信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日
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:2017年 10 月 26 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 2017年 10 月 25 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 2017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
场内简称	信诚金融
基金主代码	165521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年 12 月 20 日
报告期末基金份额总额	1,206,259,944.90 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 金融指数的有效跟踪,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 金融价格指数收益率+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 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
下属分级基金的场内简称	金融 A	金融 B	信诚金融
下属分级基金的交易代码	150157	150158	165521
报告期末下属分级基金的份额总额	571,291,003.00 份	571,291,004.00 份	63,677,937.90 份
下属分级基金的风险收益特征	金融 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	金融 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(2017年 7 月 1 日至 2017年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	48,120,245.01
2.本期利润	99,825,150.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0738
4.期末基金资产净值	1,249,545,357.65
5.期末基金份额净值	1.036

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。

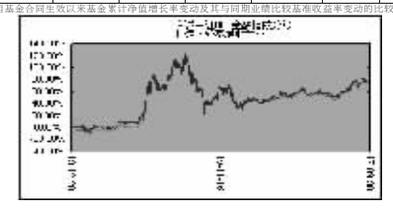
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	6.69%	0.84%	5.76%	0.85%	0.93%	-0.01%

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

3.3其他指标

§ 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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金、信诚水丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理	2015年 1 月 15 日	-	5	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司,担任数量分析师;于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司,担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012年 8 月加入信诚基金,历任助理投资经理、专户投资经理、现任量化投资二部副总监,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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚水丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛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 金融指数分级证券投资基金基金合同》,《信诚中证 800 金融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

回顾 2017年三季度,A股市场震荡上扬,周期股首先发力,同时之前蓝筹滞胀板块出现补涨,金融板块随之发力引领上证综指创去年 11月底以来的新高,随后市场涨幅趋缓维持震荡横盘,周期板块出现调整,资金逐步从周期板块流出,各板块之间轮动加快。

从外部因素来看,欧美经济数据持续改善,9 月美国 ISM制造业和非制造业 PMI分别创出 2004、2006年以来的新高,欧元区 PMI持续上行,美联储缩表计划临近,年底加息几率增大,欧退出 QE尚存分歧,推进速度慢于预期。国际货币政策总体保持不紧不松,欧美经济复苏将延续仍较为依赖全球性的需求复苏。

从国内环境来看,6、7 月各项经济数据的超预期,随后 8 月经济数据走弱,经济持续超预期的观点被证伪,规模以上工业增加值、汽车销售数据、全国固定资产投资、房地产投资、制造业投资以及终端需求在内的数据均表现低迷;且 PMI、社会融资等数据表明经济仍有较强的支撑;房地产市场经历了新一轮的调控政策,地产逐渐回归居住属性。流动性方面央行货币政策维持稳健中性。总体来说经济韧性较强,流动性不紧不松。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,在震荡市场环境下及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值

展望今年四季度,对宏观层面的判断是库存周期开始下降,伴随中周期开启,整个经济韧性较大。中国制造业领域的盈利修复,资本开支扩张与 PCE的扩张仍没见顶。

对市场判断为震荡向上,市场的结构性机会在于盈利驱动的成长板块。从资金面看,流动性不紧不松,央行此次提出定向降准是对 7 月份全国金融经济工作会议上提出的"脱虚向实"的政策延续,并助力中小企业;同时,定向降准时间定在 2018年,表明四季度货币政策基调仍为"脱虚向实"同时保持金融市场稳定。因此 A股市场不具备流动性趋势性改变机会,故而市场仍为盈利驱动。在盈利驱动的大逻辑下,目前市场正寻找性价比相对较高的板块,估值合理的成长板块吸引力较,看好有需求增量、符合中长期需求趋势的板块。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 6.69%,同期比较基准收益率为 5.76%,基金超越业绩比较基准 0.93%。

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	1,183,225,825.45	94.38
	其中:股票	1,183,225,825.45	94.38
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	70,155,981.60	5.60
7	其他资产	316,375.38	0.03
8	合计	1,253,698,182.43	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境内股票投资组合

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	1,181,910,909.61	94.59
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	1,181,910,909.61	94.59

5.2.2积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	39,793.60	-
C	制造业	935,982.75	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,380.90	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	-
S	综合	-	-
	合计	1,314,915.84	0.11

5.2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资的股票。

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	601318	中国平安	2,632,081	142,553,506.96	11.41
2	601166	兴业银行	4,437,356	76,721,885.24	6.14
3	600016	民生银行	8,818,788	70,726,679.76	5.66
4	601328	交通银行	10,559,992	66,739,149.44	5.34
5	600036	招商银行	2,507,202	64,059,011.10	5.13
6	600000	浦发银行	4,657,468	59,941,613.16	4.80
7	601288	农业银行	15,691,484	59,941,468.88	4.80
8	601398	工商银行	9,303,072	55,818,432.00	4.47
9	601169	北京银行	6,900,501	51,477,737.46	4.12
10	000001	平安银行	4,296,563	47,734,814.93	3.82

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.01
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.01
3	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.01
4	603648	畅联股份	3,196	79,324.72	0.01
5	300702	天宇股份	1,124	68,968.64	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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未进行权证投资。

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摊盘明细

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。本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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。

本基金本报告期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摊盘明细

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报告期末本基金投资的股指期货投资明细

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	242,503.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,424.76
5	应收申购款	60,447.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,375.38

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6报告期末债券投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末债券投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.7报告期末其他各项资产构成明细

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 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
报告期期初基金份额总额	779,675,690.00	779,675,691.00	172,351,206.31
报告期期间基金总申购份额	-	-	12,754,413.94
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	538,197,056.35
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-208,384,687.00	-208,384,687.00	416,769,374.00
报告期期末基金份额总额	571,291,003.00	571,291,004.00	63,677,937.90

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§ 7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	
报告期期间买入/申购总份额	-	-	
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	-	

§ 8开放式基金份额变动

单位:份

项目	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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	
报告期期间买入/申购总份额	-	-	
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	-	

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9影响投资者决策的其他重要信息

9.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

9.2影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10备查文件目录

10.1备查文件目录

1、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金基金合同
2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金托管协议
4、信诚中证 800 金融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

10.2存放地点

信诚基金管理有限公司办公地－中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

10.3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
2017年 10 月 26 日

信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 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
报告送出日期:2017年 10 月 26 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 2017年 10 月 25 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 2017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 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	292,306,447.88 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	22,215,842.00 份	22,215,842.00 份	247,874,763.88 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(2017年 7 月 1 日至 2017年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	8,217,123.44
2.本期利润	35,492,422.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.1839
4.期末基金资产净值	393,417,786.14
5.期末基金份额净值	1.346

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。

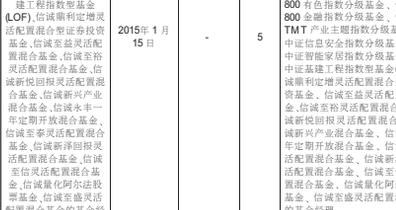
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	26.98%	1.83%	30.23%	1.92%	-3.25%	-0.09%

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:本基金建仓期自 2013年 8 月 30 日至 2014年 2 月 28 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3其他指标

§ 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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚水丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛灵活配置混合基金的基金经理	2015年 1 月 15 日	-	5	理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司,担任数量分析师;于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司,担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012年 8 月加入信诚基金,历任助理投资经理、专户投资经理、现任量化投资二部副总监,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、信诚中证基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合基金、信诚新兴产业混合基金、信诚水丰一年定期开放混合基金、信诚至泰灵活配置混合基金、信诚新泽回报灵活配置混合基金、信诚至信灵活配置混合基金、信诚量化阿尔法股票基金、信诚至盛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

回顾 2017年三季度,A股市场震荡上扬,周期股首先发力,同时之前蓝筹滞胀板块出现补涨,金融板块随之发力引领上证综指创去年 11月底以来的新高,随后市场涨幅趋缓维持震荡横盘,周期板块出现调整,资金逐步从周期板块流出,各板块之间轮动加快。

从外部因素来看,欧美经济数据持续改善,9 月美国 ISM制造业和非制造业 PMI分别创出 2004、2006年以来的新高,欧元区 PMI持续上行,美联储缩表计划临近,年底加息几率增大,欧退出 QE尚存分歧,推进速度慢于预期。国际货币政策总体保持不紧不松,欧美经济复苏将延续仍较为依赖全球性的需求复苏。

从国内环境来看,6、7 月各项经济数据的超预期,随后 8 月经济数据走弱,经济持续超预期的观点被证伪,规模以上工业增加值、汽车销售数据、全国固定资产投资、房地产投资、制造业投资以及终端需求在内的数据均表现低迷;且 PMI、社会融资等数据表明经济仍有较强的支撑;房地产市场经历了新一轮的调控政策,地产逐渐回归居住属性。流动性方面央行货币政策维持稳健中性。总体来说经济韧性较强,流动性不紧不松。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,在震荡市场环境下及时处理每日申购赎回现金流,有效管理跟踪误差。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金净值

展望今年四季度,对宏观层面的判断是库存周期开始下降,伴随中周期开启,整个经济韧性较大。中国制造业领域的盈利修复,资本开支扩张与 PCE的扩张仍没见顶。

对市场判断为震荡向上,市场的结构性机会在于盈利驱动的成长板块。从资金面看,流动性不紧不松,央行此次提出定向降准是对 7 月份全国金融经济工作会议上提出的"脱虚向实"的政策延续,并助力中小企业;同时,定向降准时间定在 2018年,表明四季度货币政策基调仍为"脱虚向实"同时保持金融市场稳定。因此 A股市场不具备流动性趋势性改变机会,故而市场仍为盈利驱动。在盈利驱动的大逻辑下,目前市场正寻找性价比相对较高的板块,估值合理的成长板块吸引力较,看好有需求增量、符合中长期需求趋势的板块。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 47%,同期比较基准收益率为 43.8%,基金超越业绩比较基准 0.33%。

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	369,773,353.82	92.43
	其中:股票	369,773,353.82	92.43
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	23,447,204.14	5.86
7	其他资产	6,840,059.09	1.71
8	合计	400,060,617.05	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境内股票投资组合

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	106,890,099.52	27.17
C	制造业	258,411,425.42	65.68
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