信诚中证800医药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。

本报告期自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800医药指数分级		
场内简称	信诚医药		
基金主代码	165519		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月16日		
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		
报告期末基金份额总额	315,813,738.40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	2013年9月6日		
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800A	医药800B	信诚医药
下属分级基金的交易代码	150148	150149	165519
报告期末下属分级基金的份额总额	90,546,850.00份	90,546,850.00份	134,720,038.40份

2.2 基金产品说明

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。从本基金所分离的两类基金份额来看，医药800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；医药800B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	医药800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	医药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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	hao.zhou@citicpru.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942

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	2013年08月16日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	365,437,592.98	-674,424.19	1,038,504.32
本期利润	417,690,644.25	-40,481,655.31	3,794,397.40
加权平均基金份额本期利润	0.6252	-0.1762	0.0155
本期基金份额净值增长率	32.42%	8.03%	1.03%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2749	0.0379	0.0055
期末基金资产净值	281,652,189.88	1,202,406,156.05	206,342,396.82
期末基金份额净值	0.892	1.051	1.000

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同自2013年8月16日起生效。

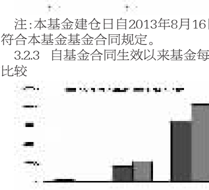
3.2 基金净值表现

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	22.50%	1.73%	20.20%	1.73%	2.30%	0.00%
过去六个月	-9.10%	3.03%	-5.86%	2.75%	-3.24%	0.28%
过去一年	32.42%	2.65%	40.93%	2.44%	-8.51%	0.21%
自基金合同生效起至今	44.52%	1.89%	54.90%	1.78%	-10.38%	0.11%

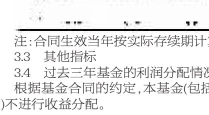
注：业绩比较基准为95%×中证800制药与生物科技指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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16日至2014年2月16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折算。

3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同的约定，本基金(包括信诚医药份额、信诚医药A份额、信诚医药B份额)不进行收益分配。

§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2005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、英国保诚集团股份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49%、49%、2%。截至2015年12月31日，本基金管理人共管理38只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、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、信诚优胜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)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级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、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐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、信诚中证智能家居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(助理)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基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年1月15日	-	3	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基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理。
吴雅楠	本基金基金经理，兼任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金的基金经理，信诚基金管理有限公司投资管理部数量投资总监	2013年8月16日	2015年3月27日	18	统计物理学博士，CFA，18年证券、基金从业经验，拥有丰富的量化投资和基金管理经验。曾任职于加拿大Greydanus, Boeckh & Associates公司和加拿大道明资产管理公司(TD Asset Management)。

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》及其他有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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，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》，公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》("公平交易制度")作为开展公平交易管理的规则指引，制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合)，对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中，公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括：已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构，健全投资授权制度，设立防火墙，确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立；同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等，确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程；借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库，规范二级市场、集中竞价市场的操作，建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括：公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；同时原则上禁止同日反向交易，如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括：定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差，对反向交易等进行价差分析。同时，合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅，签字确认，如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2015年，A股演绎了快速上涨与调整的大幅波动行情。1月至6月初，在经济增长中枢下移，经济结构改善与充裕的市场流动性的大背景下，经济围绕着两条主线，一方面是是改善国有资产负债表，整合行业以增强竞争力，输出过剩产能，即国企改革与以一代一路为战略的产能输出，给经济转型提供时间。另一方面是代表未来中国经济增长方向的"新经济"行业，包括"互联网+"，中国制造2025，新能源汽车等产业主题。上半年的投资机会也在这两条大的主线里面。而从二季度开始股票市场投机氛围过大，过渡使用杠杆，6月开始监管层打压配资政策，各类配资盘触发平仓线而使市场出现连锁反应，市场大幅回调，叠加美国进入加息周期的预期，美元对新兴市场货币升值导致热钱流出新兴市场，市场由牛市迅速转化为下行趋势。之后在缺少资产与货币宽松的环境下，市场形成了低利率，低增长，低回报的弱平衡状态。

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，在大幅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。在市场震荡期间，我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。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，期末现货与股指期货合约总市值占基金净值比例符合法规与风控要求。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为32.42%，同期比较基准收益率为40.93%，基金落后业绩比较基准8.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016，经济结构调整和转型的任务需要较长的时间来完成，在此过程中，经济增速维持在一个较低的增速水平将是常态。而在地方政府杠杆高企约束财政政策实施的情况下，中央政府稳增长的政策只能依赖宽松的货币政策，但在去过剩产能背景下，实体经济较低的投资回报并不能吸引资金流向实体经济，新兴产业往往由于其轻资产的特点，对资金的需求较低，但较强的资本管制将央行释放的大量流动性锁在国内。主要关注的板块一类是供给侧改革相关标的与处置不良资产行业，由于改革的措施，都是在调整结构的路上，如果减产破产执行，对于传动企业的龙头是个行业集中度提升的好事情，所以供应侧改革对行业带来的实质性正面影响。另外一类由于无高收益资产条件下，导致股市的投机资金不死，出现的博弈型机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015年度内，依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用，开展了一系列监察稽核工作，取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下：

1、对公司规章制度体系不断补充和完善

公司监察稽核部组织各业务部门对公司相关规章制度进行梳理补充和完善，主要包括投资、研究、风控、行政、人力资源、财务、反洗钱等业务范畴。推进了公司规章制度建设，完善了公司规章制度体系。

2、开展各类合规监察工作。

监察稽核部严格遵照法律法规和公司制度，对基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况进行监督检查，防范内幕交易，确保基金运作的独立性、公平性及合规性。2015年3月底至4月初，中国证监会对我公司进行了现场监督检查，监察稽核部对本次现场检查积极配合。通过本次现场检查，能更客观地发现公司各项内控中的薄弱环节，有助于督促公司不断加强制度和风控措施，提高经营效率。

3、强化合规培训教育，提高全员合规意识。

本报告期内，监察稽核部及时将新颁布的监管法规传递给公司相关业务部门，并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督，并开展法规培训。本年度，监察稽核部根据监管部门的要求，结合自身实际情况，主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4、开展各类内外部审计工作，包括4次常规审计、13项专项审计、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成现场检查及多项自查工作等。

5、完成各只基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法规要求进行信息披露和公告，并按法律法规规定报监管机构备案。

6、牵头开展反洗钱的各项工作，进一步完善修订了反洗钱制度，按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心，根据中国人民银行通知要求组织开展反洗钱培训和宣传工作。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值决策委员会。

在每个估值日，本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按照托管协议中"基金资产净值计算和会计核算"确定的规则复核，复核无误后，由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗，所有业务操作需经复核方可生效。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有会计上岗证和基金从业人员资格。

4.基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离，基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注，在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时，将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议，通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金(包括信诚医药份额、信诚医药A份额、信诚医药B份额)不进行收益分配。本基金于本期间未进行过利润分配，该处理符合基金利润分配原则。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现过连续二十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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在信诚中证800医药指数分级证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1600068号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	信诚中证800医药指数分级证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的第1页至第27页的信诚中证800医药指数分级证券投资基金(以下简称"信诚800医药基金")财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是信诚800医药基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价信诚基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，信诚800医药基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了信诚800医药基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	王国蓓	查希箐
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层	
审计报告日期	2016年3月24日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信诚中证800医药指数分级证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款		17,994,981.58	2,746,443.07
结算备付金		479,003.32	452,809.66
存出保证金		656,127.20	67,687.14
交易性金融资产		263,523,744.03	1,201,524,448.49
其中：股票投资		263,523,744.03	1,137,176,222.49
基金投资		-	-
债券投资		-	64,348,226.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	3,812,122.03
应收利息		4,171.24	1,498,651.86
应收股利		-	-
应收申购款		32,079.32	154,434.63
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		282,690,106.69	1,210,256,596.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,030,774.12
应付赎回款		194,601.32	189,925.20
应付管理人报酬		234,804.67	973,518.47
应付托管费		51,657.00	214,174.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		96,120.43	1,981,537.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		460,733.39	460,511.50
负债合计		1,037,916.81	7,850,440.83
所有者权益：			
实收基金		194,850,067.22	1,101,735,915.57
未分配利润		86,802,122.66	100,670,240.48
所有者权益合计		281,652,189.88	1,202,406,156.05
负债和所有者权益总计		282,690,106.69	1,210,256,596.88

注：截止本报告期末，基金份额总额315,813,738.40份。信诚800医药指数分级的基金份额净值0.892，基金份额总额134,720,038.40份。下属分级基金：信诚中证800医药指数分级A的基金份额净值1.002元，基金份额总额90,546,850.00份；信诚中证800医药指数分级B的基金份额净值0.782元，基金份额总额90,546,850.00份。

7.2 利润表

会计主体：信诚中证800医药指数分级证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		432,976,806.56	-33,898,813.91
1.利息收入		1,097,671.00	501,329.26
其中：存款利息收入		226,474.92	47,153.45
债券利息收入		871,196.08	454,175.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		376,442,511.68	4,614,200.68
其中：股票投资收益		372,683,703.83	3,665,630.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-21,799.63	25,117.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-183,120.00
股利收益		3,780,607.48	1,106,572.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		52,253,051.27	-39,807,231.12
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,183,572.61	792,887.27
减：二、费用		15,286,162.31	6,582,841.40
1. 管理人报酬		7,109,794.81	2,308,296.37
2. 托管费		1,564,154.83	507,825.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		5,923,406.45	3,130,199.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		688,806.22	636,520.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		417,690,644.25	-40,481,655.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		417,690,644.25	-40,481,655.31

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：信诚中证800医药指数分级证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,101,735,915.57	100,670,240.48	1,202,406,156.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	417,690,644.25	417,690,644.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-906,885,848.35	-431,558,762.07	-1,338,444,610.42
其中：1.基金申购款	827,836,074.34	386,213,841.88	1,214,049,916.22
2.基金赎回款	-1,734,721,922.69	-817,772,603.95	-2,552,494,526.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	194,850,067.22	86,802,122.66	281,652,189.88

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	204,191,287.78	2,151,109.04	206,342,396.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-40,481,655.31	-40,481,655.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	897,544,627.79	139,000,786.75	1,036,545,414.54
其中：1.基金申购款	1,497,489,891.00	192,743,134.76	1,690,233,025.76
2.基金赎回款	-599,945,263.21	-53,742,348.01	-653,687,611.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,101,735,915.57	100,670,240.48	1,202,406,156.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4财务报表由下列负责人签署：

吕涛 陈逸辛 时慧

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中证800医药指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准信诚中证800医药指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]832 号文)和《关于信诚中证800医药指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2013]718 号文)批准，由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚中证800医药指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2013年8月16日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于2013年7月22日至2013年8月9日募集，首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币337,141,458.95元，利息人民币56,568.47元，共计人民币337,198,027.42元。上述认购资金折合337,198,027.42份基金份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了毕马威华振验字第1300161号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中证800医药指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证800医药指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、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%，投资于标的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。

本基金的业绩比较标准为：中证800制药与生物科技指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1.2 权证交易

7.4.8.1.3 债券交易

7.4.8.1.4 债券回购交易

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,109,794.81	2,308,296.37
其中：支付销售机构的客户维护费	391,535.78	380,809.16

注：支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,564,154.83	507,825.27

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金的基金管理人在本年度及上年度可比期间均未投资过本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

信诚中证800医药指数分级B 份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信信托有限责任公司	-	-	1,203,200.00	0.22%

注：1、除上表所示，本基金其它关联方在本年末及上年末均未持有本基金。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

1.1.1.1 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	17,994,981.58	158,139.72	2,746,443.07	42,850.41

注：本基金通过"中国银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于本报告期末的相关余额为人民币50,185.11元。(上年度末余额：人民币452,809.66元)

1.1.1.2 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

1.1.1.3 其他关联交易事项的说明

1.1.2 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

1.1.2.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

1.1.2.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600645	中源协和	2015-12-30	收到上交所问询函	65.01	2016-01-04	63.90	84,955	4,055,260.88	5,522,924.55	-
600572	康恩贝	2015-12-28	筹划收购干细胞标的	13.36	2016-01-04	13.18	210,333	2,766,787.00	2,810,048.88	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	筹划重大事项	18.18	-	-	445,917	5,304,184.94	8,106,771.06	-

注：根据公告，"康恩贝"停牌时间为2015年12月28日下午开市时起。截至本报告批准报出日，"恒康医疗"仍未发布复牌公告。

1.1.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

1.1.2.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有因正回购交易而作为抵押的债券。

1.1.2.3.2 交易所市场债券正回购

1.1.3 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§2 投资组合报告

2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	263,523,744.03	93.22
	其中：股票	263,523,744.03	93.22
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	18,473,984.90	6.54
7	其他各项资产	692,377.76	0.24
8	合计	282,690,106.69	100.00

2.2 期末按行业分类的股票投资组合

2.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	255,913,213.38	90.86
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	2,087,606.10	0.74
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	5,522,924.55	1.96
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	263,523,744.03	93.56

2.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

本基金本报告期末，未持有积极投资的股票投资。

2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

2.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
	600276	恒瑞医药	368,855	18,118,157.60	6.43
2	000538	云南白药	163,652	11,884,408.24	4.22
3	600085	同仁堂	215,468	9,612,027.48	3.41
4	000423	东阿阿胶	164,384	8,597,283.20	3.05
5	600196	复星医药	360,248	8,462,225.52	3.00
6	600535	天士力	203,678	8,334,503.76	2.96
7	002219	恒康医疗	445,917	8,106,771.06	2.88
8	000623	吉林敖东	224,864	6,959,540.80	2.47
9	002252	上海莱士	173,270	6,890,947.90	2.45
10	600867	通化东宝	249,813	6,787,419.21	2.41

2.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末，未持有积极投资的股票投资。

2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	54,347,178.85	4.52
2	600332	白云山	54,126,046.06	4.50
3	600276	恒瑞医药	54,111,979.09	4.50
4	600535	天士力	43,947,906.92	3.65
5	600196	复星医药	43,461,252.58	3.61
6	000423	东阿阿胶	37,901,465.16	3.15
7	000623	吉林敖东	36,473,835.19	3.03
8	600594	益佰制药	30,404,979.54	2.53
9	600252	中恒集团	28,768,189.08	2.39
10	600085	同仁堂	28,749,161.05	2.39
11	002252	上海莱士	26,951,970.80	2.24
12	002437	誉衡药业	25,777,993.35	2.14
13	600201	生物股份	24,638,831.19	2.05
14	600079	人福医药	23,998,398.52	2.00
15	300267	尔康制药	23,149,341.88	1.93
16	600867	通化东宝	21,591,073.47	1.80
17	002422	科伦药业	20,340,663.83	1.69
18	002038	双鹭药业	18,919,168.26	1.57
19	002030	达安基因	18,705,403.30	1.56
20	000661	长春高新	18,304,421.82	1.52

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	121,712,170.61	10.12
2	000538	云南白药	120,970,918.00	10.06
3	600196	复星医药	100,573,395.50	8.36
4	600535	天士力	96,506,024.55	8.03
5	000423	东阿阿胶	82,829,043.67	6.89
6	000623	吉林敖东	82,674,713.19	6.88
7	600252	中恒集团	66,151,700.40	5.50
8	600085	同仁堂	64,221,480.33	5.34
9	600079	人福医药	60,398,851.22	5.02
10	600201	生物股份	58,496,320.02	4.86
11	600332	白云山	56,436,684.26	4.69
12	600867	通化东宝	55,359,296.73	4.60
13	002252	上海莱士	54,198,346.27	4.51
14	002030	达安基因	53,314,677.52	4.43
15	002038	双鹭药业	47,179,899.04	3.92
16	002422	科伦药业	46,230,082.97	3.84
17	002424	贵州百灵	43,680,565.67	3.63
18	002022	科华生物	42,597,130.80	3.54
19	002007	华兰生物	42,235,114.78	3.51
20	000661	长春高新	41,983,700.27	3.49
21	000566	海南海药	40,089,251.15	3.33
22	600645	中源协和	38,776,897.66	3.22
23	000999	华润三九	36,616,482.00	3.05
24	600436	片仔癀	36,174,684.17	3.01
25	002603	以岭药业	32,643,047.87	2.71
26	600267	海正药业	32,330,310.23	2.69
27	300147	香雪制药	32,299,401.77	2.69
28	600161	天坛生物	32,018,097.93	2.66
29	600557	康缘药业	31,931,655.20	2.66
30	002001	新和成	31,603,761.29	2.63
31	600572	康恩贝	31,554,938.78	2.62
32	600422	昆药集团	30,393,297.32	2.53
33	600062	华润双鹤	30,179,082.16	2.51
34	600664	哈药股份	30,010,944.71	2.50
35	002294	信立泰	29,532,471.05	2.46
36	600521	华海药业	28,512,835.63	2.37
37	600216	浙江医药	28,363,898.26	2.36
38	600380	健康元	27,408,775.48	2.28
39	002437	誉衡药业	26,731,602.98	2.22
40	002219	恒康医疗	26,564,609.00	2.21
41	002399	海普瑞	25,934,792.14	2.16

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,101,545,317.94
卖出股票收入(成交)总额	2,400,133,307.87

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

2.5 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。

2.6 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。

2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

2.8 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。

2.9 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。

2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2.10.1 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。

2.10.2 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。

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.11.1 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。

2.11.2 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。

2.11.3 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。

2.12 投资组合报告附注

2.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

2.12.2 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。

2.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	656,127.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,171.24
5	应收申购款	32,079.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	692,377.76

2.12.4 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。

2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	002219	恒康医疗	8,106,771.06	2.88	筹划重大事项

2.12.5.2 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，持有的积极投资股票不存在流通受限情况。

2.12.6 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。

§3 基金份额持有人信息

3.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信诚中证800医药指数分级A	374	242,103.88	88,234,117.00	97.45%	2,312,733.00	2.55%
信诚中证800医药指数分级B	4,130	21,924.18	2,235,555.00	2.47%	88,311,295.00	97.53%
信诚中证800医药指数分级	4,748	28,374.06	94,462,008.92	70.12%	40,258,029.48	29.88%
合计	9,252	34,134.65	184,931,680.92	58.56%	130,882,057.48	41.44%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

3.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证800医药指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	46,647,829.00	51.52%
2	中国人民财产保险股份有限公司－自有资金	20,734,195.00	22.90%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	12,668,371.00	13.99%
4	上海明汯投资管理有限公司－明汯多策略对冲1号基金	2,881,219.00	3.18%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	2,506,861.00	2.77%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－团体分红	1,500,000.00	1.66%
7	中国对外经济贸易信托有限公司－申毅量化套利集合资金信托计划	717,882.00	0.79%
8	海通期货有限公司－海通玄武杉树2期特定多个客户资产管理计	237,602.00	0.26%
9	曹红霞	190,100.00	0.21%
10	中国太平洋财产保险－传统－普通保险产品－013C－CT001深	133,552.00	0.15%

信诚中证800医药指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	沈红亮	5,116,684.00	5.65%
2	丁群	2,415,100.00	2.67%
3	李绪军	1,242,000.00	1.37%
4	袁美田	1,189,400.00	1.31%
5	吴杰	1,156,812.00	1.28%
6	张宝生	1,087,245.00	1.20%
7	新华人寿保险股份有限公司	1,055,160.00	1.17%
8	李敏	965,600.00	1.07%
9	林德达	938,900.00	1.04%
10	李天赐	686,500.00	0.76%

注：持有人为场内持有人；对于同一机构不同股东账号下的份额未做合并。1.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	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	109,558.12	0.08%
	合计	109,558.12	0.03%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

1.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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	-
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

1.3 发起式基金发起资金持有份额情况

§2 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
基金合同生效日(2013年8月16日)基金份额总额	42,248,738.00	42,248,738.00	252,700,551.42
本报告期期初基金份额总额	539,054,029.00	539,054,029.00	66,250,223.38
本报告期基金总申购份额	-	-	1,099,379,786.09
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	2,332,829,527.70
本报告期基金拆分变动份额	-448,507,179.00	-448,507,179.00	1,301,919,556.63
本报告期期末基金份额总额	90,546,850.00	90,546,850.00	134,720,038.40

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以及因份额折算产生的份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以2015年4月14日为份额折算基准日，对本基金实施不定期份额折算。

3、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以2015年12月15日为份额折算基准日，对本基金实施定期份额折算。

4.本报告期因折算导致的份额拆分变动情况，详见本管理人届时发布的折算结果公告

§3 重大事件揭示

3.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

3.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第48次会议审议通过，聘任吕涛先生担任信诚基金总经理职务。本基金管理人已于2015年4月3日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于总经理任职的公告》。自新任总经理任职之日起，本公司董事长张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部和上海证监局报告。

经信诚基金管理有限公司董事会审议通过，解聘林军女士信诚基金副总经理职务，同时聘任唐世春先生担任公司副总经理，不再担任督察长职务。在新任督察长任职之前，代为履行督察长职务。本基金管理人已于2015年6月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部、中国证券投资基金业协会和上海证监局报备。

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第五十三次会议审议通过，聘任周浩先生担任公司督察长职务。自新任督察长任职之日起，本公司副总经理唐世春先生不再代为履行督察长职务。本基金管理人已于2015年9月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券监督委员会证券基金机构监管部、上海证监局和中国证券投资基金业协会报备。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

3.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

3.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

3.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所的报酬为人民币60,000元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

3.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人于2015年7月29日收到上海证监局《关于对信诚基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》(以下简称"整改决定书")。公司领导高度重视，针对整改决定书指出的问题，公司认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力，并已按要求向上海证监局提交了整改报告。除上述情况外，报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

3.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

3.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

3.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,144,904,691.51	32.70%	1,045,594.69	33.16%	本期新增
东方证券	1	575,273,429.61	16.43%	523,728.75	16.61%	-
安信证券	1	573,649,074.85	16.39%	507,623.19	16.10%	本期新增
浙商证券	1	409,903,300.28	11.71%	362,724.09	11.50%	-
海通证券	2	301,471,879.24	8.61%	266,773.38	8.46%	本期新增
招商证券	2	279,859,447.65	7.99%	256,211.83	8.12%	本期新增
大通证券	1	215,688,519.51	6.16%	190,864.28	6.05%	-
国信证券	1	-	-	-	-	本期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本期新增
中信建投	2	-	-	-	-	本期新增
中信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	本期新增

§4 影响投资者决策的其他重要信息

无

信诚基金管理有限公司
2016年3月25日