# 信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金

## 2015 年度报告摘要

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
送出日期:2016年3月25日

§1重要提示

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2016年3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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。
本报告期:2015年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 593,548,607.04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 |
|---|---|---|---|
| 下属分级基金的场内简称 | 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 | 175,155,332.00份 | 175,155,332.00份 | 243,237,843.04份 |

2.2基金产品说明

| | | | |
|---|---|---|---|
| 投资目标 | 本基金运用数量化指数投资方法,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,按照证券指数编制的基准权重为基础,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,以及对中国其他期货品种或其他期货品种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 | | 信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 | haozhou@citicpru.com.cn | tianqing.ZZ@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-666-0066 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-50120888 | 010-66275853 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.xcfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§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

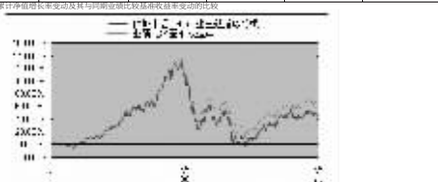
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015年 | 2014年11月28日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -537,248,288.24 | -340,607.16 |
| 本期利润 | -548,996,755.78 | -13,318,576.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.6043 | -0.0453 |
| 本期基金份额净值增长率 | 54.31% | -4.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3998 | -0.0448 |
| 期末基金资产净值 | 643,226,701.60 | 325,372,289.39 |
| 期末基金份额净值 | 1.084 | 0.965 |

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

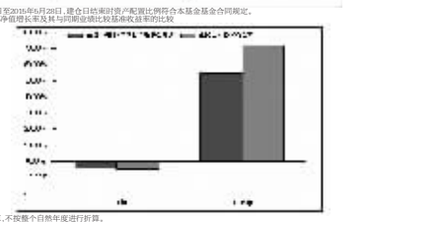
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 36.75% | 2.50% | 31.40% | 2.26% | 5.35% | 0.24% |
| 过去六个月 | -9.71% | 3.74% | -6.29% | 3.18% | -3.42% | 0.56% |
| 过去一年 | 54.31% | 3.28% | 71.73% | 2.90% | -17.42% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.36% | 3.14% | 62.92% | 2.83% | -15.56% | 0.31% |

3.2.2 自基金合同生效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



注:本基金建仓日自2014年11月28日至2015年6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。

3.2.3 自基金合同生效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



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行计算。

3.3其他指标
3.4过去一年基金的利润分配情况
本基金合同生效日为2014年11月28日,本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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
本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2006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,高回保证集团控股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40%、40%、2%。截至2015年12月31日,本基金管理人共管理36只基金,分别为信诚深证成份交易型开放式指数基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚盛世精选混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优势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)、信诚理财稳健债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国主题配置证券投资基金(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚沪市优质证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚优势配置混合型证券投资基金、信诚双禧定期开放债券型证券投资基金、信诚双益债券型证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚稳健收益债券型证券投资基金、信诚稳健增利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、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金(LOF)、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金和信诚中证基建工程指数分级证券投资基金。

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 | | |
| 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800金融指数分级基金、信诚中证800信息安全指数分级基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理 | 2015年2月5日 | - | 7 | 数学金融硕士,运筹管理学硕士,理约大学化学硕士。曾担任美国KPMG基金Robust methodologies公司数量分析师,美国摩根士丹利Quantitative Group分析师等。<br>杨旭先生为特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)、美国证券从业资格(Series 7)、美国基金从业资格(Series 63)、美国证券从业资格(Series 65)、美国证券从业资格(Series 66)、美国证券从业资格(Series 24)、美国证券从业资格(Series 99)、美国证券从业资格(Series 98)、美国证券从业资格(Series 79)、美国证券从业资格(Series 87)、美国证券从业资格(Series 55)、美国证券从业资格(Series 9)、美国证券从业资格(Series 10)、美国证券从业资格(Series 7)、美国证券