信诚中证800医药指数分级证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:中信保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:2019年04月18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2019年4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2019年1月1日起至3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	168519		
交易代码	–	–	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年08月16日		
报告期末基金份额总额	200,741,073.46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资金管理,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,从本基金所分属的两类基金份额来看,医药300A份额具有预期风险、预期较高收益的特征;医药300B份额具有预期风险、预期较低收益的特征。		
基金管理人	中信保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300A	医药300B	信诚医药
下属分级基金的交易代码	150148	150149	168519
报告期末下属分级基金的份额总额	40,987,648.00份	40,987,648.00份	118,765,777.46份
下属分级基金的风险收益特征	医药300A份额具有预期风险、预期较高收益的特征。	医药300B份额具有预期风险、预期较低收益的特征。	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。

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

§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 (2019年01月01日–2019年03月31日)
1.本期已实现收益	-2,838,166.35
2.本期利润	38,975,412.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1894
4.期末基金资产净值	176,721,636.84
5.期末基金份额净值	0.880

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。

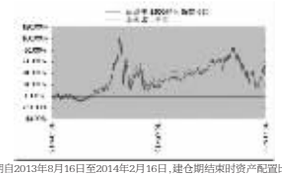
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	27.54%	1.62%	28.00%	1.66%	-0.46%	-0.04%

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:本基金建仓期自2013年8月16日至2014年2月16日,建仓期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,量化投资部总监,兼任信诚中证800医药指数分级基金,信诚中证800金融指数分级基金,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,信诚中证基建工程指数型基金(LOF),信诚至裕灵活配置混合基金,信诚新锐回报灵活配置混合基金,信诚量化阿尔法股票基金,中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。	2015年1月15日	–	6	理学硕士,文学硕士。曾任职于美国对冲基金Robust methods公司,担任数量分析师;于华尔街对冲基金WSPA Group公司,担任Global Systematic Alpha Fund助理基金经理。2012年8月加入中信保诚基金管理有限公司,历任助理投资经理,专户投资经理,现任量化投资部总监,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,信诚中证基建工程指数型基金(LOF),信诚至裕灵活配置混合基金,信诚新锐回报灵活配置混合基金,信诚新兴产业混合基金,信诚新沪深回报灵活配置混合基金,信诚量化阿尔法股票基金,中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。

4.2

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。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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)。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年一季度,由于外围美联储加息节奏放慢、中美贸易谈判近期取得积极进展和国内货币政策宽松叠加带来的流动性冲击,市场情绪修复,报告期内,上证综指上涨23.93%,深证成指上涨36.84%,中证500上涨33.10%,创业板指上涨35.43%。

报告期内,本基金坚持既定的指数化投资策略,及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值。

4.6 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27.54%,同期比较基准收益率为28.00%,基金落后业绩比较基准0.46%。

4.7 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	167,247,912.51	94.08
	其中:股票	167,247,912.51	94.08
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	21,000.00	0.01
	其中:债券	21,000.00	0.01
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	9,683,316.03	5.45
8	其他资产	810,713.18	0.46
9	合计	177,762,941.72	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境内股票投资组合

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	147,571,930.19	83.51
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	16,705,816.28	9.45
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	2,621,476.50	1.48
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	166,899,063.67	94.44

5.2.2 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	181,602.90	0.10
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	32,902.94	0.02
J	金融业	134,343.00	0.08
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	348,848.84	0.20

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	448,132	29,316,796.44	16.59
2	000538	云南白药	82,976	7,094,619.00	4.01
3	000661	长春高新	21,687	6,874,562.13	3.89
4	600436	片仔癀	48,099	5,526,576.10	3.13
5	300142	沃森生物	196,000	4,998,000.00	2.83
6	600196	复星医药	160,248	4,772,118.44	2.70
7	002007	华兰生物	89,060	4,007,250.00	2.27
8	002422	科伦药业	127,700	3,980,415.00	2.26
9	600867	通化东宝	227,100	3,942,456.00	2.23
10	300122	智飞生物	76,471	3,907,668.10	2.21

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

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.08
2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.05
3	603279	三美股份	1,231	39,921.33	0.02
4	603681	永冠新材	1,767	33,855.72	0.02
5	300766	每日互动	1,193	32,902.94	0.02

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	–	–
	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(可交换债)	21,000.00	0.01
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	21,000.00	0.01

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	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113531	百姓转债	210	21,000.00	0.01

本基金本报告期末仅持有上述债券投资。

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

本基金本报告期末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资金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

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批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券投资。

5.11.2 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.2.1 报告期末权益投资前五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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603279	三美股份	39,921.33	0.02	新股未上市

5.11.2.2 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603279	三美股份	39,921.33	0.02	新股未上市

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 基金中基金

6.1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基金投资明细

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

§7 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	41,276,636.00	41,276,636.00	124,922,961.36
报告期期间基金总申购份额	–	–	14,828,964.16
减:报告期期间基金总赎回份额	–	–	21,564,124.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-288,988.00	-288,988.00	577,976.00
报告期期末基金份额总额	40,987,648.00	40,987,648.00	118,765,777.46

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间		期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-01-01 至 2019-01-08,2019-03-15 至 2019-03-20,2019-03-22 至 2019-03-26,2019-03-27 至 2019-03-31		42,835,762.00	–	2,565,262.00	40,270,500.00	20.06%
个人	–	–		–	–	–	–	–

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:

(1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金在位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回(反日额赎回,基金管理人可酌根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如需连续2个开放日以上(含本数)发生日额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资策略不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§11 备查文件目录

11.1 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、中信保诚基金管理公司营业执照

3、信诚中证800医药指数分级证券投资基金合同

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

11.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地——中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

11.3 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.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2019年04月18日

信诚中证800金融指数分级证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:中信保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:2019年04月18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2019年4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2019年1月30日起至3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		
交易代码	–	–	
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	898,497,288.91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资金管理,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	中信保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	406,384,527.00份	406,384,528.00份	45,728,225.91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、预期较高收益的特征。	金融B份额具有预期风险、预期较低收益的特征。	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。

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

§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 (2019年01月01日–2019年03月31日)
1.本期已实现收益	-3,111,320.72
2.本期利润	193,808,476.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.2193
4.期末基金资产净值	898,725,670.58
5.期末基金份额净值	1.047

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。

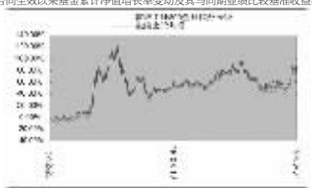
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	26.60%	1.82%	26.51%	1.82%	0.09%	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:本基金建仓期自2013年12月20日至2014年6月20日,建仓期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		
王睿	现任本基金基金经理,兼任信诚精选混合基金,信诚优胜精选混合基金,信诚精萃成长混合基金的基金经理。	2019年1月30日	–	9	经济学硕士,曾任职于上海证券报,中国证券报,担任咨询师;于美国国际集团(AIG),担任投资部研究员,2009年10月加入中信保诚基金管理有限公司,历任研究员,专户投资经理,现任研究部总监,信诚优胜精选混合基金,中信保诚精萃成长混合基金,中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理。

4.2

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。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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,投资研究前端一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时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。

4.4.2 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)。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年一季度,经济下行压力下市场并未受到太大影响,相反由高弹性板块带动的上涨仍在持续。沪深300指数与中证800金融指数2019年均上涨30%以上。近期需警惕市场回调、资金南撤等风险。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,在震荡市场环境中及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值。

4.6 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26.60%,同期比较基准收益率为26.51%,基金超越业绩比较基准0.09%。

4.7 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	822,654,628.38	94.66
	其中:股票	822,654,628.38	94.66
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,565,000.00	0.29
	其中:债券	2,565,000.00	0.29
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	43,416,817.47	4.82
8	其他资产	2,141,210.13	0.24
9	合计	900,767,655.98	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境内股票投资组合

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	852,279,054.51	94.83
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	375,473.87	0.04

5.2.2 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	208,227.93	0.02
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	32,902.94	0.00
J	金融业	134,343.00	0.01
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	375,473.87	0.04

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	1,721,497	132,742,838.70	14.77
2	600036	招商银行	2,184,080	74,083,993.60	8.24
3	601166	兴业银行	2,639,264	47,966,281.52	5.34
4	600030	中信证券	1,666,960	41,307,021.00	4.60
5	601328	交通银行	5,817,482	36,302,398.08	4.04
6	600016	民生银行	5,257,766	33,334,236.44	3.71
7	601288	农业银行	8,112,184	30,258,446.32	3.37
8	600000	浦发银行	2,485,968	28,041,719.04	3.12
9	601398	工商银行	4,568,572	25,446,946.04	2.83
10	600837	海通证券	1,712,503	24,026,417.00	2.67

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

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.01
2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.01
3	603279	三美股份	2,052	66,546.36	0.01
4	603681	永冠新材	1,767	33,855.72	0.00
5	300766	每日互动	1,193	32,902.94	0.00

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	–	–
	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(可交换债)	2,565,000.00	0.28
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	2,565,000.00	0.28

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	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110053	苏银转债	25,560	2,565,000.00	0.28

本基金本报告期末仅持有上述债券投资。

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