信诚经典优债债券型证券投资基金

【2015】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:2016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2016年1月21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10月1日起至12月31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	104,150,614.30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,在技术配置上,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%×中证综合债指数+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	39,663,314.73份	64,487,299.57份

注:本基金管理人2015年9月28日发布公告,自2015年10月1日本基金业绩比较基准由“中信标普全债指数*90%+活期存款利率(税后)*10%”变更为“中证综合债指数*90%+活期存款利率(税后)*10%”。

§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10月1日至2015年12月31日)	信诚经典优债债券B报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,511,322.66	2,142,238.50
2.本期利润	2,939,253.00	2,567,141.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0383	0.0371
4.期末基金资产净值	45,812,956.60	74,277,671.63
5.期末基金份额净值	1.155	1.152

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

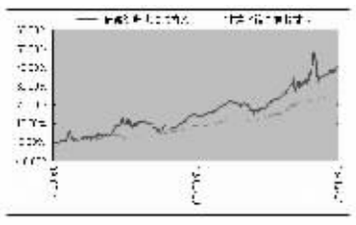
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.49%	0.13%	2.18%	0.06%	1.31%	0.07%

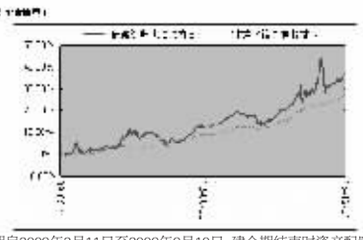
信诚经典优债债券B

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	3.41%	0.14%	2.18%	0.06%	1.23%	0.08%

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





注:1、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。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普全债指数*90%+活期存款利率(税后)*10%”变更为“中证综合债指数*90%+活期存款利率(税后)*10%”。

§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《信诚基金公平交易管理制度》,《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

10月24日,央行再度降准降息,存贷款基准利率均创下历史新低,1年期存、贷款利率分别降至1.50%与4.35%。在需求疲弱环境下,通胀延续下行趋势,为宽松政策创造更大空间。同时,基准利率下行继续降低社会融资成本,引导债券收益率下行。12月17日,美联储宣布加息,在市场预期充分的前提下靴子最终落地,标志着其利率政策正常化开始踏出第一步。虽然短期内本次加息对市场冲击力度有限,但长期来看,如果2016年美联储连续加息,将引起我国资本外流和人民币贬值压力上升,债市资金面或将收紧,流动性或有波动,进而可能导致债市震荡。未来全球最大经济体加息周期的开启或将对新兴市场国家形成新的压力,导致其资本外流和汇率波动加大等风险。资本外流带来的短期资金面的波动也会迫使央行通过各种工具来熨平。

四季度,债券收益率在年末最后一月内快速下行。因为可以预见到在一季度将有大量的配置资金会流入债市,而一季度债券供给量一般都不大,供需关系有利于债券收益率在一季度进一步下降。增量资金对安全资产的配置需求仍是未来债券市场下行的主要逻辑。至于债券市场的风险,在明年信用风险逐步暴露的情况下,最实质的风险是违约风险和信用利差扩大的风险。

本基金在报告期内降低组合的投资杠杆,适当拉长久期,选择个别弹性较大的可转债做波段。未来一季度,我们将继续发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略、均衡投资,甄别信用风险,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

展望明年,我们认为政府用积极的财政政策维持经济稳定仍是大概率事件,在此过程中需要宽松的货币政策配合。基本面、政策面和供需关系仍支持债券收益率下行,尤其是一季度配置需求释放较多,而供给相对跟不上,一季度收益率可能下行较快。从全年来看,收益率可能会中间出现一些波动,但债券还不会很快进入反转行情,在低位长时间震荡的可能性非常大,因此有充分时间判断底部和做仓位调整。在大趋势当中顺势而为将是最好的策略。

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3.49%和3.41%,同期业绩比较基准收益率为2.18%,基金超越业绩比较基准分别为1.31%和1.23%。

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	262,116,217.20	94.67
	其中:债券	262,116,217.20	94.67
	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	1,600,000.00	0.58
	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	5,507,912.08	1.99
7	其他资产	7,644,964.34	2.76
8	合计	276,869,093.62	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	10,008,000.00	8.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,001,500.00	12.49
	其中:政策性金融债	15,001,500.00	12.49
4	企业债券	230,369,873.20	191.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,736,844.00	5.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,116,217.20	218.27

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	124562	14如金鑫	200,000	21,898,000.00	18.23
2	124530	14海开01	200,000	21,842,000.00	18.19
3	122523	12海亮01	145,000	15,053,900.00	12.54
4	018001	国开1301	150,000	15,001,500.00	12.49
5	112231	14金贵债	120,000	12,163,200.00	10.13

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	19,142.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,624,623.25
5	应收申购款	1,198.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,644,964.34

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	128009	歌尔转债	2,809,400.00	2.34
2	110030	格力转债	413,940.00	0.34
3	110031	航信转债	389,520.00	0.32

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	80,008,835.87	83,398,494.87
报告期期间基金总申购份额	1,884,133.34	9,275,248.15
减:报告期期间基金总赎回份额	42,229,654.48	28,186,443.45
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	39,663,314.73	64,487,299.57

§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招募说明书
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合同
4.信诚经典优债债券型证券投资基金托管协议
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
2016年1月22日

信诚精萃成长混合型证券投资基金

【2015】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:2016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2016年1月21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10月1日起至12月31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	1,611,667,067.84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%×中证国债指数收益率+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

注:本基金管理人2015年9月28日发布公告,自2015年10月1日本基金业绩比较基准由“中信标普300指数收益率*80%+中信国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”变更为“中信标普300指数收益率*80%+中证国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”。

§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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	6,281,064.04
2.本期利润	364,360,488.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.2206
4.期末基金资产净值	1,595,259,453.68
5.期末基金份额净值	0.9898

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。

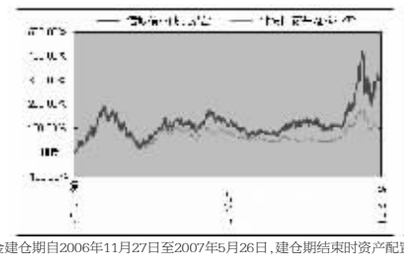
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	27.52%	2.09%	12.51%	1.25%	15.01%	0.84%

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:1、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。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普300指数收益率*80%+中信国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”变更为“中信标普300指数收益率*80%+中证国债指数收益率*15%+金融同业存款利率*5%”。

§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,信诚基金研究部总监助理,信诚优胜精选混合基金经理。	2015年5月29日	-	6	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,现任信诚基金研究部总监助理,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

三季度末A股市场在短暂反弹后出现了二次探底,很多股票创出了股灾以后的新低,泡沫被明显挤压,部分成长类股票估值回到了合理水平,市场呈现出清状态。在此情况下,四季度以中小创为代表的成长股出线了一波较大幅度的反弹,期间上证指数单季度上涨15.93%,创业板指数上涨30.32%,反弹的主升浪发生在10月和11月,整个12月市场行情比较平淡和纠结,缺乏赚钱效应。本基金在三季度的大跌后适当增加了仓位,并将部分防御仓位积极转移到成长股上,单季度净值增长27.5%。

目前情况下,股票市场面临诸多压力。宏观经济情况不容乐观,低迷的需求导致制造业和上游原材料的景气度都异常萎靡;在美联储加息的刺激下,人民币兑美元汇率出现近几年最大幅度的贬值,贬值的力度和速度都超出市场预期,对金融资产价格形成较大压力;而经历过一波反弹之后大部分股票资产的估值又回到了比较高的位置上,出现了一定的泡沫。乐观的因素是市场流动性依然比较宽裕,资产荒大背景下权益资产仍然是较好的配置方向;供给侧改革等措施可能在一定程度上解决全社会的供需矛盾,缓解经济压力;新兴产业的前进步伐仍然没有减速。

2016年初A股市场的复杂性要明显高于2015年初,风险和机遇并存,在这种情况下,本基金将维持中性仓位,通过积极选股创造相对收益。落实到具体配置上,我们依然看好新兴领域的机会,选择了新消费,新技术和新投资三个方向作为研究和投资重点。新消费主要根据全社会年龄结构变化选择了养老,二胎和90后消费作为投资重点;新技术上我们选择虚拟现实和基因编辑作为投资方向;而在新投资领域,我们认为智慧城市和半导体投资具有较高的确定性。

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27.52%,同期业绩比较基准收益率为12.51%,基金超越业绩比较基准15.01%。

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	1,324,173,942.79	82.52
	其中:股票	1,324,173,942.79	82.52
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	266,045,098.73	16.58
7	其他资产	14,480,077.50	0.90
8	合计	1,604,699,119.02	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	-	-
C	制造业	707,748,287.40	44.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149,324,285.65	9.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	103,730,509.68	6.50
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	79,437,857.80	4.98
J	金融业	93,753,568.76	5.88
K	房地产业	52,675,000.00	3.30
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	46,197,074.00	2.90
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	74,567,359.50	4.67
S	综合	16,740,000.00	1.05
	合计	1,324,173,942.79	83.01

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	000920	南方汇通	3,400,000	81,702,000.00	5.12
2	600483	福能股份	4,500,000	77,355,000.00	4.85
3	002665	首航节能	2,500,000	76,250,000.00	4.78
4	002036	汉麻产业	1,900,000	58,520,000.00	3.67
5	600845	宝信软件	999,790	57,807,857.10	3.62
6	300198	纳川股份	3,500,000	55,055,000.00	3.45
7	600351	亚宝药业	3,500,000	54,670,000.00	3.43
8	600240	华业资本	3,500,000	52,675,000.00	3.30
9	002169	三特索道	1,499,905	46,197,074.00	2.90
10	000593	大通燃气	3,199,896	45,854,509.68	2.87

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	918,013.42
2	应收证券清算款	13,284,597.78
3	应收股利	-
4	应收利息	49,611.00
5	应收申购款	227,855.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,480,077.50

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	1,737,059,982.35
报告期期间基金总申购份额	214,819,302.62
减:报告期期间基金总赎回份额	340,212,217.13
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	1,611,667,067.84

§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

§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
2016年1月22日

信诚理财7日盈债券型证券投资基金

【2015】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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2016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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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10月1日起至12月31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	93,290,556.97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
下属分级基金的场内简称	-	-
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	93,290,556.97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10月1日至2015年12月31日)	信诚理财7日盈债券B报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	499,926.98	-
2.本期利润	499,926.98	-
3.期末基金资产净值	93,290,556.97	-

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

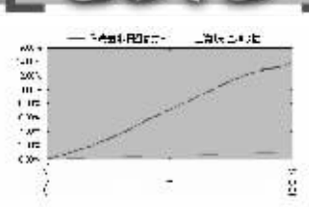
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8222%	0.0205%	0.0882%	0.0000%	0.7340%	0.0205%

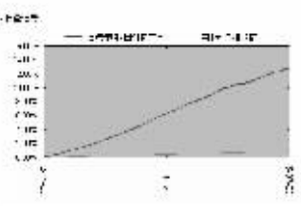
信诚理财7日盈债券B

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
-	-	-	-	-	-	-

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





注:1、本基金建仓日自2012年11月27日至2013年5月27日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自2015年7月28日至2015年12月31日,本基金B级份额为0。

§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,信诚添金分级债券基金、信诚优质纯债债券基金及信诚