信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

【2016】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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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

基金简称	信诚深度价值混合(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	44,365,278.33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。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	上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金,预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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(2016年10月1日至2016年12月31日)
1.本期已实现收益	3,326,616.80
2.本期利润	264,993.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058
4.期末基金资产净值	76,232,231.59
5.期末基金份额净值	1.718

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。

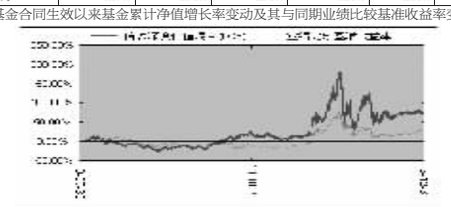
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.17%	0.71%	2.78%	0.56%	-2.61%	0.15%

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。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“上证180指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

§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		
郑伟	本基金基金经理,信诚新兴产业混合基金,信诚中小盘混合基金基金经理	2015年5月29日	-	10	经济学硕士,曾任职于华泰资产管理有限公司,担任研究员。2009年8月加入信诚基金管理有限公司,历任研究员、专户投资经理。现任信诚深度价值混合基金(LOF),信诚新兴产业混合基金和信诚中小盘混合基金基金经理。

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《信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚深度价值混合型证券投资基金(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》,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

四季度市场分化明显,上证指数涨3%左右,而创业板下跌近9%。虽然本基金在配置上做了一定调整,优化了持仓结构,基金净值还是出现了下跌。

从未来一段时间来看,市场面临的不确定性因素在增加,包括国内经济增长的波动、中性稳健的货币政策、特朗普上台带来的中美关系的挑战、美联储加息等,市场运行将处于比较复杂的环境。但有利的方面也很明显,指数的点位不高,回调空间有限;股票整体估值不高,很多股票的投资价值还是比较好的。因此,我们对未来一段时间的市场运行保持谨慎乐观态度。

我们认为,未来一段时间,市场的结构性行情特征会更加明显,我们将优选股票,适度控制股票仓位,将持仓集中于受益于政策和改革的行业,同时从价值投资角度,优选低估值、高分红的股票,力争为持有人创造收益。

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0.17%,同期业绩比较基准收益率为2.78%,基金落后业绩比较基准2.61%。

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	60,536,452.08	78.38
	其中:股票	60,536,452.08	78.38
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	16,624,220.41	21.52
7	其他资产	77,349.30	0.10
8	合计	77,238,021.79	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	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	1,351,284.00	1.77
C	制造业	17,982,458.07	23.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,998,025.00	7.87
E	建筑业	1,141,168.00	1.50
F	批发和零售业	4,086,541.61	5.36
G	交通运输、仓储和邮政业	9,408,979.00	12.34
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	12,587,800.00	16.51
K	房地产业	6,796,611.40	8.92
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	1,183,585.00	1.55
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	60,536,452.08	79.41

5.2.2 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	000811	烟台冰轮	193,605	2,902,138.95	3.81
2	000887	中鼎股份	100,000	2,594,000.00	3.40
3	002053	云南能投	101,548	1,948,706.12	2.56
4	000828	东莞控股	106,200	1,335,996.00	1.75
5	600688	上海石化	200,500	1,291,220.00	1.69
6	600236	桂冠电力	209,500	1,277,950.00	1.68
7	600383	金地集团	98,600	1,277,856.00	1.68
8	601633	长城汽车	114,000	1,260,840.00	1.65
9	000778	新兴铸管	237,100	1,225,807.00	1.61
10	600269	赣粤高速	241,900	1,216,757.00	1.60

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	66,477.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,511.77
5	应收申购款	8,360.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,349.30

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	000887	中鼎股份	2,594,000.00	3.40	重大事项停牌

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

报告期期初基金份额总额	46,817,144.71
报告期期间基金总申购份额	402,206.74
减:报告期期间基金总赎回份额	2,854,073.12
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	44,365,278.33

§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

报告期期初基金份额总额

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
2017年1月20日

信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金

【2016】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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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

基金简称	信诚盛世蓝筹混合
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	76,407,958.63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。
业绩比较基准	中信标普50指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
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(2016年10月1日至2016年12月31日)
1.本期已实现收益	454,126.94
2.本期利润	-572,048.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073
4.期末基金资产净值	188,217,729.78
5.期末基金份额净值	2.463

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。

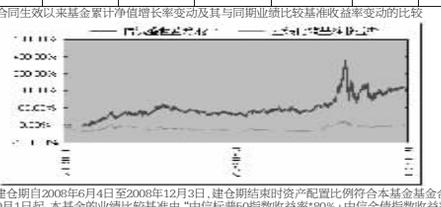
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.28%	0.56%	2.37%	0.58%	-2.65%	-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:1、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。

2、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普50指数收益率*80%+中信全债指数收益率*20%”变更为“中信标普50指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

§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		
聂炜	本基金基金经理,信诚新机遇混合基金(LOF)基金经理	2015年4月30日	-	8	硕士学位,CFA,8年证券、基金从业经验。历任长信基金管理有限公司研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员。2013年4月加入信诚基金管理有限公司,担任高级研究员职务。现任信诚盛世蓝筹混合基金、信诚新机遇混合基金(LOF)基金经理。
吴昊	本基金基金经理,信诚新机遇混合基金(LOF)基金经理	2015年11月18日	-	10	经济学硕士,CFA。10年证券、基金行业经验。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司,担任助理研究员。2010年11月加入信诚基金管理有限公司,担任研究员。现任信诚盛世蓝筹混合基金、信诚新机遇混合基金(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《信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹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

2016年4季度,国内A股市市场先涨后跌,10-11月在保险为主的增量资金推动下,低估值蓝筹品种推动指数上涨,成交量温和放大,而随着11月底保险资金受到监管以及债市去杠杆的影响,市场迎来调整,成交量持续萎缩;期间上证指数上涨3.3%、沪深300指数上涨1.7%,中小板指数下跌4.6%,创业板指数下跌8.7%;结构上PPP叠加保险举牌的建筑、建材板块,以及供给侧改革叠加国企改革的钢铁板块涨幅居前,而传统高估值的小盘成长股计算机、传媒板块,以及受到10月地产新政影响的房地产板块跌幅居前。

四季度,本基金重点增持了银行、券商以及传统消费板块;由于保持了较低的仓位,基金净值表现跑输了业绩基准。

我们认为国内经济增长仍面临较大的压力,政府能主导的财政和基建会有向上弹性,“三去一降”在17年仍会贯彻,而货币政策可能受到通胀和汇率的制约,转向中性偏紧,债市风险暴露后,去杠杆仍会加强。

四季度市场先是迎来保险为首的资金流入,但随着监管加强以及大小非解禁迎来高峰,又转为资金流出,总体看存量博弈的局面仍未打破,日均成交维持较低水平,我们对17年的资金供需保持谨慎。

展望2017年1季度,国内通胀、信贷增速、汇率及外储均有可能冲击市场预期,国外川普正式就职可能带来新的不确定性,在资金面没有看到明显改善前,我们对市场整体偏谨慎,保持较低仓位;结构上我们将均衡配置,结合业绩增长和估值选取确定性较强的优质标的,对于中央经济工作会议提出的农业供给侧改革,我们认为应当给予足够的重视,可能会是一条贯穿2017年的投资线索。

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-0.28%,同期业绩比较基准收益率为2.37%,基金落后业绩比较基准2.65%。

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	137,223,314.02	72.38
	其中:股票	137,223,314.02	72.38
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	24,109,240.05	12.72
7	其他资产	28,254,442.90	14.90
8	合计	189,586,996.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	4,393,516.93	2.33
C	制造业	67,005,130.06	35.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,244,659.66	2.26
E	建筑业	9,617,861.35	5.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,088,514.68	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,854,573.63	1.52
J	金融业	38,017,922.71	20.20
K	房地产业	4,471,793.00	2.38
L	租赁和商务服务业	1,673,982.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,855,360.00	0.99
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	137,223,314.02	72.91

5.2.2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	002659	中泰桥梁	182,300	4,207,484.00	2.24
2	000887	中鼎股份	160,900	4,173,746.00	2.22
3	600109	国金证券	288,600	3,760,458.00	2.00
4	601377	兴业证券	463,900	3,548,835.00	1.89
5	000776	广发证券	206,600	3,483,276.00	1.85
6	600999	招商证券	211,300	3,450,529.00	1.83
7	601009	南京银行	271,700	2,945,228.00	1.56
8	601818	光大银行	741,281	2,898,408.71	1.54
9	601166	兴业银行	177,700	2,868,078.00	1.52
10	601169	北京银行	291,750	2,847,480.00	1.51

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国债期货投资。

5.10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兴业证券股份有限公司于2016年6月12日因公司涉嫌未按规定履行法定职责被中国证监会立案调查;2016年7月8日及27日,公司先后收到中国证监会《行政处罚及市场禁入事先告知书》(处罚字(2016)70号)及《行政处罚决定书》([2016]91号)。经查明,公司在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中,未遵守业务规则和行业规范进行审慎核查,出具文件存在虚假记载。中国证监会决定对公司给予警告,没收保荐业务收入1,200万元,并处以2,400万元罚款;没收承销股票违法所得 2,078万元,并处以 60万元罚款。

5.11.2对兴业证券的投资决策程序的说明:兴业证券处罚系投行业务违规,预计影响公司投行业务1年左右,公司已于7月公告该事项,市场已对该处罚带来的影响作出反应,从我们买入的时点来看,公司估值在券商板块仍具备吸引力,故做出买入决策。

5.11.3广发证券股份有限公司于2016年11月28日发布公告称,公司于2016年11月 26日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]128号)。经查明,广发证券未按照规定对客户的身份信息进行审查和了解,并在2015年7月12日中国证监会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》(证监会公告[2015]19号)之后仍未采取有效措施。中国证监会依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,决定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

5.11.4对广发证券的投资决策程序的说明:广发证券处罚系2015年客户拨入HOMES审查不严,2015年市场对该处罚已有预期,该项业务也已暂停,且处罚金额相对公司体量较小,因此不影响公司长期价值,从我们买入的时点来看,公司估值在券商板块仍具备吸引力,故做出买入决策。

5.11.5 除此之外,其余本基金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。

5.11.6 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。

5.11.7 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	119,778.73
2	应收证券清算款	28,119,748.06
3	应收股利	-
4	应收利息	10,274.08
5	应收申购款	4,642.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,254,442.90

5.11.8 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。

5.11.9 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	002659	中泰桥梁	4,207,484.00	2.24	筹划重大事项
2	000887	中鼎股份	4,173,746.00	2.22	重大资产重组

5.11.10 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	78,662,369.90
报告期期间基金总申购份额	3,708,292.26
减:报告期期间基金总赎回份额	5,962,703.53
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	76,407,958.63

§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

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本资金。

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

无

§9 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、(原)信诚盛世蓝筹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、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金基金合同
4、信诚盛世蓝筹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

10.2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。

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1月20日

信诚三得益债券型证券投资基金

【2016】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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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2017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	3,005,672,920.69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	中证综合债指数收益率*80%+一年期银行定期存款收益率(税后)*20%
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
下属分级基金的基金简称	信诚三得益债券A 信诚三得益债券B
下属分级基金的交易代码	550004 550005
报告期末下属分级基金的份额总额	301,628,371.71份 2,704,044,548.98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	信诚三得益债券A报告期(2016年10月1日至2016年12月31日)	信诚三得益债券B报告期(2016年10月1日至2016年12月31日)
1.本期已实现收益	2,659,660.52	7,219,462.06
2.本期利润	-1,454,931.93	-23,454,195.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0064	-0.0158
4.期末基金资产净值	313,015,437.23	2,761,561,193.17
5.期末基金份额净值	1.038	1.021

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
过去三个月	0.94%	0.25%	-1.05%	0.10%