信诚经典优债债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚经典优债债券
基金主代码	550006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月11日
报告期末基金份额总额	163,407,330.74份
投资目标	本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,通过主动管理,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金通过实施稳健的投资策略,控制基金的整体风险。在战略配置上,主要通过对利率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体期限、类属配置。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;并运用核心-卫星投资组合管理策略进行债券组合构建。本基金也将适当参与一级市场的投资,以增强基金收益。对于可转债的投资采用公司分析法和价值分析法。
业绩比较基准	90%×中信标普全债指数+10%×活期存款利率(税后)
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较低风险品种,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
下属分级基金的基金简称	信诚经典优债债券A / 信诚经典优债债券B
下属分级基金的交易代码	550006 / 550007
报告期末下属分级基金的份额总额	80,008,835.87份 / 83,398,494.87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

主要财务指标	信诚经典优债债券A(报告期(2015年7月1日至2015年9月30日))	信诚经典优债债券B(报告期(2015年7月1日至2015年9月30日))
1.本期已实现收益	1,926,521.09	1,961,378.18
2.本期利润	-2,789,962.32	-154,389.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0344	-0.0018
4.期末基金资产净值	89,281,473.38	92,908,208.15
5.期末基金份额净值	1.116	1.114

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

信诚经典优债债券A

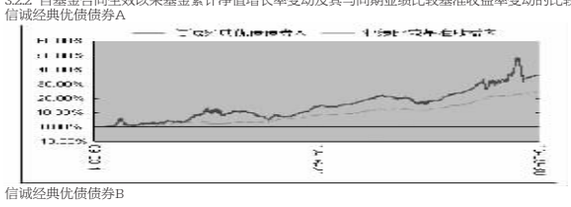
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.59%	0.40%	1.63%	0.05%	-3.22%	0.35%

信诚经典优债债券B

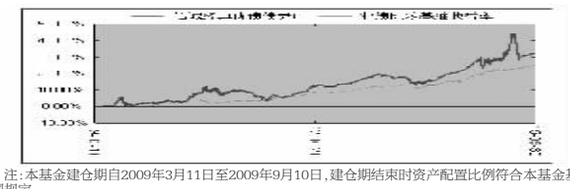
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.68%	0.39%	1.63%	0.05%	-3.31%	0.34%

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

信诚经典优债债券A



信诚经典优债债券B



注:本基金建仓期自2009年3月11日至2009年9月10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		
宋海娟	本基金基金经理,信诚季季定期支付债券基金、信诚月月定期支付债券基金及信诚三得益债券基金的基金经理。	2014年2月11日	-	11	2004年6月至2007年4月期间于长信基金管理有限责任公司担任债券交易员;2007年4月至2013年7月于光大保德信基金管理有限公司担任固定收益类投资经理;2013年7月加入信诚基金管理有限公司。现任信诚季季定期支付债券基金、信诚月月定期支付债券基金、信诚三得益债券基金及信诚经典优债债券基金的基金经理。

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《信诚经典优债债券型证券投资基金基金合同》、《信诚经典优债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》,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

回顾三季度,8月份人民币的突然贬值动摇了国际市场对其的稳定预期,央行在之后的操作中对外稳定汇率、对内稳定流动性,使得人民币的贬值预期有所稳定。央行货币政策操作的独立性也得到大幅上升。面对低迷的经济,央行继续降准降息引导社会融资成本下降,并出台新的法定准备金率考核方法,银行间7天回购加权利率小幅下行,稳定的低资金成本有力促使了债券收益率下行。

受到股市下跌、IPO暂停发行影响,资金大举流入债市。资金机构受避险需求和资产再配置驱动,成为买债主力。利率债长端小幅下行,信用债中低评级收益率持续下行,尤其是低评级信用债收益率下行显著。

展望四季度,宏观判断最差时期过去,但复苏仍迟缓,整体投资需求较弱,市场普遍面临缺资产的现象。货币政策方面,美联储暂缓加息,新兴市场股、债和汇市迎来短暂反弹,人民币贬值和资金外流风险放缓,但4季度加息不确定性仍困扰全球市场。

随着央行放松持续,长期利率债下行趋势未改。债券品种天然具有回报有限、下行无限的特性,当收益率低到一定程度之后,虽然趋势没有逆转,但性价比和想象力已经大为降低。债券相对权益市场的性价比经过近期的此消彼涨之后已经不再明显突出。随着信用债票息资产越来越稀缺,中高等级信用债由于绝对收益率尚可,仍具有良好的配置和杠杆价值。对于低资质品种,长期盈利低迷主导的个体信用风险将继续积聚和加速暴露,规避雷区的压力会越来越大。"稀缺性"逻辑使得整体转债股性估值维持高位有其合理性,且大部分标的中期来看基本无促转股可能,未来或存在波段操作机会。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A、B份额净值增长率分别为-1.59%和-1.68%,同期业绩比较基准收益率为1.63%,基金落后业绩比较基准分别为3.22%和3.31%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	285,495,965.30	95.54
	其中:债券	285,495,965.30	95.54
	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	3,349,041.74	1.12
7	其他资产	9,987,211.44	3.34
8	合计	298,832,218.48	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。

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。

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	21,014,700.00	11.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,140,800.00	8.86
	其中:政策性金融债	16,140,800.00	8.86
4	企业债券	232,664,741.30	127.70
5	企业短期融资券	10,101,000.00	5.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,574,724.00	3.06
8	其他	-	-
9	合计	285,495,965.30	156.70

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

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	124552	14如金鑫	200,000	21,610,000.00	11.86
2	124530	14海开01	200,000	21,126,000.00	11.60
3	019423	14国债23	210,000	21,014,700.00	11.53
4	112231	14金贵债	200,000	20,898,000.00	11.47
5	122776	11新光债	158,000	16,285,060.00	8.94

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损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

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。

5.11.2 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	22,341.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,964,569.55
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,987,211.44

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	3,934,500.00	2.16
2	128009	歌尔转债	646,400.00	0.35

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 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	信诚经典优债债券A	信诚经典优债债券B
报告期期初基金份额总额	103,658,647.56	54,985,900.63
报告期期间基金总申购份额	8,526,315.43	76,741,044.10
减:报告期期间基金总赎回份额	32,176,127.12	48,328,449.86
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	80,008,835.87	83,398,494.87

§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、信诚经典优债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、信诚经典优债债券型证券投资基金基金合同
4、信诚经典优债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

9.2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。

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
2015年10月24日

信诚精萃成长混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚精萃成长混合
基金主代码	550002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月27日
报告期末基金份额总额	1,737,059,982.35份
投资目标	本基金通过考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平,挖掘具备长期稳定成长潜力的上市公司,以实现基金资产的长期增值和风险调整后的超额收益。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券和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。本基金定位为混合型基金,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。在实际投资过程中,本基金将根据满足本基金选股标准的股票的数量、估值水平、股票资产相对于无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产,调整本基金股票的投资比重。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+15%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	29,600,393.52
2.本期利润	-454,972,169.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2533
4.期末基金资产净值	1,348,278,633.96
5.期末基金份额净值	0.7762

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。

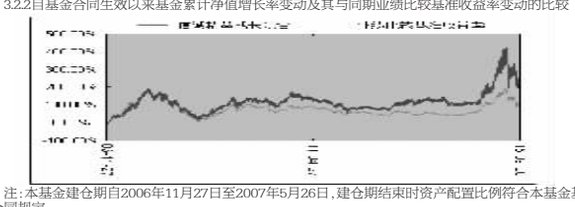
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-23.31%	3.74%	-22.61%	2.60%	-0.70%	1.14%

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2006年11月27日至2007年5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		
王睿	本基金基金经理,信诚基金研究副总监职务,信诚优胜精选混合基金基金经理。	2015年5月29日	-	5	2007年9月至2008年4月期间于上海甫瀚咨询管理有限公司担任咨询师,负责财务战略咨询工作;2008年4月至2009年10月期间于美国国际集团(AIG)投资部担任研究员;2009年10月加入信诚基金管理有限公司,曾担任专户投资经理,现任信诚基金研究副总监职务,信诚精萃成长混合基金、信诚优胜精选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《信诚精萃成长混合型证券投资基金基金合同》、《信诚精萃成长混合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》,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

经历了二季度的过山车行情,三季度A股市场的波动依然较大,但整个季度指数仍呈现明显的下跌态势;期间上证指数下跌了28.6%,创业板指下跌了27.1%。7月份市场在证金公司买入以及一系列的救市刺激下出现了一波超跌反弹,但是投资者情绪仍然极度不稳定,在7月下旬和8月中旬又分别出现了两波恐慌性下跌,其中以8月中旬开始的下跌杀伤力最大,多次出现千股跌停的情况,很多股票创出了救市以来的新低。本基金在6月份的股灾后迅速调整了策略,一方面把仓位从较为接近上限下调至了中性附近,同时减持了流动性较差以及估值仍然存在泡沫的股票,增持了业绩和估值匹配较高的公司,提高了组合的防御性,但仍然无法抵挡系统性风险的冲击,净值出现了23%的下跌。

7月初市场延续了6月末的暴跌,并且因为大量的融资盘无法平仓以及大量公司临时停牌出现了罕见了流动性危机。随后,证金公司,汇金公司大规模介入市场应对危机,使之前无法平仓的融资盘得以消化,流动性危机短暂解除,市场出现了一波超跌反弹。在经历了一个月左右的震荡反弹后,随着大部分公司复牌,增量资金无法支持进一步的上涨,同时,投资者情绪仍然未能完全从之前恐慌中走出,市场在8月中下旬迅速从4000点下跌至3000点以下,杀伤力极大。此后,市场在2850点附近企稳,并震荡反弹至九月底。

目前宏观经济情况依然不容乐观,制造业继续萎靡,汇率依然存在下行空间,社会总需求仍然没有明确改善,但是我们认为目前并不应对市场过于悲观。首先,经济的各种悲观情景已经比较充分的反应在目前的点位上;其次,目前社会流动性非常充足,信用债、一线城市地产等投资方向都出现了比较明显的泡沫,相比较之下,权益资产是收益风险比较高的大类资产,会吸引资金流入;最后,随着十三五规划的逐步出台以及财政政策的发力,市场会陆续涌现较多热点,提振市场情绪。我们认为市场短期已经度过了最艰难的时刻,目前的点位下,很多公司中长期的投资价值已经显现。

落实到投资品种上,本基金四季度主要选择了十三五规划和财政政策刺激两条主线,并以产业空间大,产业链长,能够吸引民间资本投入为标准,重点选择了环保节能、新能源汽车、天然气管网、医疗服务等细分领域作为重点进行配置,争取在四季度为持有人创造较好的收益。

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-23.31%,同期业绩比较基准收益率为-22.61%,基金落后业绩比较基准0.70%。

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	951,893,410.90	70.00
	其中:股票	951,893,410.90	70.00
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	406,337,693.91	29.88
7	其他资产	1,626,124.93	0.12
8	合计	1,359,857,229.74	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	采矿业	21,150,000.00	1.57
C	制造业	453,007,272.49	33.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,284,482.95	8.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	91,464,371.20	6.78
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	22,244,884.70	1.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	50,007,819.12	3.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	56,575,042.56	4.20
N	水利、环境和公共设施管理业	126,278,537.88	9.37
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	10,881,000.00	0.81
	合计	951,893,410.90	70.60

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	600483	福能股份	7,500,000	103,050,000.00	7.64
2	002665	首航节能	2,799,950	68,318,780.00	5.07
3	300198	纳川股份	5,500,000	58,410,000.00	4.33
4	300284	苏交科	2,599,956	56,575,042.56	4.20
5	600240	华业资本	4,699,983	50,007,819.12	3.71
6	002675	东诚药业	1,200,000	47,436,000.00	3.52
7	000826	桑德环境	1,299,980	43,809,326.00	3.25
8	300070	碧水源	999,887	43,685,063.03	3.24
9	000920	南方汇通	2,899,946	41,411,228.88	3.07
10	002573	清新环境	2,199,895	38,784,148.85	2.88

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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损益明细

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

本基金投资范围不包括股指期货投资。

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损益明细

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投资组合报告附注

5.11.1本基金本期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	1,390,408.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,082.72
5	应收申购款	167,633.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,626,124.93

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	43,685,063.03	3.24	筹划重大事项

5.11.6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

报告期期初基金份额总额	2,006,562,679.64
报告期期间基金总申购份额	507,725,060.19
减:报告期期间基金总赎回份额	777,227,757.48
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	1,737,059,982.35

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,900,182.64
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	14,900,182.64
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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015-07-15	14,900,182.64	12,759,406.55	0.0010%
合计			14,900,182.64	12,759,406.55	

§8影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》等相关法律法规及信诚基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")旗下部分基金基金合同的约定,经与基金托管人协商一致,自2015年8月3日起,本基金名称变更为"信诚精萃成长混合型证券投资基金",基金类别变更为"混合型"。上述事项已报中国证监会备案。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、(原)信诚精萃成长股票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、信诚精萃成长混合型证券投资基金基金合同
4、信诚精萃成长混合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

9.2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。

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
2015年10月24日

信诚理财7日盈债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚理财7日盈债券
基金主代码	550012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月27日
报告期末基金份额总额	49,539,221.98份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产稳定增值,力争成为投资者短期理财的理想工具。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
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,其预期风险与预期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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	信诚理财7日盈债券A / 信诚理财7日盈债券B
下属分级基金的交易代码	550012 / 550013
报告期末下属分级基金的份额总额	49,539,221.98份 / -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

主要财务指标	信诚理财7日盈债券A报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)	信诚理财7日盈债券B报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	429,356.69	64,173.66
2.本期利润	429,356.69	64,173.66
3.期末基金资产净值	49,539,221.98	-

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚理财7日盈债券A

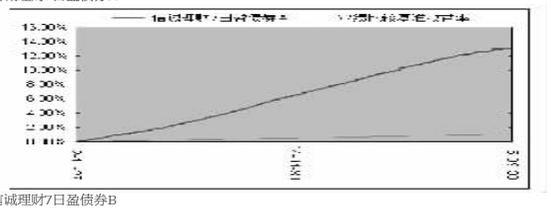
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6470%	0.0210%	0.0882%	0.0000%	0.5588%	0.0210%

信诚理财7日盈债券B

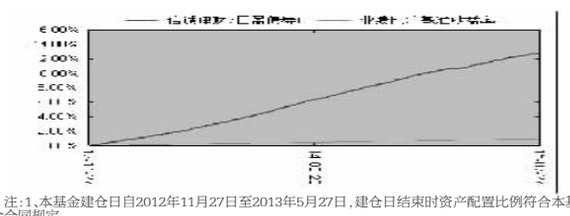
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月(2015年7月1日至2015年7月27日)	0.2522%	0.0180%	0.0259%	0.0000%	0.2263%	0.0180%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信诚理财7日盈债券A



信诚理财7日盈债券B



注:1、本基金建