信诚三得益债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月22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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚三得益债券
基金主代码	550004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月27日
报告期末基金份额总额	753,819,547.36份
投资目标	本基金在保证基金资产的较高流动性和稳定性基础上,严格控制风险,同时通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	1.债券类资产的投资策略 本基金将采取自上而下、积极投资和控制风险的债券投资策略,在战略配置上,主要通过对收益率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体配置;在战术配置上采取跨市场套利、收益率曲线策略和信用利差策略等对个券进行选择,在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上,获取超额收益。对于可转债的投资采用公司分析法和价值分析。 2.新股申购策略 本基金将结合市场的资金状况预测拟发行上市的新股(或增发新股)的申购中签率,考察它们的内在价值以及上市溢价可能,判断新股申购收益率,制定申购策略和卖出策略。 3.二级市场股票投资策略 本基金股票投资将注重基本面研究,选择流动性好、估值水平较低、具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股,构建组合,以避免单一股票的特定风险。 4.衍生金融工具投资策略 本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的证券的研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。
业绩比较基准	80%×中信标普全债指数收益率+20%×一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	信诚三得益债券A　信诚三得益债券B
下属两级基金的交易代码	550004　550005
报告期末下属两级基金的份额总额	349,761,489.70份　404,058,057.66份

§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

基金简称	信诚三得益债券A报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)	信诚三得益债券B报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	2,146,371.68	2,858,816.67
2.本期利润	2,733,262.58	4,206,779.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139	0.0134
4.期末基金资产净值	350,122,701.19	400,133,345.49
5.期末基金份额净值	1.001	0.990

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

信诚三得益债券A

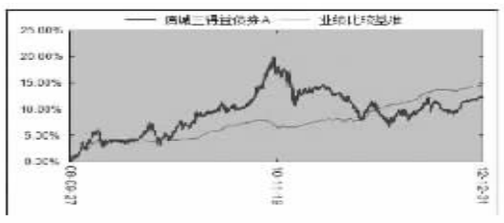
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年第4季度	2.14%	0.08%	0.97%	0.02%	1.17%	0.06%

信诚三得益债券B

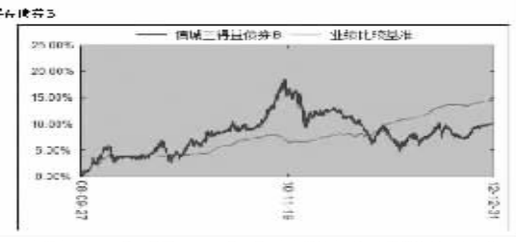
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年第4季度	2.06%	0.08%	0.97%	0.02%	1.09%	0.06%

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

信诚三得益债券A



信诚三得益债券B



注:本基金建仓期自2008年9月27日至2009年3月26日,建仓期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

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		
王国强	本基金基金经理,信诚理财7日盈债券基金及信诚添金分级债券基金基金经理	2008年9月27日	-	13	管理学硕士,13年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚三得益债券基金、信诚理财7日盈债券基金以及信诚添金分级债券基金的基金经理。
李仆	本基金基金经理,信诚经典优债债券基金基金经理	2012年6月18日	-	12	12年证券从业经验。曾任职于宝钢集团财务有限责任公司资金部、宝钢集团有限公司资产部、宝岛(香港)贸易有限公司、华宝信托有限责任公司。2011年4月加入信诚基金管理有限公司。

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《信诚三得益债券型证券投资基金基金合同》、《信诚三得益债券型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v1.2》,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

报告期内本基金未有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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2012年,央行进行了两次调降存款利率和两次存款准备金率,在宽松的货币环境下,信用债利差出现了大幅度的缩窄,由于利率市场化导致市场利率较高,收益率相对较低的利率债表现相对平淡。2012年也出现了数次如"山东海龙"等信用事件,最终都在政府的干预下得到解决。

展望2013年,经济会有所复苏,但整体上依旧偏弱,资金面相对宽松、可能会出现一次降息或降准,通胀上半年平稳,下半年会出现一定反弹,因此债券市场上半年仍然较为安全。

策略上将继续维持高杠杆的操作,主要投资高收益率城投债,适当降低组合的高久期债券和强周期行业比例。积极进行新股申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金比较基准收益率为0.97%,本基金A、B份额净值分别增长2.14%和2.06%,分别领先基准1.17%和1.09%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,009,112,982.40	88.63
	其中:债券	1,005,136,482.40	88.28
	资产支持证券	3,976,500.00	0.35
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	107,340,517.75	9.43
6	其他资产	22,108,507.83	1.94
7	合计	1,138,562,007.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,585,224.70	2.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	894,275,257.70	119.20
5	企业短期融资券	90,276,000.00	12.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,005,136,482.40	133.97

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122912	10鄂国资	300,000	30,900,000.00	4.12
2	1280182	12津南债	300,000	30,372,000.00	4.05
3	122628	12东投债	271,000	27,520,050.00	3.67
4	122507	12玉交投	250,000	25,252,500.00	3.37
5	122638	12申华信	250,000	25,250,000.00	3.37
5	122952	09赣州债	250,000	25,250,000.00	3.37

注:本基金本报告期末,按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资中"12申华信"与"09赣州债"并列第5名。

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	061205001	12上元1A	50,000	3,976,500.00	0.53

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末仅持有上述1只资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

5.8.2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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	253,610.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,845,046.34
5	应收申购款	9,850.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,108,507.83

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.8.6 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	信诚三得益债券A	信诚三得益债券B
报告期期初基金份额总额	37,525,838.11	76,766,861.42
报告期期间基金总申购份额	320,310,414.65	473,640,436.81
减:报告期期间基金总赎回份额	8,074,763.06	146,349,240.57
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	349,761,489.70	404,058,057.66

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、信诚三得益债券型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、信诚三得益债券型证券投资基金基金合同

4、信诚三得益债券型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

7.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地---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。

7.3 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
2013年1月22日

信诚深度价值股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月22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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚深度价值股票(LOF)(场内简称:信诚深度)
基金主代码	165508
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2010年7月30日
报告期末基金份额总额	188,780,992.58份
投资目标	通过对公司基本面的研究,深入剖析股票价值被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争获取资本的长期增值。
投资策略	本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。本基金的核心理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。本基金的个股选择以"自下而上"为主,但同时也将结合行业研究分析辅以"自上而下"的行业配置。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。
业绩比较基准	80%×上证180指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
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

§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(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,685,096.92
2.本期利润	10,302,037.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0540
4.期末基金资产净值	171,092,167.93
5.期末基金份额净值	0.906

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
2012年第4季度	6.34%	1.10%	10.18%	1.04%	-3.84%	0.06%

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2010年7月30日至2011年1月29日,建仓期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

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		
谭鹏万	本基金基金经理,信诚精萃成长股票基金基金经理	2011年9月8日	-	4	曾任华宝信托有限责任公司高级分析师。2008年7月加入信诚基金管理有限公司,担任高级分析师。

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《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)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v1.2》,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

报告期内本基金未有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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金严格坚持基金合同的要求,积极寻找具有深度价值特征的行业和个股,坚持寻找具有较高成长性的行业和公司作为配置的重点。4季度增加了金融,地产、降低了白酒等板块的持仓。

从中长期看,中国经济原有增长模式无法延续,经济增速将下一个台阶。目前经济还处在去杠杆化和去产能化的过程中,与上一轮高速经济增长相匹配的金融体制将加速改革。海外,美国复苏的大方向不变,欧洲边缘国家长期竞争力缺失问题短期无法解决,这些国家经济的深度调整不可避免,新兴国家的状况也不容乐观。

受益于换届不确定性风险降低和经济启稳趋势明显,预计1季度市场将保持较好的走势,但行业和个股间的盈利能力将出现显著差异。受益于内需增长,代表未来增长方向,并具有持续竞争能力的公司将获得较好的投资收益。

本基金将深入挖掘行业和个股的投资价值,增加周期股持仓的同时,在不确定中精选成长确定的行业和个股,争取为基金持有人获得长期稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值增长率为6.34%,同期业绩比较基准收益率为10.18%,落后业绩基准3.84%。

§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	154,083,105.87	89.54
	其中:股票	154,083,105.87	89.54
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	15,597,141.71	9.06
6	其他资产	2,406,098.91	1.40
7	合计	172,086,346.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	814,000.00	0.48
C	制造业	88,611,921.07	51.79
C0	食品、饮料	17,530,290.00	10.25
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,513,261.99	2.05
C5	电子	30,314,975.05	17.72
C6	金属、非金属	4,442,400.00	2.60
C7	机械、设备、仪表	10,050,266.00	5.87
C8	医药、生物制品	22,760,728.03	13.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,741,700.00	2.19
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	34,900,100.00	20.40
J	房地产业	26,015,384.80	15.21
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	154,083,105.87	90.06

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	002415	海康威视	485,000	15,088,350.00	8.82
2	000024	招商地产	430,000	12,852,700.00	7.51
3	002236	大华股份	246,363	11,418,925.05	6.67
4	600048	保利地产	714,918	9,722,884.80	5.68
5	601318	中国平安	180,000	8,152,200.00	4.76
6	002304	洋河股份	87,000	8,123,190.00	4.75
7	600276	恒瑞医药	269,862	8,122,846.20	4.75
8	601601	中国太保	290,000	6,525,000.00	3.81
9	000625	长安汽车	800,800	5,325,320.00	3.11
10	600030	中信证券	390,000	5,210,400.00	3.05

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	71,522.21
2	应收证券清算款	2,317,377.07
3	应收股利	-
4	应收利息	3,599.13
5	应收申购款	13,600.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,406,098.91

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中不在流通受限的情况。

5.8.6 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

报告期期初基金份额总额	194,891,072.49
报告期期间基金总申购份额	861,323.39
减:报告期期间基金总赎回份额	6,971,403.30
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	188,780,992.58

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)相关批准文件

2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程

3、信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同

4、信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地---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。

7.3 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
2013年1月22日

信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月22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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚盛世蓝筹股票
基金主代码	550003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
报告期末基金份额总额	1,090,995,018.52份
投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司,追求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。
业绩比较基准	80%×中信标普50指数收益率+20%×中信全债指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
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

§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(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	20,083,410.23
2.本期利润	59,074,713.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0569
4.期末基金资产净值	1,896,083,939.37
5.期末基金份额净值	1.738

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。

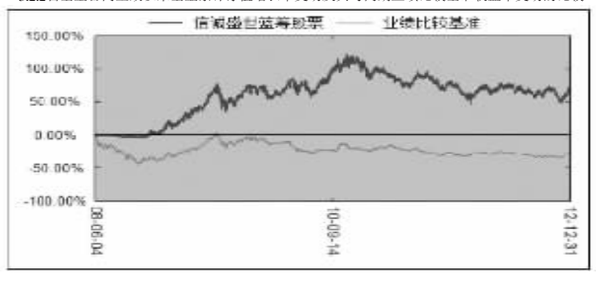
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2012年第4季度	4.38%	1.12%	11.42%	1.01%	-7.04%	0.11%

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2008年6月4日至2008年12月3日,建仓期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

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		
张光成	本基金基金经理,信诚周期轮动股票(LOF)基金基金经理	2011年10月28日	-	8	CFA,8年证券、基金从业经验。曾任欧洲货币(上海)有限公司研究总监、兴业全球基金管理有限公司基金经理。2011年7月加入信诚基金管理有限公司,担任投资经理。现任信诚盛世蓝筹股票型基金基金经理及信诚周期轮动股票(LOF)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《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹股票型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v1.2》,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

报告期内本基金未有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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4季度一开始,市场仍然下跌,上证指数一度跌到了1949点,创下新低。然而在最后一个月在大盘蓝筹股的带领下绝地反击,迅速带领指数上涨到2269点收盘,上证指数年线收红。

本基金由于持有了较多的酒鬼酒和其他白酒,受到酒鬼酒塑化剂事件影响,这些股票在本报告期内下跌严重,拖累了基金净值,在此向投资者表示歉意。本管理人会深刻总结,吸取相关经验教训,努力避免类似错误。

从操作上讲,本基金持有了较多的医药和食品饮料股票,基本避免了周期类股票。由于宏观经济环境目前并不是特别好,同时消费类股票对应周期类股票的估值溢价已接近历史底部,因此从性价比角度来讲,消费股应该更有优势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为4.38%,同期业绩比较基准收益率为11.42%,基金份额净值增长率表现落后基准7.04个百分点。

§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	1,537,226,499.16	76.51
	其中:股票	1,537,226,499.16	76.51
2	固定收益投资	167,273,725.60	8.33
	其中:债券	167,273,725.60	8.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	252,775,170.92	12.58
6	其他资产	51,901,642.29	2.58
7	合计	2,009,177,037.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	6,447,485.46	0.34
C	制造业	661,151,044.62	34.87
C0	食品、饮料	279,245,951.21	14.73
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,186,456.15	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	111,108,682.95	5.86
C5	电子	44,687,378.55	2.36
C6	金属、非金属	44,900,542.44	2.37
C7	机械、设备、仪表	81,069,909.02	4.28
C8	医药、生物制品	96,952,124.30	5.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产