信诚中证智能家居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6月26日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信诚中证智能家居指数分级		
场内简称	智能家居		
基金主代码	165524		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月26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	142,121,754.78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	2015年7月15日		
下属分级基金的基金简称	信诚中证智能家居指数分级A	信诚中证智能家居指数分级B	信诚中证智能家居指数分级
下属分级基金的场内简称	智能A	智能B	智能家居
下属分级基金的交易代码	150311	150312	165524
报告期末下属分级基金的份额总额	10,758,754.00份	10,758,754.00份	120,604,246.78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,实现对中证智能家居指数的有效跟踪,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追踪标的指数,因原则上按照标的指数中成份股权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%×中证智能家居指数收益率+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。		
下属分级基金的风险收益特征	智能A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	智能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。

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06月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	-118,753,551.12
本期利润	-118,777,178.55
加权平均基金份额本期利润	-0.4833
本期基金份额净值增长率	-22.19%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4776
期末基金资产净值	176,763,279.50
期末基金份额净值	1.244

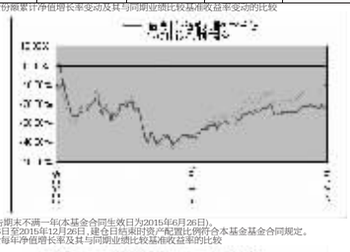
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入不含公允价值变动收益准除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
4.本基金合同生效日为2015年6月26日。

3.2基金净值表现

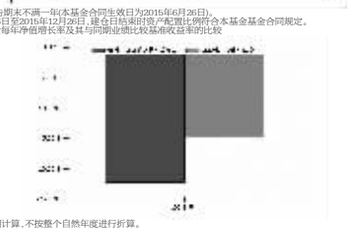
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	23.77%	1.57%	38.33%	2.26%	-14.56%	-0.69%
过去六个月	-22.50%	2.64%	-6.09%	3.29%	-16.41%	-0.65%
自基金合同生效起至今	-22.19%	2.61%	-14.78%	3.41%	-7.41%	-0.80%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2015年6月26日)。
2.本基金建仓期自2015年6月26日至2016年12月26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
本基金合同生效日为2015年6月26日,根据基金合同约定,本基金包括信诚智能家居份额、信诚智能家居A份额、信诚智能家居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2006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%、29%、22%。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、信诚一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、信诚保底收益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)、信诚深证成指分级证券投资基金、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、信诚季季宝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、信诚新金宝货币市场基金、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、信诚新回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚中证800金融信息服务指数分级证券投资基金、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚新能源行业股票型证券投资基金、信诚新兴产业股票型证券投资基金、信诚新动力股票型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(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)、信诚深证成指分级证券投资基金、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、信诚季季宝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、信诚新金宝货币市场基金、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、信诚新回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新趋势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、信诚新能源行业股票型证券投资基金、信诚新兴产业股票型证券投资基金、信诚新动力股票型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年6月26日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士,组约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methods公司量化研究分析师,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。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800有色指数分级基金、信诚新能源行业股票型证券投资基金、信诚新兴产业股票型证券投资基金、信诚新动力股票型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理

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《证券从业人员执业行为准则(试行)》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《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金招募说明书》的要求,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内控制度,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 公平交易制度和执行方法
为使公平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)、对应的投资决策以及场内上市股票、债券的一般性业务。
在实际的公平交易管理流程中,公司在公平交易制度的指引下采用手工、事中、事后的全流程控制方法,事前管理主要包括:已搭建了合理的投资管理业务之间及投资管理业务内的组织架构,健全投资权限制度,设立防火墙,确保各块投资业务基金组合投资决策机制的独立性;同时让各业务部门共享公募证券池,公募证券池是公募基金、专户投资、特定客户资产管理、社保基金、企业年金、社会公益基金、一在投资操作上设置一致的投资决策程序和流程,保证投资决策程序的一致性。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,确保一股票或下不同投资组合同向买卖同一证券的交易公平性进行动态处理,按照时间先后、比例分配的原则在各投资组合间公平分配;禁止同日反向交易和同日内频繁交易以免影响公平性;禁止同日对同一证券进行不同价格的交易,非集中竞价市场等特殊投资需要经过合理测算,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、对反向交易等进行统计分析。同时,公司内部稽核部门对公平交易制度执行情况做定期检查,相关人员对事后评估报告、合规评估报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做出整改。

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》,以及公司制定的《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:投研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,建立公平交易实时监控系统,交易环节加强交易执行的规范控制,利用性价比交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一投资标的同一证券交易时的公平性;公司同时不断完善和优化公平交易分析系统,在事后加入了严格的行为监控、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。

4.4管理人对报告期内异常交易的说明
本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现单笔交易所公开竞价同日反向交易成交较少的情况,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。

4.4.1 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、经济结构改善与宽松的市场流动性的大背景下,经济周期逐渐见底,市场大幅上涨,一方面是政策层面的改革红利,以国企改革为主线的一轮一轮各方板块的产能输出,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主线里面。而从二季度开始股票市场投机氛围过大,过度使用杠杆,6月开始监管层打压配资业务,各类配资盘触发平仓线而使市场出现连续反应,市场大幅回调,叠加美国进入加息周期的预期,来自中国经济下行压力导致热钱流出新兴市场,市场由年中迅速转化为下行趋势。上半年在股少资产与货币宽松的环境下,市场形成了低利率、低期长、低回报的群平衡状态。
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风险,保持组合风险水平的稳定。公司内部也加强了投研流程的规范控制,利用性价比交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一投资标的同一证券交易时的公平性;公司同时不断完善和优化公平交易分析系统,在事后加入了严格的行为监控、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。

4.5管理人对报告期内旗下投资组合投资风格漂移的说明
报告期内,公司管理的不同投资组合,根据各自的投资目标,以管理风险为目的,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。

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。现将公司内部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
公司监察稽核部根据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体系的建设,完善了公司规章制度体系。
2.开展各类监察监管工作
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.强化合规知识教育,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,并对其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,并开展法规知识测试。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,主要对证券投资基金、证券投资顾问业务、证券经纪业务、证券自营业务、证券承销业务、证券资产管理业务、证券投资咨询业务、证券期货经纪业务、证券期货投资咨询业务、证券期货资产管理业务、证券期货自营业务、证券期货风险管理业务、证券期货交易咨询业务、证券期货交易管理业务、证券期货结算业务、证券期货仲裁