信诚中证800医药指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月22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2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚中证800医药指数分级		
场内简称	信诚医药		
基金主代码	165519		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月16日		
报告期末基金份额总额	315,813,738.40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800制药与生物科技指数的有效跟踪,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800制药与生物科技指数收益率+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。从本基金所分离的两类基金份额来看,医药800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;医药800B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。		
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800医药指数分级A	信诚中证800医药指数分级B	信诚中证800医药指数分级
下属分级基金的场内简称	医药800A	医药800B	信诚医药
下属分级基金的交易代码	150148	150149	165519
报告期末下属分级基金的份额总额	90,546,850.00份	90,546,850.00份	134,720,038.40份
下属分级基金的风险收益特征	医药800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征	医药800B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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	4,442,779.40
2.本期利润	53,762,288.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.1670
4.期末基金资产净值	281,652,189.88
5.期末基金份额净值	0.892

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。

3.2 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	22.50%	1.73%	20.20%	1.73%	2.30%	0.00%

3.2.2 自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:本基金建仓日自2013年8月16日至2014年2月16日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证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、信诚中证智能家居指数分级基金、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1月15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 methods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、信诚中证智能家居指数分级基金、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。

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800医药指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800医药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

过去一个季度,首先经济层面上,实体经济继续没有形成可被加杠杆的资产,政府从过去改善需求端的产能输出政策转化为产能兼并整合的供给侧改革政策,经济上时间换空间不可避免,经济需要货币继续宽松调结构。其次政策面上, IPO的开启, 券商解禁减持, 看出政府延续上半年对资本市场的思路,即建立资本市场给高新企业融资,给经济转型提供所需资金,而股市的走势会被高度监管。再次从资金面,利率继续向下行,中美国债息差制约国内利率下行空间,叠加明年继续缺少资产与资本管制,市场出现低利率,低增长,低回报的环境。对A股市场,从市场角度看,指数到了筹码密集区,在缺乏增量资金的情况下,指数向上的空间有限,但向下又有流动性脱底,加上内外政策与国内外市场的不确定性,导致市场波动变大;整体上四季度A股震荡向上,指数向上空间有限与板块和主题机会出现的局面。 在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中,有效地管理跟踪误差。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。

医药:截至本报告期末,本基金份额净值增长率为22.50%,同期比较基准收益率为20.20%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.3%之内,年化跟踪误差为2.50%。

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22.50%,同期比较基准收益率为20.20%,基金超越业绩比较基准2.30%。

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	263,523,744.03	93.22
	其中:股票	263,523,744.03	93.22
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,473,984.90	6.54
7	其他资产	692,377.76	0.24
8	合计	282,690,106.69	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	255,913,213.38	90.86
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	2,087,606.10	0.74
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	5,522,924.55	1.96
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	263,523,744.03	93.56

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。

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	600276	恒瑞医药	368,855	18,118,157.60	6.43
2	000538	云南白药	163,652	11,884,408.24	4.22
3	600085	同仁堂	215,468	9,612,027.48	3.41
4	000423	东阿阿胶	164,384	8,597,283.20	3.05
5	600196	复星医药	360,248	8,462,225.52	3.00
6	600535	天士力	203,678	8,334,503.76	2.96
7	002219	恒康医疗	445,917	8,106,771.06	2.88
8	000623	吉林敖东	224,864	6,959,540.80	2.47
9	002252	上海莱士	173,270	6,890,947.90	2.45
10	600867	通化东宝	249,813	6,787,419.21	2.41

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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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,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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	656,127.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,171.24
5	应收申购款	32,079.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	692,377.76

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	002219	恒康医疗	8,106,771.06	2.88	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

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证800医药指数分级A	信诚中证800医药指数分级B	信诚中证800医药指数分级
报告期期初基金份额总额	91,377,137.00	91,377,137.00	144,324,010.09
报告期期间基金总申购份额	-	-	34,414,022.74
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	52,771,066.54
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-830,287.00	-830,287.00	8,753,072.11
报告期期末基金份额总额	90,546,850.00	90,546,850.00	134,720,038.40

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。

2、根据《信诚中证800医药指数分级基金招募说明书》、《信诚基金关于信诚中证800医药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,基金管理人信诚基金管理有限公司于2015年12月15日(折算基准日)对本基金进行了基金份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚800医药份额7,092,498.11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

9.1 备查文件目录

1、信诚中证800医药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800医药指数分级证券投资基金基金合同
4、信诚中证800医药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
2016年1月22日

信诚中证800有色指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月22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2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚中证800有色指数分级		
场内简称	信诚有色		
基金主代码	165520		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月30日		
报告期末基金份额总额	417,945,658.39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800有色金属指数的有效跟踪,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800有色金属指数收益率+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。从本基金所分离的两类基金份额来看,有色800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;有色800B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。		
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800有色指数分级A	信诚中证800有色指数分级B	信诚中证800有色指数分级
下属分级基金的场内简称	有色800A	有色800B	信诚有色
下属分级基金的交易代码	150150	150151	165520
报告期末下属分级基金的份额总额	96,454,532.00份	96,454,532.00份	225,036,594.39份
下属分级基金的风险收益特征	有色800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征	有色800B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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-25,232,195.74
2.本期利润	107,064,417.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.2623
4.期末基金资产净值	446,001,175.46
5.期末基金份额净值	1.067

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。

3.2 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	33.50%	2.30%	20.48%	1.93%	13.02%	0.37%

3.2.2 自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:本基金建仓日自2013年8月30日至2014年2月28日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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金融指数分级基金及信诚中证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、信诚中证智能家居指数分级基金、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1月15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 methods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、信诚中证智能家居指数分级基金、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。

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800有色指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800有色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

过去一个季度,首先经济层面上,实体经济继续没有形成可被加杠杆的资产,政府从过去改善需求端的产能输出政策转化为产能兼并整合的供给侧改革政策,经济上时间换空间不可避免,经济需要货币继续宽松调结构。其次政策面上, IPO的开启, 券商解禁减持, 看出政府延续上半年对资本市场的思路,即建立资本市场给高新企业融资,给经济转型提供所需资金,而股市的走势会被高度监管。再次从资金面,利率继续向下行,中美国债息差制约国内利率下行空间,叠加明年继续缺少资产与资本管制,市场出现低利率,低增长,低回报的环境。对A股市场,从市场角度看,指数到了筹码密集区,在缺乏增量资金的情况下,指数向上的空间有限,但向下又有流动性脱底,加上内外政策与国内外市场的不确定性,导致市场波动变大;整体上四季度A股震荡向上,指数向上空间有限与板块和主题机会出现的局面。 在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中,有效地管理跟踪误差。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。

有色:截至本报告期末,本基金份额净值增长率为33.50%,同期比较基准收益率为20.48%。报告期内,本基金日均跟踪误差为0.38%,年化跟踪误差为9.36%。

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33.50%,同期业绩比较基准收益率为20.48%,基金超越业绩比较基准13.02%。

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	417,188,826.37	93.19
	其中:股票	417,188,826.37	93.19
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	28,893,986.77	6.45
7	其他资产	1,609,767.00	0.36
8	合计	447,692,580.14	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	155,769,963.44	34.93
C	制造业	261,418,862.93	58.61
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	-	-
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	417,188,826.37	93.54

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	601899	紫金矿业	8,104,700	28,528,544.00	6.40
2	600111	北方稀土	2,015,503	28,257,352.06	6.34
3	601600	中国铝业	4,683,765	23,278,312.05	5.22
4	000519	江南红箭	1,240,040	21,055,879.20	4.72
5	000060	中金岭南	1,351,761	18,965,206.83	4.25
6	600673	东阳光科	1,675,758	17,075,974.02	3.83
7	002340	格林美	987,841	15,015,183.20	3.37
8	000831	五矿稀土	708,124	14,658,166.80	3.29
9	600547	山东黄金	689,902	14,487,942.00	3.25
10	600489	中金黄金	1,426,917	14,169,285.81	3.18

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

本基金本报告期末,未持有债券投资。

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

本基金本报告期末,未持有债券投资。

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

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,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	1,583,147.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,270.96
5	应收申购款	19,348.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,609,767.00

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	002340	格林美	15,015,183.20	3.37	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,未持有积极投资的股票投资。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证800有色指数分级A	信诚中证800有色指数分级B	信诚中证800有色指数分级
报告期期初基金份额总额	92,641,780.00	92,641,780.00	213,582,061.60
报告期期间基金总申购份额	-	-	220,670,376.73
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	206,665,918.74
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	3,812,752.00	3,812,752.00	-2,549,925.20
报告期期末基金份额总额	96,454,532.00	96,454,532.00	225,036,594.39

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导致的份额变动。

2、根据《信诚中证800有色指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800有色指数分级证券投资基金招募说明书》、《信诚基金关于信诚中证800有色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,基金管理人信诚基金管理有限公司于2015年12月15日(折算基准日)对本基金进行了基金份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚800有色份额5,075,578.80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

9.1 备查文件目录

1、信诚中证800有色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800有色指数分级证券投资基金基金合同
4、信诚中证800有色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
2016年1月22日

信诚中证800金融指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:信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:2016年1月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚中证800金融指数分级		
场内简称	信诚金融		
基金主代码	165521		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年12月20日		
报告期末基金份额总额	3,141,341,521.06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800金融指数的有效跟踪,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800金融价格指数收益率+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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	信诚中证800金融指数分级A	信诚中证800金融指数分级B	信诚中证800金融指数分级
下属分级基金的场内简称	金融A	金融B	信诚金融
下属分级基金的交易代码	150157	150158	165521
报告期末下属分级基金的份额总额	1,487,714,235.00份	1,487,714,236.00份	165,913,050.06份
下属分级基金的风险收益特征	金融A份额具有预期风险、预期收益较低的特征	金融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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-16,150,795.95
2.本期利润	483,744,180.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.1588
4.期末基金资产净值	3,116,269,475.68
5.期末基金份额净值	0.992

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。

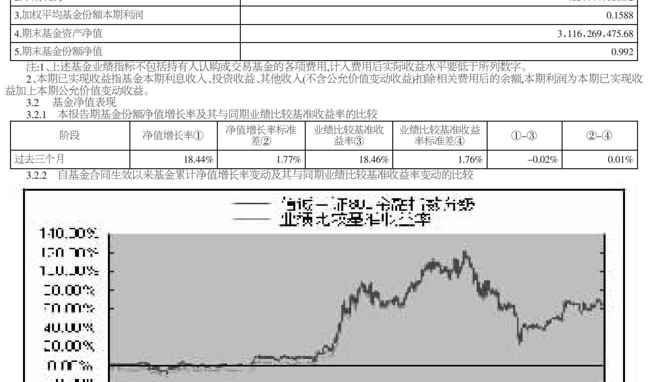
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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	18.44%	1.77%	18.46%	1.76%	-0.02%	0.01%

3.2.2 自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:本基金建仓日自2013年12月20日至2014年6月20日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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有色指数分级基金及信诚中证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、信诚中证智能家居指数分级基金、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1月15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 methods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、信诚中证智能家居指数分级基金、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。

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800金融指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800金融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

过去一个季度,首先经济层面上,实体经济继续没有形成可被加杠杆的资产,政府从过去改善需求端的产能输出政策转化为产能兼并整合的供给侧改革政策,经济上时间换空间不可避免,经济需要货币继续宽松调结构。其次政策面上, IPO的开启, 券商解禁减持, 看出政府延续上半年对资本市场的思路,即建立资本市场给高新企业融资,给经济转型提供所需资金,而股市的走势会被高度监管。再次从资金面,利率继续向下行,中美国债息差制约的国内利率下行空间,叠加明年继续缺少资产与资本管制,市场出现低利率,低增长,低回报的环境。对A股市场,从市场角度看,指数到了筹码密集区,在缺乏增量资金的情况下,指数向上的空间有限,但向下又有流动性脱底,加上内外政策与国内外市场的不确定性,导致市场波动变大;整体上四季度A股震荡向上,指数向上空间有限与板块和主题机会出现的局面。 在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中,有效地管理跟踪误差。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。

金融:截至本报告期末,本基金份额净值增长率为18.44%,同期比较基准收益率为18.46%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.3%之内,年化跟踪误差为1.51%。

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18.44%,同期比较基准收益率为18.46%,基金落后业绩比较基准0.02%。

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	2,938,350,324.70	94.14
	其中:股票	2,938,350,324.70	94.14
2	固定收益投资	80,264,000.00	2.57
	其中:债券	80,264,000.00	2.57
	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	95,537,348.04	3.06
7	其他资产	7,035,480.61	0.23
8	合计	3,121,187,153.35	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	-	-
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	2,938,350,324.70	94.29
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	2,938,350,324.70	94.29

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。

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	601318	中国平安	9,380,477	337,697,172.00	10.84
2	600016	民生银行	25,908,788	249,760,716.32	8.01
3	601166	兴业银行	11,692,627	199,593,142.89	6.40
4	600036	招商银行	9,043,005	162,683,659.95	5.22
5	600000	浦发银行	8,176,988	149,393,570.76	4.79
6	601328	交通银行	20,647,292	132,968,560.48	4.27
7	600030	中信证券	6,815,766	131,885,072.10	4.23
8	600837	海通证券	7,007,303	110,855,533.46	3.56
9	601288	农业银行	33,514,684	108,252,429.32	3.47
10	601169	北京银行	8,888,056	93,591,229.68	3.00

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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,264,000.00	2.58
	其中:政策性金融债	80,264,000.00	2.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,264,000.00	2.58

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	150307	15进出07	800,000	80,264,000.00	2.58

注:本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

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。本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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,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中信证券于2015年1月16日因存在违规到期融资融券合约展期问题,公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施(《中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况》)。又因在融资融券业务开展过程中,存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"规定之嫌,于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会调查通知书(稽查总队调查通字153121号)。

对中信证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,该处罚事项未对中信证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚800金融是指数型基金,对于中信证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

海通证券于2015年1月16日因存在违规为到期融资融券合约展期问题, 公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施(《中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况》)。因涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规,于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书(处罚字[2015]73号)。又因在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按规定与客户签订业务合同"的规定,于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(稽查总队调查通字153122号)。

对海通证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,上述处罚事项未对海通证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚800金融是指数型基金,对于海通证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	2,740,536.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,273,248.69
5	应收申购款	2,021,695.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,035,480.61

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证800金融指数分级A	信诚中证800金融指数分级B	信诚中证800金融指数分级
报告期期初基金份额总额	1,434,653,983.00	1,434,653,984.00	197,409,417.84
报告期期间基金总申购份额	-	-	481,045,379.51
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	503,503,685.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	53,060,252.00	53,060,252.00	-9,038,061.66
报告期期末基金份额总额	1,487,714,235.00	1,487,714,236.00	165,913,050.06

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。

2.根据《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚基金关于信诚中证800金融指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的提示性公告》、《信诚基金关于信诚中证800金融指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告》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12月15日(折算基准日)对本基金进行了基金份额定期份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚800份额97,082,442.34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

9.1 备查文件目录

1、信诚中证800金融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800金融指数分级证券投资基金基金合同
4、信诚中证800金融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
2016年1月22日