# 信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书摘要

（2015年第2次更新）

**基金管理人：信诚基金管理有限公司**
**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**
**重要提示**

本基金于2013年12月20日基金合同正式生效。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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基金合同的承认和接受，并按照《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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2015年6月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31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

注册地址：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

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

设立日期：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

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

电话：（021）68649788

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 | 9800 | 49 |
| 英国保诚集团股份有限公司 | 9800 | 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. 基金管理人董事会成员

张翔燕女士，董事长，硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司风险管理部总经理、中信控股有限责任公司副总裁。现任中国中信集团有限公司业务协同部主任、中信信托有限责任公司董事、中信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裁办主任、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。

包学勤先生，董事，研究生。历任招商银行证券业务部出市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券有限公司投资银行二部总经理、中信证券股份有限公司深圳投资银行部总经理、中信信托有限责任公司投资银行二部总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Guy Robert STRAPP先生，董事，商科学士。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投资总裁、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业务副理、新加坡大华银行业务开发副理、大华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)有限公司亚太地区风险及合规总监。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贸经济研究所副所长、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。

夏执东先生，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。

杨思群先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员，现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务”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. 基金管理人监事会成员

於乐女士，监事，经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、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。

解晓然女士，监事，双学位，历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

3. 高级管理人员情况

吕涛先生，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、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思毅先生，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员，中乔智威汤逊广告有限公司财务主管，德国德累斯登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、中信信诚资产管理有限公司董事。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官，代为履行督察长职务。

隋晓炜先生，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

唐世春先生，副总经理、首席市场官，代为履行督察长职务。

5. 基金经理

杨旭先生，硕士，5年证券、基金从业经验。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型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金（LOF）的基金经理。

6. 投资决策委员会成员

胡喆女士，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

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。于2014年末，中国建设银行市值约为2,079亿美元，居全球上市银行第四位。

于2014年末，本集团资产总额167,441.30亿元，较上年增长8.99%；客户贷款和垫款总额94,745.23亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.75亿元，增长5.53%。营业收入5,704.70亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户，个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到1.37万个，综合柜员占比达到80%，综合营销团队1.75万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万个、结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张，消费交易额16,580.81亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长14.18%，金融资产增长18.21%。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末，中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

**三、相关服务机构**

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

信诚基金管理有限公司

注册地址：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

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

客服电话：400-6660066

联系人：钱慧

电话：021- 68649788

网址：www.xcfunds.com

2、销售机构

（1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

（2）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：北京市西城区复兴门内大街1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（3）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

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4）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：顾凌

电话：0755-23835888、010-60838888

传真：0755-23835861、010-60836029

网址：http://www.cs.ecitic.com

（5）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号青岛国际金融广场1号楼20层（266061）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

（6）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

法定代表人：沈强

开放式基金咨询电话：0571-95548

开放式基金业务传真：0571-85106383

联系人：周妍

网址：www.bigsun.com.cn

（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处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

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

联系人：刘权

联系电话：0755-82026521

客服电话：400-600-8008、95532

公司网站：www.china-invs.cn

（8）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：王常青

联系电话：010-85130554

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

（9）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

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：（0755）82960223

传真：（0755）82943636

网址：www.newone.com.cn

客服电话：95565、4008888111

（10）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666客户服务热线：4008888666

（11）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（12）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

法定代表人：何如

基金业务联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

传真：0755－82133952

全国统一客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（13）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：李笑鸣

网址：www.htsec.com

（14）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

办公地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

(15)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-20835787

传真：021-20835879

（16）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙烨

电 话：021-20691832

传 真：021-20691861

基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

（二）注册登记机构

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：010-59378835

传真：010-59378839

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

注册地址：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：韩炯

经办律师：吕红、孙睿

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

（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800金融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。

**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800金融指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、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或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）。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85%－100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证800金融指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

**八、基金的投资策略**

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%。

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本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变通和调整，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能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1)基本面替代：按照与被替代股票基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2)相关性检验：计算备选库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模拟组合，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权重，并构建替代股组合。

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。

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。

**九、基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为：95%×中证800金融价格指数收益率+5%×金融同业存款利率。

**十、基金的风险收益特征**

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，信诚金融A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚金融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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2015年4月20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3月31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 | 10,573,498,879.03 | 91.76 |
| | 其中：股票 | 10,573,498,879.03 | 91.76 |
| 2 | 固定收益投资 | 506,065,583.60 | 4.39 |
| | 其中：债券 | 506,065,583.60 | 4.39 |
| | 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 | 115,705,116.76 | 1.00 |
| 7 | 其他资产 | 327,262,365.29 | 2.84 |
| 8 | 合计 | 11,522,531,944.68 | 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 | 10,573,498,879.03 | 92.12 |
| 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 | 10,573,498,879.03 | 92.12 |

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。

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

| 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 | 15,240,475 | 1,192,414,764.00 | 10.39 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 82,255,747 | 797,880,745.90 | 6.95 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 50,046,904 | 779,230,295.28 | 6.79 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 23,289,611 | 764,365,033.02 | 6.66 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 34,667,026 | 636,486,597.36 | 5.55 |
| 6 | 600837 | 海通证券 | 23,944,292 | 560,535,875.72 | 4.88 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 33,962,633 | 536,269,975.07 | 4.67 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 9,300,982 | 315,303,289.80 | 2.75 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 70,582,116 | 309,149,668.08 | 2.69 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 47,798,229 | 305,430,683.31 | 2.66 |

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。

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 | 7,919,583.60 | 0.07 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 498,146,000.00 | 4.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 498,146,000.00 | 4.34 |
| 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 | 506,065,583.60 | 4.41 |

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 | 140213 | 14国开13 | 1,300,000 | 130,000,000.00 | 1.13 |
| 2 | 140223 | 14国开23 | 900,000 | 90,090,000.00 | 0.78 |
| 3 | 140212 | 14国开12 | 700,000 | 70,014,000.00 | 0.61 |
| 4 | 140218 | 14国开18 | 600,000 | 60,024,000.00 | 0.52 |
| 5 | 140443 | 14农发43 | 500,000 | 50,030,000.00 | 0.44 |

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。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF1504 | IF1504 | 5 | 6,080,100.00 | 914,100.00 | 在本报告期内，基金利用股指期货作为工具进行套保，以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差，及应付大额申购赎回 |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | 914,100.00 | | |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | 859,320.00 | | |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | 914,100.00 | | |

注：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。

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。

本基金本报告期内，股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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.

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。

11.投资组合报告附注

1）中信证券于2015年1月16日因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施（《中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况》）。

对中信证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对中信证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外，信诚800金融是指数型基金，对于中信证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

海通证券于2015年1月16日因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施(《中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况》)。又于2014年5月21日收到“中国证监会行政监管措施决定书”。披露证监会在检查券商承销情况中发现，海通证券在承销中存在两起违规行为。海通证券在承销杭州炬华科技股份有限公司首次公开发行并在创业板上市过程中，向上海电气财务公司配售股票，上海电器财务与海通证券董事能施加重大影响的上海电气实业公司受同一实际控制人控制。海通证券在承销慈铭健康体检管理集团股份有限公司首次公开发行并上市项目中，存在向投资者提供超出招股意向书等公开信息以外的发行人其它信息行为。以上行为分别收到中国证监会警告和诫勉谈话的处罚。

对海通证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，上述处罚事项未对海通证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外，信诚800金融是指数型基金，对于海通证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余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。

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。

3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,849,608.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,345,261.47 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,516,727.04 |
| 5 | 应收申购款 | 305,550,767.84 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 327,262,365.29 |

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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

i. 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

ii. 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。

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。

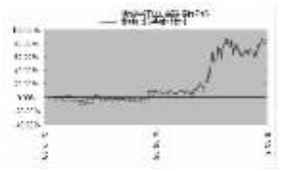
**十二、基金的业绩**

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招募说明书。基金业绩数据截至2015年3月31日。

（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2013年12月20日-2013年12月31日 | 0.20% | 0.05% | 0.00% | 1.61% | 0.20% | -1.56% |
| 2014年1月1日-2014年12月31日 | 85.89% | 1.59% | 81.86% | 1.65% | 4.03% | -0.06% |
| 2015年1月1日-2015年3月31日 | 0.26% | 2.29% | 1.27% | 2.32% | -1.01% | -0.03% |
| 2013年12月20日-2015年3月31日 | 86.75% | 1.72% | 84.17% | 1.78% | 2.58% | -0.06% |

（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓日自2013年12月20日至2014年6月20日，建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

**十三、费用概览**

(一)与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类

1）基金管理人的管理费；

2）基金托管人的托管费；

3）基金财产拨划支付的银行费用；

4）基金合同生效后的基金信息披露费用；

5）基金份额持有人大会费用；

6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7）基金的证券、期货交易费用；

8）基金上市初费和上市月费；

9）基金的账户开户费用、账户维护费用；

10）基金合同生效后的标的指数许可使用费；

11）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下的指数许可使用费将相应变更，基金管