信诚中证800有色指数分级证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月20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2015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	2,090,154,887.91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	909,056,638.00份	909,056,638.00份	272,041,611.91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

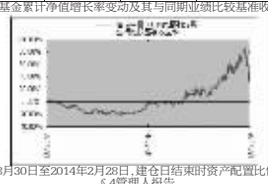
主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	331,019,779.41
2.本期利润	186,431,328.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0874
4.期末基金资产净值	1,889,246,243.48
5.期末基金份额净值	0.904

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	6.79%	3.04%	9.37%	2.78%	-2.58%	0.26%

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有色指数分级基金、信诚中证500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的基金经理	2015年1月15日	-	2	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500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

二季度市场大幅震荡,股票市场投机氛围过大,过渡使用杠杆,监管层开始清理场外配资,各类配资盘触发平仓线而使市场出现较大下跌。短期内市场去杠杆的过程仍然没有结束,由于市场快速下跌,引发的一系列融资盘强行平仓,短期股票市场走势是由去杠杆造成的流动性塌陷与救市政策的力度决定的。如果政策能及时缓解流动性与歇制住A股的恐慌,那么市场会进入相对理性,市场会优先选择对于上市公司业绩与估值合理的股票。长期看来,改革与创新的逻辑依然存在,我们依旧看好国家战略与国企改革方向,和能代表未来经济增长的方向,如先进制造行业,高端装备,中国制造2025,新能源汽车等产业主题。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为6.79%,同期比较基准收益率为9.37%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.35%之内,年化跟踪误差不超过4%。

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	1,793,253,663.67	94.55
	其中:股票	1,793,253,663.67	94.55
2	固定收益投资	30,120,000.00	1.59
	其中:债券	30,120,000.00	1.59
	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	70,794,885.00	3.73
7	其他资产	2,534,774.73	0.13
8	合计	1,896,703,323.40	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	674,879,942.89	35.72
C	制造业	1,118,373,720.78	59.20
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	1,793,253,663.67	94.92

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	30,036,252	153,785,610.24	8.14
2	601600	中国铝业	13,886,646	129,562,407.18	6.86
3	600111	北方稀土	6,897,443	125,119,616.02	6.62
4	000060	中金岭南	4,203,061	78,134,903.99	4.14
5	601168	西部矿业	6,027,531	65,820,638.52	3.48
6	600219	南山铝业	6,280,467	63,369,912.03	3.35
7	600489	中金黄金	4,661,558	59,994,251.46	3.18
8	600362	江西铜业	2,629,530	56,561,190.30	2.99
9	600547	山东黄金	2,253,913	55,671,651.10	2.95
10	000878	云南铜业	2,966,490	54,969,059.70	2.91

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

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	30,120,000.00	1.59
	其中:政策性金融债	30,120,000.00	1.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,120,000.00	1.59

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	140223	14国开23	300,000	30,120,000.00	1.59

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。

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	1,265,572.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,033,101.90
5	应收申购款	207,528.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	28,571.36
8	其他	-
9	合计	2,534,774.73

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
11	000878	云南铜业	54,969,059.70	2.91	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	620,292,346.00	620,292,346.00	208,262,403.69
报告期期间基金总申购份额	-	-	1,402,284,503.08
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	1,469,238,166.11
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	288,764,292.00	288,764,292.00	130,732,871.25
报告期期末基金份额总额	909,056,638.00	909,056,638.00	272,041,611.91

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有色指数分级证券投资基金合同》,《信诚中证800有色指数分级证券投资基金办理不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4月24日(折算基准日)对本基金进行了基金份额不定期份额折算。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中证800有色分级708,261,455.25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
2015年7月20日

信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月20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2015年7月16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
报告期末基金份额总额	2,640,954,526.26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,按照成份股在标的指数中的基准权重为基础,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%。 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。
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	1,038,300,216.00份	1,038,300,216.00份	564,354,094.26份
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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

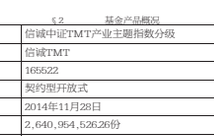
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	167,506,556.24
2.本期利润	-161,748,519.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1003
4.期末基金资产净值	1,891,511,175.79
5.期末基金份额净值	0.716

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	10.43%	3.32%	15.06%	3.12%	-4.63%	0.20%

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:1.基金合同生效起至本报告期末不满一年本基金合同生效日为2014年11月28日)。
2.本基金建仓日自2014年11月28日至2015年5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有色指数分级基金、信诚中证500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的基金经理	2015年2月5日	-	2	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500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TMT产业主题指数分级证券投资基金合同》、《信诚中证TMT产业主题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

二季度市场大幅震荡,股票市场投机氛围过大,过渡使用杠杆,监管层开始清理场外配资,各类配资盘触发平仓线而使市场出现较大下跌。短期内市场去杠杆的过程仍然没有结束,由于市场快速下跌,引发的一系列融资盘强行平仓,短期股票市场走势是由去杠杆造成的流动性塌陷与救市政策的力度决定的。如果政策能及时缓解流动性与歇制住A股的恐慌,那么市场会进入相对理性,市场会优先选择对于上市公司业绩与估值合理的股票。长期看来,改革与创新的逻辑依然存在,我们依旧看好国家战略与国企改革方向,和能代表未来经济增长的方向,如先进制造行业,高端装备,中国制造2025,新能源汽车等产业主题。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为10.43%,同期比较基准收益率为15.06%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.35%之内,年化跟踪误差不超过4%。

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	1,731,899,306.01	87.10
	其中:股票	1,731,899,306.01	87.10
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	121,159,209.35	6.09
7	其他资产	135,279,309.74	6.80
8	合计	1,988,337,825.10	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	758,913,531.80	40.12
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	66,656,750.70	3.52
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	770,926,318.95	40.76
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	134,630,133.56	7.12
S	综合	-	-
	合计	1,731,126,735.01	91.52

5.2.2 积极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	331,340.00	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	441,231.00	0.02
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	772,571.00	0.04

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	002308	威创股份	1,211,060	28,036,039.00	1.48
2	002475	立讯精密	726,704	24,569,862.24	1.30
3	300079	数码视讯	870,897	24,202,227.63	1.28
4	000839	中信国安	1,002,946	23,639,437.22	1.25
5	300291	华录百纳	616,698	23,286,516.48	1.23
6	000725	京东方A	4,438,823	23,037,491.37	1.22
7	002415	海康威视	509,059	22,805,843.20	1.21
8	600122	宏图高科	1,312,082	21,544,386.44	1.14
9	002429	兆驰股份	1,640,735	21,165,481.50	1.12
10	600845	宝信软件	296,981	21,148,017.01	1.12

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	600797	浙大网新	14,400	272,016.00	0.01
2	300101	振芯科技	3,500	194,600.00	0.01
3	002635	安洁科技	7,800	189,930.00	0.01
4	002467	二六三	8,700	169,215.00	0.01
5	002376	新北洋	7,900	141,410.00	0.01

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。

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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

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。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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	896,016.75
2	应收证券清算款	73,038,959.24
3	应收股利	-
4	应收利息	35,819.22
5	应收申购款	61,308,514.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,279,309.74

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