

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。
基金托管人中银银行股份有限公司承诺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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2015年7月1日起至9月30日止。
§ 2 基金产品概况

基金简称	信诚中证800金融指数分级证券投资基金
场内简称	信诚金融
基金代码	166623
基金运作方式	契约型开放式
基金份额总额	3,066,717,384份

投资目标
本基金主要利用数量化手段投资和把握证券市场的变化，实现对中证800金融指数的有效的跟踪，为投资者提供一个稳健的资产组合。

本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，即按标的指数规定的成分股的种类及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股的调整而进行相应调整。同时，本基金将根据指数成份股的流动性情况，适当调整部分股票的配置比例，以降低跟踪误差。

投资策略
本基金通过深入研究宏观经济、政策、行业、公司等多方面的因素，结合对证券市场的分析，精选出具有较好投资价值的股票，构建股票投资组合。本基金将定期评估股票投资组合与标的指数的偏离度，根据偏离度的变化，适时调整股票投资组合的构成，以达到跟踪标的指数的效果。

业绩比较基准
96%×中证800金融指数收益率+4%×现金类资产收益。
现金类资产指货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

风险收益特征
本基金为股票型基金，风险较高，预期收益较高，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。

基金管理人
信诚基金管理有限公司

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C

下属分级基金的场内简称 信诚A 信诚B 信诚C

下属分级基金的交易代码 160157 160158 160261

报告期末下属分级基金的总资产 1,434,653,830,000 1,434,653,894,000 197,409,417,976

下属分级基金的基本风险收益特征 货币市场基金有较低的风险，但预期收益也较低；股票型基金具有较高的风险，但预期收益也较高；混合型基金、债券型基金的预期风险和预期收益介于货币市场基金和股票型基金之间。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元/份	报告期:2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	-100,203,103.01
2.本期利润	-1,885,363,042.98
3.期末可供分配利润 -3,022.11	-3,022.11
4.期末可供分配基金份额总额 2,647,304,315.24	2,647,304,315.24
5.期末基金资产净值 0.0172	0.0172

注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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:本基金建立日自2013年12月20日至2014年6月20日，建仓日期时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

5.4 管理人报告

基金管理人(或基金经理小组)简介

基金经理 杨旭

本基金的主要职责是负责本基金的投资管理，根据本基金的基金合同和有关法律法规的规定，制定并实施本基金的资产配置方案，执行风险管理的原则，制定风险管理制度，选择适当的时机，适时地调整投资组合，以达到本基金的既定投资目标。

杨旭先生，经济学学士，注册会计师，曾任招商银行总行金融市场部高级分析师，2012年6月进入信诚基金管理有限公司，历任高级分析师、基金经理助理，现担任本基金基金经理。截至本报告期末，信诚基金管理有限公司共管理着1只基金，即信诚中证800金融指数分级证券投资基金。

杨旭先生承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

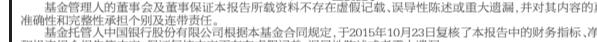
§ 4 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元/份	报告期:2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	-100,203,103.01
2.本期利润	-1,885,363,042.98
3.期末可供分配利润 -3,022.11	-3,022.11
4.期末可供分配基金份额总额 2,647,304,315.24	2,647,304,315.24
5.期末基金资产净值 0.0172	0.0172

注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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.上述基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

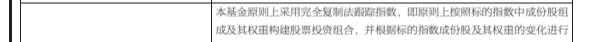
3.22 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

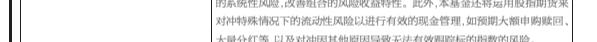
3.22 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

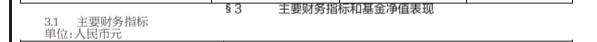
3.22 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

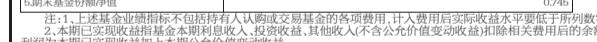
3.22 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

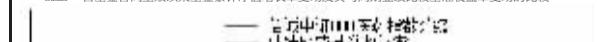
3.22 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

3.22 基金合同生效以来基金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.基金业业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以费用扣减后的各项费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额。

2.本期已实现收益收入后，其他收入不含公允价值变动收益或公允价值变动费用后的余额，本期利润为本期已实现收益收入后，其他