

信诚中证800医药指数分级证券投资基金

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
报告截止日期:2014年7月21日

1 重要提示
基金管理人承诺遵守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2014年7月17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预示其未来表现,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。
本报告期内基金未发生诉讼、仲裁事项。
本报告自2014年4月1日起至6月30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:诚医药)
基金主代码	166320
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2013年8月16日
报告期末基金份额总额	146,897,808.707
投资目标	紧密跟踪中证800医药指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现投资合同约定的收益目标。
投资策略	本基金原则上采用完全复制策略跟踪标的指数,即按照标的指数中成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股组成及其权重进行动态调整。当标的指数成份股发生变动、增发、送股、分红、停牌、退市等影响成份股在标的指数中权重的因素时,本基金管理人将对投资组合进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	95%×中证800医药指数收益率+5%×人民币元
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水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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
下属一级基金的基金简称	信诚中证800医药指数分级A(场内简称:诚医药A)
下属一级基金的交易代码	150148
报告期末一级基金基金份额总额	32,997,134.067
下属二级基金的风险收益特征	80%医药A份额具有预期风险、预期收益较低的特征,20%医药B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-2,233,445.82
2.本期利润	49,326.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0026
4.期末基金资产净值	139,182,070.44
5.期末基金份额净值	0.947

注:1.本基金合同生效日至报告期末(含)期间(本基金合同生效日为2013年8月16日),本基金净值表现的投资和收入、支出扣除应扣费用,并计入基金资产净值。
2.本基金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。

§3.1 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	业绩比较基准②	①-③	②-④
过去三个月	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%
过去六个月	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%
过去一年	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%
过去三年	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%
过去五年	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%
过去十年	0.42%	0.82%	0.60%	0.82%

§3.2 本基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较