# 信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金 2016 年第四季度报告

2016年12月31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1月20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1月19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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### § 2 基金产品概况

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 304, 559, 182. 68 份 投资目标 4基金份额总额 304, 559, 182. 68 份		82 基金厂的例况				
基金主代码 现约型开放式 基金合同生效日 2013 年 8 月 16 日 报告期末基金份额总额 304,559,182.68 份 投资目标 2013 年 8 月 16 日 报告期末基金份额总额 304,559,182.68 份 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。 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,本者谨慎原则,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水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 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。 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: 医药 8008 份额具有预期风险、预期收益较高的特征: 医药 8008 份额具有预期风险、预期收益较高的特征: 医药 8008 份额具有预期风险、预期收益较高的特征:医药 8008 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。	基金简称	信诚中证 800 医药指数分级				
基金合同生效日  超告期末基金份额总额  304,559,182.68 份  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。  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空化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟际偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。基金管理人一定用股指期货,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,如预期大额中购赎回、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。  少绩比较基准  95%×中证 800 制药与生物科技指数收益率+5%×金融间业存款利率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、预期收益较低的特征。医药 800B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。 基金管理人  基金往往人  中国银行股份有限公司  中国银行股份有限公司  「信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医药指数分级	场内简称	信诚医药				
基金合同生效日 报告期末基金份额总额 304,559,182.68 份 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除偏离度的绝对值不超过 0.35%,率跟该是不超过 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,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、支票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%×金融同业存款利率本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高项期风险、较高预期收益的的特征。最少基金和混合型基金。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、预期收益较高的特征。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、预期收益较高的特征。	基金主代码	165519				
报告期末基金份额总额	基金运作方式	契约型开放式				
及资目标 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。  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。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%×金融同业存款利率不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、预期收益较低的特征。 基金管理人 信诚基金管理有限公司	基金合同生效日	2013年8月16日				
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。  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 8008 份额具有预期风险、预期收益较低的特征:医药 8008 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。  基金管理人  基金管理人  基金管理人  基金往管人  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 医药指	报告期末基金份额总额	304, 559, 182. 68 份				
接资策略 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 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 8004 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。  基金管理人 信诚基金管理有限公司	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,				
及资策略 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 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、预期收益较低的特征。医药 800B 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、预期收益较低的特征。		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				
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  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。  基金管理人  基金管理人  基金管理人  基金管理人  基金任管人 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 医药指		有效的投资工具。				
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。 基金管理人  基金管理人  基金管理人  基金管理人  基金管理人  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 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医	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				
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 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。 基金管理人 信诚基金管理有限公司		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				
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、预期收益较低的特征;医药 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 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医		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				
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  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。  基金管理人  基金管理人  基金任管人  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 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医		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%。				
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。 基金管理人 基金任管人 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 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医						
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  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。  基金管理人  基金管理人  基金任管人 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 医药指 信诚中证 800 医药指 发分级 8 药指数分级		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				
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。 基金管理人 基金管理人 自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 医药指 信诚中证 800 医药指 数分级 B		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,				
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  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。  基金管理人  基金管理人  信诚基金管理有限公司  本基任管人 中国银行股份有限公司  「信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医						
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  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。  基金管理人  基金管理人  基金管理人  自诚基金管理有限公司  下属分级基金的基金简称  信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医药指 信诚中证 800 医药指数分级						
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		1,7 - 1				
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。 基金管理人 信诚基金管理有限公司 中国银行股份有限公司 「中国银行股份有限公司」「中国银行股份有限公司」「管诚中证 800 医药指」(信诚中证 800 医药指】(信诚中证 800 医药指数分级 B 药指数分级 B						
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。 基金管理人 信诚基金管理有限公司 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 医药指 信诚中证 800 医药指 数分级 B 药指数分级						
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。 基金管理人 信诚基金管理有限公司 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 医药指 信诚中证 800 医药指 数分级 B 药指数分级	风险收益特征					
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。         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 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 医药指 数分级 A 数分级 B 药指数分级						
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 医药指 数分级 A 数分级 B 药指数分级		预期收益较高的特征。				
下属分级基金的基金简称       信诚中证 800 医药指       信诚中证 800 医药指       信诚中证 800 医药指       信诚中证 800 医药指       方指数分级 B						
数分级 A 数分级 B 药指数分级						
	下属分级基金的基金简称					
卜属分级基金的场内简称						
	卜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, 807, 444. 00 份	90, 807, 444. 00 份	122, 944, 294. 68 份
下属分级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
	医药 800A 份额具有预	医药 800B 份额具有预	险、较高预期收
	期风险、预期收益较	期风险、预期收益较	益的特征,其预期
	低的特征。	高的特征。	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(2016年10月1日至2016年12月31日)
1. 本期已实现收益	427, 739. 13
2. 本期利润	-1, 202, 213. 84
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0037
4. 期末基金资产净值	237, 165, 707. 81
5. 期末基金份额净值	0.779

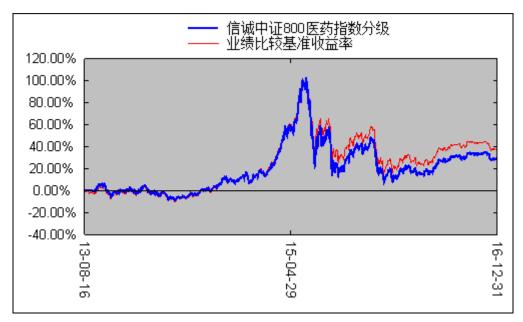
- 注: 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 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	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	-0.62%	0. 67%	-2.01%	0.65%	1.39%	0. 02%

## 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。

# § 4 管理人报告

# 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

11 1 11 11 11 11	\ <u>\\</u>	2年17年7月1			
姓名	职务	任本基金的基	基金经理期限	证券从	说明
<b>姓石</b>	奶労	任职日期	离任日期	业年限	<i>θ</i> ι93
	本基金				理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对
	基金经				冲基金 Robust methods 公司,担任数量
	理,兼任				分析师;于华尔街对冲基金 WSFA
	信诚沪				Group 公司,担任 Global Systematic
	深				Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月
	300 指				加入信诚基金,历任助理投资经理、专户
	数分级		-		投资经理。现任数量投资副总监, 信诚中
	基金、	2015 年 1 月 15 日		4	证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指
	信诚中				数分级基金、信诚中证 800 医药指数分
杨旭	证				级基金、信诚中证800有色指数分级基
	500 指				金、信诚中证 800 金融指数分级基金、
	数分级				信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、
	基金、				信诚中证信息安全指数分级基金、信诚
	信诚中				中证智能家居指数分级基金、信诚中证
	证				基建工程指数型基金(LOF)、信诚鼎利定
	800 有				增灵活配置混合型基金、信诚至益灵活
	色指数				配置混合基金、信诚至裕灵活配置混合
	分级基				基金、信诚新悦回报灵活配置混合基金
	金、信				的基金经理。

源中证 800 金 融份数 分级基金 液中 产业生 数			
融份	诚中证		
分金及信证TTT 上班	800 金		
金及信  证中正  TM工 题  指数分  数基设  证信信息  方全分  数量  如中  证信信息  方全分  数子  公中  证信管治  数分  表示  信证智能  数数  基验  如中  正是型  金。  (LOF)、  信问或  看利定語配  型基。  《LOF)、  信利定語配  型基。  《LOF)、  信证是  型基。  《在  型置基。  一定  工  工  工  工  工  工  工  工  工  工  工  工  工	融指数		
读中正 TMT产 业主题 指数基。 信证是 指数数念。 信证全指 数数分。 信证全指 数数分。 信证整理	分级基		
TMT 产业主题 指数分级基础中证金 经 () () () () () () () () () () () () ()	金及信		
业主题 指数分。 级基位, 经基础是是一个一个。 经验证,是一个一个。 在证据是一个一个。 在证据是一个。 在证据是一个。 在证据是一个。 在证据是一个。 在证明是一个 在证明是一一一个 在证明是一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	诚中证		
指数分 级基金、 信诫中 证信全指 数分级 基金、 信证程指 数分级 基础过程指 数分金、 信证程理基金 (1.0F)、 (1.0F) (	TMT 产		
級基础中 证信息 安分级 基础中 证留的 家分金、 信证智用级 基础中 证证基础 数型基 金 (LOF)、 信利定形配 置限合。 代间定形配置程态。 代间观话配置程态。 代值观话配置程态。 代值观话还话配置报。 在是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	业主题		
信城信息指数女子级 基金 中	指数分		
证信息 安全给数分金、 信证 智指数 数全。 中 证证 居的 数字。 中 证正 程相 基 金 (LOF)、 鼎 增 灵 冠 是 或 死 五 流 元 五 元 五 元 五 元 五 元 五 元 五 元 五 元 五 元 五	级基金、		
安全指数分录、信证 2000 在 20000 在 2000	信诚中		
数分级 基。 信诚中 证智指 数处金、 信述基建 工程型基 金。 (LOF)、 信向定常 灵活配 置基金、 信诚灵活配 置是金、 信诚灵活配置金。 信诚灵活配置金。 信诚灵活配置。 管诚灵活配置。 管诚灵活配置。	证信息		
基金、信读中证例能 家居指数分级基金、信读中证据程数 全。 (信证基建工程指数 全。 (LOF)、信证基建工程指数 全。 (LOF)、信利定语配置基金、信诚定活配置基金、信诚定活配置混合基。 (信诚定活配置量金、信诚定活配置量。 (信诚定活配置量。 (信诚可形成元活配置是一个证明,可证明,是一个证明,是一种证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一种证明,是一个证明,是一个证明,是一证明,是一证明,是一种证明,是一证明,是一证证明,是一证证明,是一证证证证明,是一证明,是证明,是一,是证明,是证明,是一个证明,是证明,是证明,是	安全指		
信城中 证智能 家居扮 数分级 基金、中 证基指 数金、中 证基指 数金(LOF)、 信城定 利利定增 灵活混合 型型域 定 配置基础 定 配置基础 定 配置基础 定 配置基础 管域 定 配置基础 管域 定 配置基础 管域 定 配置基础 管域 可 配置基础 管域 可 起 置 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	数分级		
证智能 家居指 数分级 基金、信城中 证基建 工程型基 金全(LOF) 原 信利灵活混合 型基域灵 置混会 全型基域灵 置混会 信成灵 置混会 信成灵 置混合 经基本	基金、		
家居指数分级 基金、中证基建工程指数型基金。(LOF)、信利定的, 信利定的, 信利定的, 置型基础至 置型基础至 后,或是 配置基金。 信证是 配置基金。 信证是 配置是。 后,或是 配置是。 后,或是 配置是。 后,或是 而是, 而是, 而是, 而是, 而是, 而是, 而是, 而是, 而是, 而是	信诚中		
数分级 基金、信诚中 证基建 工程指 数型基 金 (LOF)、信诚鼎 利定定增 灵活配 置混金、信读灵活配 置混金、信读灵活配 配基。 信读灵活配 配基。 信读灵活配工程。 合基或 循规定 在	证智能		
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。处基或至 益观对 混混合。 信诚灵活配 重星金、信诚灵活配 重星金、信诚灵活配 重星金、信诚灵活配 重混合 基础,行政强强	家居指		
信诚中 证基建 工程指 数型基 金 (LOF)、 信诚中 利定配 到观话配 到观话配 到观话配 。 置观去金、 信诚灵活 配置是 合基。、 信诚灵活 配置是 合基。、 信诚所 悦回报 灵活配 。 灵活配 。 灵活配 。 是述新	数分级		
证基建 工程指 数型基 金 (LOF)、 信诚鼎 利定增 灵活配 置混合 型基金、 信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚所 悦回报 灵活配置	基金、		
工程指数型基金 (LOF)、信诚鼎 利定電配 置混合 型基金、信诚强 活配置混 合基金、信诚 不活 配置混合基金 (信诚 ) 活 配置混合基金 (信诚 ) 活 配置混合基金 (信诚 ) 预	信诚中		
数型基金 (LOF)、信诚鼎 利定增 灵活配 置混合 型基金、信诚强活 配置混 合基金、信诚至 裕灵活 配置混 合基金、信诚所 悦回报 灵活配 置混合	证基建		
金 (LOF)、 信诚鼎 利定增 灵活配 置混合 型基金、 信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵混 合基。 信诚到 配置基金、 信诚新 悦回报 灵活配	工程指		
(LOF)、 信诚鼎 利定增 灵活配 置混合 型基金、 信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基。 信诚所 悦回报 灵活配	数型基		
信城県 利定増 灵活配 置混合 型基金、 信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚所 悦回报 灵活配 置混合	金		
利定增 灵活配 置混合 型基金、 信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	(LOF),		
灵活配置混合         型基金、信诚至         益灵活配置混合         合基金、信诚至         裕灵活配置混合         信城新         悦回报         灵活配置混合	信诚鼎		
置混合         型基金、信诚至         益灵活         配置混合         6基金、信诚至         裕灵活         配置混合	利定增		
型基金、 信诚至	灵活配		
信诚至 益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	置混合		
益灵活 配置混 合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	型基金、		
配置混合基金、信诚至 裕灵活 配置混合	信诚至		
合基金、 信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	益灵活		
信诚至 裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	配置混		
裕灵活 配置混 合基金、 信诚新 悦回报 灵活配 置混合	合基金、		
配置混合         合基金、信诚新         惊回报         灵活配         置混合	信诚至		
合基金、         信诚新         悦回报         灵活配         置混合	裕灵活		
信诚新 悦回报 灵活配 置混合	配置混		
悦回报       灵活配       置混合	合基金、		
灵活配       置混合	信诚新		
置混合	悦回报		
	灵活配		
基金的	l		
-L	基金的		 

- 2	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 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 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 16 年四季度, 市场经历的两个阶段, 首先, 从 10 月初到 11 月底, 在政府出房地产政策后, A 股相对于楼市, 大宗商品性价比高, 资金回流 A 股的资产再配置的逻辑扩散, 股市上涨。之后进入 12 月, 三个因素引发权益市场调整, 第一, 中央经济会议把政策基调弱化增长目标, 强调改革与防风险, 货币政策更加强调不会宽松, 市场形成流动性的拐点的预期; 第二, 受去杠杆、钱荒、信用风险爆发、美联储加息等因素的影响, 11 月中旬以来债市进入加速调整期, 债券市场抛售压力一定程度上蔓延到了股市, 部分机构选择了减持流动性比较好的股票来保证流动性; 第三, 险资举牌资金被严格监管, 市场节奏被监管打断, 成为了前段时间权益下跌的促发因素。

在本报告期内,我们继续采用完全复制法跟踪指数,在震荡市场环境中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。

展望明年一季度,对宏观层面的判断是滞胀,对市场判断为行情整体震荡,核心风险因素从国内转向国外,流动性风险预期驱动全年走势,所以看好两类股票:第一,看好有抗通胀、有需求增量、符合中长期需求趋势的板块,例如消费结构升级,二胎、养老进程启动相关的消费、医疗行业值得关注,大众消费品则需要甄选提价能力显著的标的,特朗普的战略收缩可能为一路一带松绑,建筑、高铁乃至核电的出口局面都有望打开;第二,由于绝对收益账户增多,账户的止损机制催生统计套利的交易机会

### 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-0.62%,同期比较基准收益率为-2.01%,基金超越业绩比较基准1.39%。

#### 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	222, 819, 074. 88	91.80
	其中: 股票	222, 819, 074. 88	91.80
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	19, 868, 256. 27	8. 19
7	其他资产	39, 285. 93	0.02
8	合计	242, 726, 617. 08	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(%)
		公儿阴恒(儿)	口至並见/ 伊祖比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	176, 732, 341. 19	74. 52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	8, 215, 138. 45	3. 46
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	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	2, 657, 354. 00	1. 12
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	合计	187, 604, 833. 64	79. 10

# 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	_	_
В	采矿业	_	-
С	制造业	21, 078, 985. 07	8.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37, 917. 66	0. 02
Е	建筑业	15, 592. 23	0.01
F	批发和零售业	13, 757, 487. 08	5. 80
G	交通运输、仓储和邮政业	9, 458. 68	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208, 020. 52	0.09
J	金融业	106, 780. 00	0.05
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	_	_
0	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	35, 214, 241. 24	14. 85

# **5.2.3**报告期末按行业分类的沪港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	000538	云南白药	215, 252	16, 391, 439. 80	6. 91
2	600276	恒瑞医药	344, 826	15, 689, 583. 00	6. 62
3	000423	东阿阿胶	128, 084	6, 899, 885. 08	2. 91
4	600535	天士力	158, 778	6, 587, 699. 22	2. 78
5	600196	复星医药	246, 248	5, 698, 178. 72	2. 40
6	002252	上海莱士	243, 135	5, 613, 987. 15	2. 37
7	000623	吉林敖东	175, 164	5, 428, 332. 36	2. 29
8	600867	通化东宝	243, 696	5, 344, 253. 28	2. 25
9	002007	华兰生物	136, 612	4, 883, 879. 00	2.06
10	600201	生物股份	150, 146	4, 743, 112. 14	2.00

# 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	600518	康美药业	726, 840	12, 974, 094. 00	5. 47
2	601607	上海医药	282, 518	5, 526, 052. 08	2. 33
3	600056	中国医药	130, 800	2, 489, 124. 00	1.05
4	600511	国药股份	70, 300	2, 116, 030. 00	0.89
5	002019	亿帆医药	134, 700	2, 059, 563. 00	0.87

## 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。

- 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。
- 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末未持有资产支持证券。
- 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末未持有贵金属。
- 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持有权证。
- 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损益明细

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。

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

#### 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损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 投资组合报告附注
- **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,或在报告编制目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	24, 821. 58
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	3, 880. 25
5	应收申购款	10, 584. 10
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	39, 285. 93

- 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前十名股票中未存在流通受限情况。
- 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未存在流通受限情况。
- 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	信诚中证 800 医药指	信诚中证 800 医药指	信诚中证 800 医药指
	数分级 A	数分级 B	数分级
报告期期初基金份额总额	109, 639, 486. 00	109, 639, 486. 00	118, 428, 721. 98
报告期期间基金总申购份额	-	_	3, 229, 366. 41
减:报告期期间基金总赎回份额	-	_	45, 848, 350. 08
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-18, 832, 042. 00	-18, 832, 042. 00	47, 134, 556. 37
报告期期末基金份额总额	90, 807, 444. 00	90, 807, 444. 00	122, 944, 294. 68

- 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。
- 2. 根据《信诚中证 800 医药指数分级基金基金合同》、《信诚中证 800 医药指数分级基金招募说明书》、《信诚基金关于信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,基金管理人信诚基金管理有限公司于2016 年 12 月 15 日(折算基准日)对本基金进行了基金份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚 800 医药份额 9,470,472.37 份。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

无

# §9 备查文件目录

# 9.1 备查文件目录

- 1、信诚中证800医药指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
- 3、信诚中证800医药指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证800医药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

## 9.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地一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。

# 9.3 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1月20日