限额的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 11 日 |
| 10 | 中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定期定额投资最低金额和赎回、转换转出及持有最低份额限制的业务的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 21 日 |
| 11 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2018 年年度报告 | 公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 28 日 |
| 12 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 03 月 28 日 |
| 13 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2019 年第一季度报告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 04 月 18 日 |
| 14 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加辉腾汇富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 05 月 20 日 |
| 15 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购定投费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 05 月 28 日 |
| 16 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金之 TMT 中证 B 交易价格波动提示公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 05 日 |
| 17 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金之 TMT 中证 B 交易价格波动提示公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 11 日 |
| 18 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金之 TMT 中证 B 交易价格波动提示公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 14 日 |
| 19 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 17 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 公司为销售机构并开通转换业务的公告 | | |
| 20 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金之 TMT 中证 B 溢价风险提示公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 19 日 |
| 21 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金之 TMT 中证 B 交易价格波动提示公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 06 月 26 日 |
| 22 | 中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 01 日 |
| 23 | 中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 6 月 28 日基金资产净值和基金份额净值公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 01 日 |
| 24 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书（2019 年第 2 次更新） | 公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 11 日 |
| 25 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书摘要（2019 年第 2 次更新） | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 11 日 |
| 26 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2019 年第二季度报告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 19 日 |
| 27 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加恒天明泽基金申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 07 月 29 日 |
| 28 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告 | 公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 08 月 26 日 |
| 29 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告摘要 | 《证券时报》及公司网站(www.citicprufunds.com.cn) | 2019 年 08 月 26 日 |
| 30 | 中信保诚基金管理有限公司基金经理变更公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 09 月 05 日 |
| 31 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金更新招募说明书 | 指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 09 月 07 日 |
| 32 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要 | 指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 09 月 07 日 |
| 33 | 中信保诚基金管理有限公司基金经理变更公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 09 月 19 日 |
| 34 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金更新招募说明书 | 指定网站(www.citicprufunds.com.cn | 2019 年 09 月 19 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | |
| 35 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要 | 指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 09 月 19 日 |
| 36 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 10 月 09 日 |
| 37 | 信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 2019 年第三季度报告 | 指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 10 月 24 日 |
| 38 | 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告 | 《证券时报》 | 2019 年 10 月 24 日 |
| 39 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投基金申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 11 月 13 日 |
| 40 | 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 10 日 |
| 41 | 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 TMT 中证 A 份额停复牌的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 16 日 |
| 42 | 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 TMT 产业主题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 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 16 日 |
| 43 | 中信保诚基金管理有限公司关于 TMT 中证 A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 17 日 |
| 44 | 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 TMT 产业主题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 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 17 日 |
| 45 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万家财富基金申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 年 12 月 30 日 |
| 46 | 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告 | 《证券时报》及指定网站(www.citicprufunds.com.cn 及 eid.csrc.gov.cn/fund/) | 2019 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**

无

## §13 备查文件目录

**13.1 备查文件目录**

1、信诚中证 TMT 产业主题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 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同

4、信诚中证 TMT 产业主题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**

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

**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

2020 年 04 月 25 日