

信诚中证智能家居指数分级证券投资基金招募说明书摘要

(2016年第1次更新)

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
重要提示

本基金于2015年6月26日基金合同正式生效。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。
投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。
本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对该基金合同的承认和接受,并视同《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人了解了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2015年12月26日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日(未经审计)。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称： 信诚基金管理有限公司
住所： 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
办公地址： 上海市浦东世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
法定代表人：张翔燕
成立日期： 2005年9月30日
批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号
注册资本： 贰亿元人民币
电话： (021) 68949788
联系人： 唐世春
股权结构：

股东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
中信信托有限责任公司	9000	49
英国保诚集团股份有限公司	9000	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合计	20000	100

(二)主要人员情况
1.董事会成员

张翔燕女士,董事长,硕士学位。历任中信银行总行运营管理部副总经理、综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长,中信银行总行运营部副总经理,中信证券股份有限公司副总经理,中信控股有限责任公司风险管理部总经理,中信银行股份有限公司副总裁,中国中信集团有限公司业务协同部主任,现任中信信托有限责任公司副董事长、中信诚资产管理有限公司(信诚基金管理有限公司之子公司)监事。

陈一松先生,董事,金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书,中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任、中信信托有限责任公司总经理。现任中信信托有限责任公司董事长。

王道远先生,董事,工商管理硕士。历任中信信托有限责任公司综合管理部总经理、信托管理部总经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理、董事会秘书,拥有业务审查委员会主任兼天津信唐律师事务所经行有限责任公司董事长。

Guy Robert STRAPP先生,董事,商科科学士。历任瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官,英国保诚集团亚洲区资产管理业务副总裁、瀚亚投资(新加坡)有限公司首席执行官。现任瀚亚投资集团首席执行官兼瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官。

黄慧敏女士,董事,新加坡籍,经济学学士。历任花旗银行消费金融事业部副经理、新加坡大华银行业务开发助理、大宇资产管理公司营销企划经理、瀚亚投资(新加坡)有限公司营销管理部主管、瀚亚投资(台湾)有限公司市场总监。现任瀚亚投资(台湾)有限公司总经理。

魏秀彬女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太区区域合规及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财经经济研究所副所长、研究员,中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任等职。现任中国社会科学院金融研究所副所长、研究员、博士生导师。

夏伙东先生,独立董事,经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨恩群先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财经经济研究所研究员,现任清华大学经济管理学院经济系教授。
注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金业务管理”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资,其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.监事
于女士,监事,经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行运营管理部主管、通用电气金融财务(中国)有限公司人力资源经理。现任信诚基金管理有限公司首席人力资源官。

3.经营管理层人员情况
吕海先生,总经理,工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司(中信证券股份有限公司的全资子公司,2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并)总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理部副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂晓悦先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计师,中乔智诚通广告有限公司财务主管,德国德意志银行上海分行财务经理,信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

唐世春先生,副总经理,法学硕士。历任北京天平律师事务所律师,国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书,信诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、中信诚资产管理有限公司董事。现任信诚基金管理有限公司高级审计师、首席市场官。

陶晓伟先生,副总经理,经济学硕士,注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场总监、首席市场官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、兼任中信信诚资产管理有限公司董事、总经理。

4.督察长
周浩先生,督察长,法学硕士,历任中国证券监督管理委员会主任科员、公职律师、副调研员,上海航运产业基金管理有限公司合规总监、国政安基金管理有限公司督察长。现任信诚基金管理有限公司督察长。

5.基金经理
杨旭先生,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WSPA 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900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、信诚新回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新回报灵活配置混合型证券投资基金(LOP)、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及信诚中证基建工程指数分级证券投资基金的基金经理。

6.投资决策委员会成员
胡洁女士,副首席投资官、特定资产投资管理总监;
王旭巍先生,副首席投资官;
董越先生,交易总监;
张光成先生,股票投资副总监;
王睿先生,研究副总监、基金经理。
上述人员之间不存在近亲属关系。

(二)基金托管人
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾玖亿肆仟柒佰玖拾玖万叁仟玖佰玖拾玖元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金【1998】24号
托管部门信息披露联系人:王沐民
客服电话:95566
传真:(010) 66594942

(三)基金投资范围及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1989年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况
截至2015年9月30日,中国银行已托管401只证券投资基金,其中境内基金375只,QDII基金26只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构
(一)基金份额发售机构
1.场外销售机构
(1)直销机构
信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
住所: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
办公地址: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
法定代表人:张翔燕
电话:(021) 6894 9788
联系人:钱慧

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址: <http://www.xcfund.com>

(2)其他销售机构
1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
传真:010-66594946
电话:010-66594977
网址:www.boccm

2)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:(021) 58781234
传真:(021) 58408483
联系人:曹越
客户服务电话:95569
网址:www.bankcomm.com

3)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座(邮编:518048)
法定代表人:王东明
联系人:周峻
电话:0755-23835889,010-60838888
传真:0755-23835861,010-60839029

4)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王东明
联系人:周峻
电话:0755-23835889,010-60838888
传真:0755-23835861,010-60839029

5)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:李卫
联系人:林生迎
电话:(0755) 82943666
电话:(0755) 82943636
传真:(0755) 82943636
网址:www.newone.com.cn
客服电话:95565,4008881111
9) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:广东省深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务电话:0755-82130833
传真:0755-82130833
全国统一客户服务电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn
客服电话:95565,4008881111
9) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:广东省深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务电话:0755-82130833
传真:0755-82130833
全国统一客户服务电话:95536
公司网站: www.guosen.com.cn
10) 海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
客户服务电话:021-95553或4008888001
联系人:李莹鸣
网站:www.htsec.com
11) 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0631-81283938
传真:0631-81283900
全国统一客户服务电话:95536
公司网站: www.qlzq.com.cn
12) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:徐汇区龙田路195号302室
法定代表人:其实
电 话:021-54509998
传 真:021-64385308
13) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
电 话:021-33232998
传 真:021-33232993
网站:funddundtrade.com
客户服务电话:400-820-2819
14) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
电 话:0571-88911818
传 真:0571-88900423
公司网站:www.5ifund.com
客服电话:4008-773-772
15) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区金钟路658号2楼B座8楼6楼
法定代表人:燕斌
电 话:021-51507071
传 真:021-62990063
网站: <http://www.91fund.com>
客服电话:4000-466-788
16) 北京创金恒富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁勇
电 话:010-66154828
传 真:010-88067526
网站: www.51rich.com
客户服务电话:400-6262-818
17) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号106室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人:肖雯
电 话:020-89629021
传 真:020-89629011
网站: www.yingmi.cn
客户服务电话:020-89629066
18) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
电 话:021-20666052
传 真:021-20666053
网站: www.lufunds.com
客户服务电话:4008219031
19) 泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场103号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场103号
邮政编码:116000
法定代表人:林楠
电话:0411-88991212
传真:0411-84396536
客服电话:4006411999
公司网站: www.taichengzhaifu.com
20) 上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈维武
电 话:021-63333389
网站: www.lingxiangfund.com
客户服务电话:4000178000
具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。
(二)登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系电话:010-59378935
传真:010-59378939
联系人:朱立元
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
经办律师:黎明、孙晔
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙晔
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:薛竞、俞伟敏

法定代表人:王常青
联系电话:(010) 85130688
开放式基金咨询电话:4008888108
网址: www.csc108.com
5) 中期资产管理有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张浩
联系人:洪城
电话:0755-23063913
网址: <http://www.citicsf.com/>
6) 中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层(266001)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心20层(266001)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0632-85022326
7) 中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层
21.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层
法定代表人:龙增来
统一客户服务热线:400-600-8008、95532
公司网站: www.cchina-invs.com
8) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:肖士林
联系人:林生迎
电话:(0755) 82943666
电话:(0755) 82943636
传真:(0755) 82943636
网站: www.newone.com.cn
客服电话:95565,4008881111
9) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:广东省深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务电话:0755-82130833
传真:0755-82130833
全国统一客户服务电话:95536
公司网站: www.guosen.com.cn
10) 海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
客户服务电话:021-95553或4008888001
联系人:李莹鸣
网站: www.htsec.com
11) 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0631-81283938
传真:0631-81283900
全国统一客户服务电话:95536
公司网站: www.qlzq.com.cn
12) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:徐汇区龙田路195号302室
法定代表人:其实
电 话:021-54509998
传 真:021-64385308
13) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
电 话:021-33232998
传 真:021-33232993
网站:funddundtrade.com
客户服务电话:400-820-2819
14) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
电 话:0571-88911818
传 真:0571-88900423
公司网站:www.5ifund.com
客服电话:4008-773-772
15) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区金钟路658号2楼B座8楼6楼
法定代表人:燕斌
电 话:021-51507071
传 真:021-62990063
网站: <http://www.91fund.com>
客服电话:4000-466-788
16) 北京创金恒富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁勇
电 话:010-66154828
传 真:010-88067526
网站: www.51rich.com
客户服务电话:400-6262-818
17) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号106室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人:肖雯
电 话:020-89629021
传 真:020-89629011
网站: www.yingmi.cn
客户服务电话:020-89629066
18) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
电 话:021-20666052
传 真:021-20666053
网站: www.lufunds.com
客户服务电话:4008219031
19) 泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场103号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场103号
邮政编码:116000
法定代表人:林楠
电话:0411-88991212
传真:0411-84396536
客服电话:4006411999
公司网站: www.taichengzhaifu.com
20) 上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈维武
电 话:021-63333389
网站: www.lingxiangfund.com
客户服务电话:4000178000
具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

2.场内销售机构:深圳证券交易所内具有基金销售业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,具体名单见基金份额发售公告。
基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

(二)登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系电话:010-59378935
传真:010-59378939
联系人:朱立元
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
经办律师:黎明、孙晔
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙晔
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:薛竞、俞伟敏

四、基金的名称
信诚中证智能家居指数分级证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
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。
七、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证智能家居指数的成份股、备选成份股、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和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例: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95%~100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的95%,投资于中证智能家居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所保证金后,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。
如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

八、基金的投资策略
本基金原则上采用完全复制法跟踪标的指数,即原则上按照标的指数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%。
当发生特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等),或因基金的申购和赎回等对基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和微调,力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构建替代投资组合:
1.基本面对替代:按照与被替代股票基本及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代投资组合;
2.相关性检验:计算备选池中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成替代组合,以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中替代股票的数量,并构建替代投资组合。

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、大量仓位调整,以及对冲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审批。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:95%×中证智能家居指数收益率+5%×金融同业存款利率。

十、基金的跟踪偏离度
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,信诚智能家居A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;信诚智能家居B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

十一、基金投资组合报告(未经审计)
本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、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基金合同的约定,于2015年10月23日复核了本招募更新中的投资组合报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的财务数据截止至2015年9月30日。

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	78,546,546.68	49.86
	其中:股票	78,546,546.68	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
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	3,204,392.12	2.03
8	合计	157,531,639.84	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,492,324.00	0.96
C	制造业	42,406,560.91	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	3,196,837.00	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、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	信息服务、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	78,546,546.68	50.36

2) 非指数投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末,未持有非指数投资的股票投资。

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

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

代码	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	46,974	1,369,451.18	0.87
8	000938	紫光股份	19,400	1,353,538.00	0.87
9	002236	大华股份	36,100	1,186,731.00	0.76
10	600756	浪潮软件	60,300	1,157,760.00	0.74

2) 报告期末非指数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,未持有非指数投资的股票投资。