信诚中证智能家居指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚中证智能家居指数分级
场内简称	智能家居
基金主代码	165524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月26日
报告期末基金份额总额	154,272,702.01份
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,实现对中证智能家居指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其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%。 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%×中证智能家居指数收益率+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。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	信诚中证智能家居指数分级A / 信诚中证智能家居指数分级B / 信诚中证智能家居指数分级
下属分级基金的场内简称	智能A / 智能B / 智能家居
下属分级基金的交易代码	150311 / 150312 / 165524
报告期末下属分级基金的份额总额	8,203,761.00份 / 8,203,761.00份 / 137,865,180.01份
下属分级基金的风险收益特征	智能A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。 / 智能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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

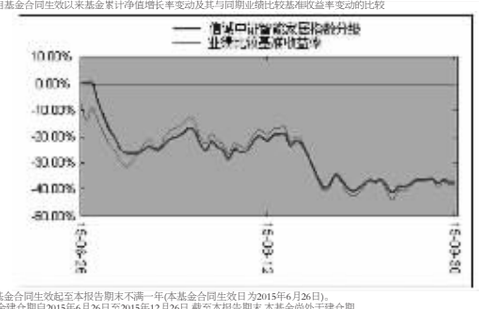
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-123,711,347.57
2.本期利润	-160,332,609.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5043
4.期末基金资产净值	155,953,868.52
5.期末基金份额净值	1.011

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-37.38%	3.29%	-32.11%	3.98%	-5.27%	-0.69%

3.2.2 目基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2015年6月26日)。
2.本基金建仓期自2015年6月26日至2015年12月26日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
杨旭	本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证900金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年6月26日	-	3	数学金融硕士,运筹管理学硕士,纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methodx公司数量分析师,华尔街对冲基金WSFA Group公司助理基金经理,该基金为股票多空型对冲基金。2012年8月加入信诚基金,曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理。

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《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证智能家居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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,全球资金都降低在股票市场的配置,美国预期进入加息周期,叠加美元对新兴市场货币升值导致热钱流出新兴市场,市场担心全球经济失去增长动力。在三季度开始,市场依然在去杠杆的过程,由于市场下跌,引发的一系列融资盘强行平仓。但8月下旬,股票市场开始震荡,成交量下降。一方面资金宽松,整体资本市场处于缺资产时期,资金没有去处;另一方面,股市估值有较大修正,配资也有序的清理,政策方面有稳定股市的倾向,导致从8月底开始市场处于弱平衡状态。

信诚中证智能家居于2015年6月26日成立,截至本报告期末该基金仍处于建仓期。

展望四季度,我们认为经过三季度的市场调整,一方面部分板块与股票估值开始合理,叠加高收益资产缺失的状况并无改变,另一方面政府出台一系列稳增长政策,资金宽松,加上美联储再次议息要在12月,所以当政策出现窗口期这段时间,A股出现博弈机会。 但整体上权益市场仍然没有超跌到可以吸引大量长期投资者持有的位置。场内杠杆下降趋势并无明显改变,4季度出现反弹后的继续寻底的概率较大。但从更长时期,经济仍是以投资转向消费与创新的方向,IPO重启,养老金入市,改革与转型需要活跃的资本市场,所以对于权益市场长期并不悲观。但从2011年股指期货推出开启的金融创新的趋势,已经开始转变。未来仍看好能反映经济转型的方向如互联网,消费,新能源等相关板块。

4.5 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-37.38%,同期业绩比较基准收益率为-32.11%,基金落后业绩比较基准5.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,545,545.88	49.86
	其中:股票	78,545,545.88	49.86
2	固定收益投资	10,019,000.00	6.36
	其中:债券	10,019,000.00	6.36
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	65,762,092.84	41.75
7	其他资产	3,204,992.12	2.03
8	合计	157,531,630.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,492,324.00	0.96
C	制造业	42,405,560.91	27.19
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	3,195,837.00	2.05
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	30,876,399.97	19.80
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	575,424.00	0.37
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,545,545.88	50.36

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002052	同洲电子	325,120	2,744,012.80	1.76
2	300010	立思辰	147,600	2,563,812.00	1.64
3	002544	杰赛科技	63,100	1,870,915.00	1.20
4	000851	高鸿股份	167,700	1,799,421.00	1.15
5	600392	盛和资源	212,500	1,525,750.00	0.98
6	300157	恒泰艾普	213,800	1,492,324.00	0.96
7	002475	立讯精密	45,974	1,359,451.18	0.87
8	000938	紫光股份	19,400	1,353,538.00	0.87
9	002236	大华股份	35,100	1,186,731.00	0.76
10	600756	浪潮软件	60,300	1,157,760.00	0.74

5.3.2 报告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前五名股票投资明细
本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,019,000.00	6.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,019,000.00	6.42

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15国债09	100,000	10,019,000.00	6.42

注:本基金本报告期末,仅持有上述1只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,"其他衍生工具-股指期货投资"与"证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款",符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将"其他衍生工具-股指期货投资"的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。
本基金本报告期初及报告期内均未持有股指期货投资。
5.9.2 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。
本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2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。
5.10.3本期国债期货投资评价
本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。
5.11.2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。
5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	236,407.90
2	应收证券清算款	2,819,391.16
3	应收股利	-
4	应收利息	117,100.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,092.80
8	其他	-
9	合计	3,204,992.12

5.11.4报告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。
5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002052	同洲电子	2,744,012.80	1.76	筹划重大事项
2	300010	立思辰	2,563,812.00	1.64	筹划重大事项
3	002544	杰赛科技	1,870,915.00	1.20	筹划重大事项
4	000851	高鸿股份	1,799,421.00	1.15	筹划重大事项
5	600392	盛和资源	1,525,750.00	0.98	筹划重大事项
6	300157	恒泰艾普	1,492,324.00	0.96	筹划重大事项
7	000938	紫光股份	1,353,538.00	0.87	筹划重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末,持有的积极投资股票不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证智能家居指数分级A	信诚中证智能家居指数分级B	信诚中证智能家居指数分级
报告期期初基金份额总额	113,116,599.00	113,116,600.00	229,685,156.76
报告期期间基金总申购份额	-	-	90,673,537.76
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	265,376,048.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-104,912,838.00	-104,912,839.00	82,882,533.67
报告期期末基金份额总额	8,203,761.00	8,203,761.00	137,865,180.01

注:1.拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金份额折算变动份额。
2.根据《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金办理不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,基金管理人信诚基金管理有限公司于2015年8月27日(折算基准日)对本基金进行了基金份额不定期份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包括份额折算变动的份额。其中减少信诚中证智能家居指数分级425,421,850.33份,减少信诚中证智能家居指数分级A 40,760,645.00 份,减少信诚中证智能家居指数分级B 40,760,646.00 份。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

1.信诚中证智能家居指数分级证券投资基金相关批准文件 2.信诚基金管理公司营业执照、公司章程 3.信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同 4.信诚中证智能家居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

9.2 存放地点
信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

9.3 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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2015年10月24日

信诚中证信息安全指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚中证信息安全指数分级
场内简称	信息安全
基金主代码	165523
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月26日
报告期末基金份额总额	362,283,706.48份
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,实现对中证信息安全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	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其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%。 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%×中证信息安全主题指数收益率+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。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	信诚中证信息安全指数分级A / 信诚中证信息安全指数分级B / 信诚中证信息安全指数分级
下属分级基金的场内简称	信息安A / 信息安B / 信息安全
下属分级基金的交易代码	150309 / 150310 / 165523
报告期末下属分级基金的份额总额	15,608,824.00份 / 15,608,824.00份 / 331,066,058.48份
下属分级基金的风险收益特征	信息安A份额具有预期风险、预期收益较低的特征 / 信息安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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

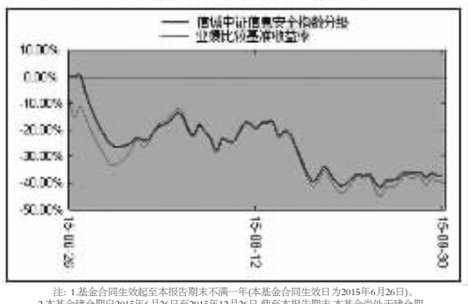
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-182,677,080.79
2.本期利润	-278,371,716.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4674
4.期末基金资产净值	364,714,719.01
5.期末基金份额净值	1.007

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-37.32%	3.60%	-32.06%	4.29%	-5.26%	-0.69%

3.2.2 目基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2015年6月26日)。
2.本基金建仓期自2015年6月26日至2015年12月26日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
杨旭	本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证900金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年6月26日	-	3	数学金融硕士,运筹管理学硕士,纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methodx公司数量分析师,华尔街对冲基金WSFA Group公司助理基金经理,该基金为股票多空型对冲基金。2012年8月加入信诚基金,曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理。

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《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证信息安全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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,全球资金都降低在股票市场的配置,美国预期进入加息周期,叠加美元对新兴市场货币升值导致热钱流出新兴市场,市场担心全球经济失去增长动力。在三季度开始,市场依然在去杠杆的过程,由于市场下跌,引发的一系列融资盘强行平仓。但8月下旬,股票市场开始震荡,成交量下降。一方面资金宽松,整体资本市场处于缺资产时期,资金没有去处;另一方面,股市估值有较大修正,配资也有序的清理,政策方面有稳定股市的倾向,导致从8月底开始市场处于弱平衡状态。

信诚中证信息安全于2015年6月26日成立,截至本报告期末该基金仍处于建仓期。

展望四季度,我们认为经过三季度的市场调整,一方面部分板块与股票估值开始合理,叠加高收益资产缺失的状况并无改变,另一方面,政府出台一系列稳增长政策,资金宽松,加上美联储再次议息要在12月,所以当政策出现窗口期这段时间,A股出现博弈机会。 但整体上权益市场仍然没有超跌到可以吸引大量长期投资者持有的位置。场内杠杆下降趋势并无明显改变,4季度出现反弹后的继续寻底的概率较大。但从更长时期,经济仍是以投资转向消费与创新的方向,IPO重启,养老金入市,改革与转型需要活跃的资本市场,所以对于权益市场长期并不悲观。但从2011年股指期货推出开启的金融创新的趋势,已经开始转变。未来仍看好能反映经济转型的方向如互联网,消费,新能源等相关板块。

4.5 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-37.32%,同期业绩比较基准收益率为-32.06%,基金落后业绩比较基准5.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	184,817,091.18	50.11
	其中:股票	184,817,091.18	50.11
2	固定收益投资	10,019,000.00	2.72
	其中:债券	10,019,000.00	2.72
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	173,390,067.64	47.01
7	其他资产	624,734.69	0.17
8	合计	368,850,893.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	89,521,516.81	24.55
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	95,295,574.37	26.13
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	-	-
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	184,817,091.18	50.67

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	000063	中兴通讯	610,027	9,516,421.20	2.61
2	600446	金证股份	302,250	7,680,172.50	2.11
3	300017	网宿科技	126,410	6,663,071.10	1.83
4	600100	同方股份	460,000	6,614,800.00	1.81
5	002230	科大讯飞	232,800	6,239,040.00	1.71
6	600804	鹏博士	288,200	6,204,946.00	1.70
7	600570	恒生电子	127,900	5,586,672.00	1.53
8	600118	中国卫星	153,139	5,479,313.42	1.50
9	002465	海格通信	388,566	4,961,987.82	1.36
10	300010	立思辰	265,980	4,620,072.60	1.27

5.3.2 报告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前五名股票投资明细
本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,019,000.00	2.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,019,000.00	2.75

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15国债09	100,000	10,019,000.00	2.75

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期初及报告期内均未持有股指期货投资。
5.9.2 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,即时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。
本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细