信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	信诚新鑫混合	
基金主代码	001494	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月29日	
报告期末基金份额总额	1,608,511,094.66份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。	
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。 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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚新鑫混合A	信诚新鑫混合B
下属分级基金的交易代码	001494	002047
报告期末下属分级基金的份额总额	7,928,612.07份	1,600,582,482.59份

注:自2015年11月16日起本基金基金份额分为不同的类别,基金份额类别包括A类和B类。详见本基金管理人于2015年11月14日发布的公告。

§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	信诚新鑫混合A报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	信诚新鑫混合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	45,360.12	1,796,850.13
2.本期利润	19,892.03	5,134,512.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0019	0.0022
4.期末基金资产净值	11,182,749.12	1,605,716,420.10
5.期末基金份额净值	1.410	1.003

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

信诚新鑫混合A

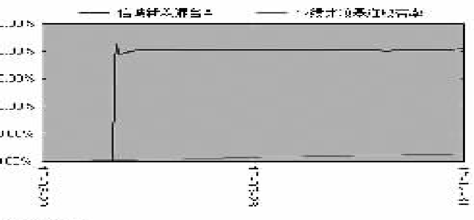
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.21%	0.04%	1.15%	0.01%	-0.94%	0.03%

信诚新鑫混合B

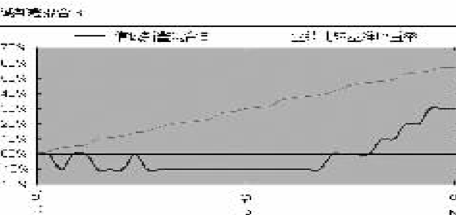
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年11月16日至2015年12月31日	0.30%	0.05%	0.57%	0.01%	-0.27%	0.04%

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

信诚新鑫混合A



信诚新鑫混合B



注: 1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2015年6月29日),本基金于2015年11月16日起新增B类份额。
2.本基金建仓期自2015年6月29日至2015年12月29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

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		
王旭巍	本基金基金经理、信诚添金分级债券基金和信诚增强收益债券基金(LOF)、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金、信诚薪金宝货币市场基金的基金经理,信诚基金管理有限公司副首席投资官	2015年6月29日	-	22	经济学硕士,22年金融、证券、基金行业从业经验。曾先后任职于中国(深圳)物资工贸集团有限公司大连期货部、宏达期货经纪有限公司、中信证券资产管理部和华宝兴业基金管理有限公司。2010年加盟信诚基金管理有限公司,现任公司副首席投资官、兼信诚增强收益债券型基金、信诚添金分级债券基金、信诚新双盈分级债券基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金、信诚薪金宝货币市场基金的基金经理。
杨立春	本基金基金经理,信诚双盈债券基金(LOF)、信诚新双盈分级债券基金的基金经理	2015年6月29日	-	4	复旦大学经济学博士。2005年7月至2011年6月期间于江苏省社会科学院担任助理研究员,从事产业经济和宏观经济研究工作。2011年7月加入信诚基金管理有限公司,担任固定收益分析师。现任信诚双盈债券基金(LOF)、信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置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《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚新鑫回报灵活配置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

在经历了连续两年的债券大牛市之后,各债券品种收益率已基本处于历史低位。在中国经济处于动能转换、新旧交替时期,经济增长乏力的基本面不会改变。展望2016年,中央经济工作会议确定了"去产能"的基调,在经济调结构、清理过剩产能的主旋律下,经济增长的内生增长动力不强,宏观经济低位运行乃至下滑为债牛提供了坚实基础。与此同时CPI仍面临进一步下行的压力,预计央行仍将维持宽松的货币政策,引导货币市场利率下行,从而为收益率曲线下移腾出空间。优质资产普遍匮乏的背景下,金融机构资产配置压力开始显现,总体上看支撑债市的中期因素未发生改变。

针对当前的市场格局,结合基金合同要求,本基金在基本仓位上以债券投资为主,在四季度股市IPO重启之后,本基金在配置股票资产底仓后参与了网下打新,谋取低风险收益。债券配置方面,增持了国债和中高等级信用债,同时通过分散化投资和加大信用风险筛查力度,规避信用违约风险。

我们认为2016年债市维持牛市的概率较大,但几大风险点将成为影响债市走势的重要因素,从而加大市场波动。一是汇率风险,2016年美联储多次加息为大概率事件,美国10年期国债收益率上升将导致中美利差不断缩窄甚至有可能倒挂,资本流出压力仍然存在,汇率风险上升短期内仍是利率进一步宽松的重大制约;二是信用风险,随着去产能进程的继续,信用风险将成为债市最为担忧的风险点;三是货币宽松边际收紧的风险,无论是资本流出,还是基本面好于预期,都可能导致流动性宽松程度低于预期,进而加大市场波动,或抑制债市收益率下行空间。

基于债券牛市和信用风险加大的基本判断,2016年我们将重点投资高评级产业债和优质城投债,采取票息和适度杠杆息差操作,规避评级较低、产能过剩行业的品种,通过精细化信用分析,谨慎甄选投资标的,保障基金净值的稳定增长。对于利率债,本基金将重点关注长久期国债的波段性交易机会;对于权益类资产,我们仍将积极参与一级市场的新股和转债网下申购,对二级市场投资保持谨慎。

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0.21%、0.30%,同期业绩比较基准收益率分别为1.15%、0.57%,基金A、B份额落后业绩比较基准分别为0.94%、0.27%。

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,本基金自2015年7月29日起至2015年11月16日止基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§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	10,968,983.96	0.68
	其中:股票	10,968,983.96	0.68
2	固定收益投资	105,736,876.60	6.53
	其中:债券	105,736,876.60	6.53
	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	1,498,617,314.50	92.52
7	其他资产	4,459,779.75	0.28
8	合计	1,619,782,954.81	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	7,046,750.93	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,002,328.20	0.06
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	2,588,208.18	0.16
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	109,392.21	0.01
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	10,968,983.96	0.68

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	600418	江淮汽车	210,000	3,063,900.00	0.19
2	000650	仁和药业	200,000	2,114,000.00	0.13
3	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.07
4	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.06
5	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.05
6	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.03
7	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.02
8	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.02
9	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.02
10	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.01

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	98,800,000.00	6.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,107,651.60	0.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,829,225.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,736,876.60	6.54

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	020081	15贴债07	1,000,000	98,800,000.00	6.11
2	132005	15国资EB	10,000	1,149,400.00	0.07
3	112232	14长证债	10,000	1,053,600.00	0.07
4	122310	13苏新城	8,000	917,200.00	0.06
5	122607	PR渝地产	10,000	860,300.00	0.05

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
本基金本报告期末未持有股指期货。
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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。
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 长江证券于2015年6月12日发布公告,公司因未与部分研究报告转载机构签订协议,违反了《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十一条的相关规定,公司部分研究报告的报送审核人员和对外发送渠道不符合公司内部规定,公司内控制度执行不严格,未能及时识别和防范业务风险,故收到证监会出示警示函的行政监管措施。对14长证债的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,我们认为,上述处罚事项对长江证券的现金流状况和盈利能力影响较小,公司的信用资质不会因此出现明显恶化,在债券存续期内未对本期债券的投资价值产生实质性影响。此外,信诚新鑫回报混合基金对于14长证债的投资权重仅为0.06%,我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
除此之外,其余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	126,141.09
2	应收证券清算款	2,640,876.88
3	应收股利	-
4	应收利息	1,682,850.63
5	应收申购款	9,911.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,459,779.75

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的说明。
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	信诚新鑫混合A	信诚新鑫混合B
报告期期初基金份额总额	14,833,595.09	-
报告期期间基金总申购份额	2,772,322.14	2,500,582,482.59
减:报告期期间基金总赎回份额	9,677,305.16	900,000,000.00
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	7,928,612.07	1,600,582,482.59

§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

项目	信诚新鑫混合A	-
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	4,278,887.30	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,278,887.30	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	53.97	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
上表所述交易单笔金额超过500万,适用申购费率为1000元/笔。

§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》等相关法律法规及《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,为更好的满足广大投资人的理财要求,本基金管理人经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,决定于2015年11月16日起对本基金增加收取销售服务费的B类份额(基金代码:002047),并对本基金的基金合同作相应修改。详见本基金管理人于2015年11月14日发布的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚新鑫回报灵活配置混合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、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同
4、信诚新鑫回报灵活配置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

信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	信诚新选混合	
基金主代码	001402	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月5日	
报告期末基金份额总额	2,474,399,281.35份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。	
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。 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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚新选混合A	信诚新选混合B
下属分级基金的交易代码	001402	002030
报告期末下属分级基金的份额总额	154,257,801.67份	2,320,141,479.68份

注:自2015年11月16日起本基金基金份额分为不同的类别,基金份额类别包括A类和B类。详见本基金管理人于2015年11月14日发布的公告。

§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	信诚新选混合A报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	信诚新选混合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	2,978,223.72	3,498,415.95
2.本期利润	4,472,473.00	9,037,010.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0286	0.0042
4.期末基金资产净值	157,845,283.13	2,329,066,724.46
5.期末基金份额净值	1.023	1.004

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

信诚新选混合A

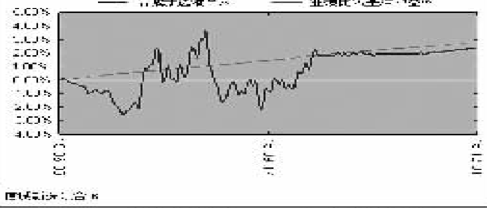
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.81%	0.22%	1.15%	0.01%	1.66%	0.21%

信诚新选混合B

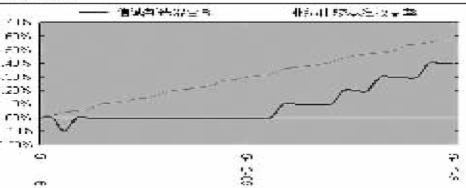
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年11月16日至2015年12月31日	0.40%	0.04%	0.57%	0.01%	-0.17%	0.03%

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

信诚新选混合A



信诚新选混合B



注: 1.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2015年6月5日),本基金于2015年11月16日起新增B类份额。
2.本基金建仓期自2015年6月5日至2015年12月5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

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		
杨旭	本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年6月5日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methods公司数量分析师,华尔街对冲基金WSFA Group公司助理基金经理,该基金为股票多空型对冲基金。2012年8月加入信诚基金,曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理。

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《信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚新选回报灵活配置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

过去一个季度,首先经济层面上,实体经济继续没有形成可被加杠杆的资产,政府从过去改善需求端的产能输出政策转化为产能兼并整合的供给侧改革政策,经济上时间换空间不可避免,经济需要货币继续宽松调结构。其次政策面上,IPO的开启,券商解禁减持,看出政府延续上半年对资本市场的思路,即建立资本市场给高新企业融资,给经济转型提供所需资金,而股市的走势会被高度监管。再次从资金面,利率继续向下行,中美国债息差制约国内利率下行空间,叠加明年继续缺少资产与资本管制,市场出现低利率,低增长,低回报的环境。对A股市场,从市场角度看,指数到了筹码密集区,在缺乏增量资金的情况下,指数向上的空间有限,但向下又有流动性脱底,加上内外政策与国内外市场的不确定性,导致市场波动变大;整体上四季度A股震荡向上,指数向上空间有限与板块和主题机会出现的局面。在本报告期内,我们继续采用低风险操作思路。

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2.81%、0.40%,同期业绩比较基准收益率分别为1.15%、0.57%,基金A份额超越业绩比较基准1.66%,基金B份额落后业绩比较基准0.17%。

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	31,929,876.24	1.28
	其中:股票	31,929,876.24	1.28
2	固定收益投资	190,301,380.10	7.64
	其中:债券	190,301,380.10	7.64
	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	990,001,440.00	39.77
	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	1,272,400,799.59	51.11
7	其他资产	4,921,804.72	0.20
8	合计	2,489,555,300.65	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	986,259.00	0.04
B	采矿业	1,232,677.00	0.05
C	制造业	11,229,244.62	0.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,698,557.40	0.15
E	建筑业	1,248,954.20	0.05
F	批发和零售业	1,613,437.44	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	4,998,012.79	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.10
J	金融业	1,609,368.00	0.06
K	房地产业	1,322,553.00	0.05
L	租赁和商务服务业	447,928.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	-
N	水利、环境和公共设施管理业	450,560.00	0.02
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	394,724.40	0.02
S	综合	-	-
	合计	31,929,876.24	1.28

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	600896	中海海盛	170,087	2,750,306.79	0.11
2	000543	皖能电力	151,570	1,283,797.90	0.05
3	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.05
4	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.04
5	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03
6	000002	万科A	30,700	750,001.00	0.03
7	000651	格力电器	23,800	531,930.00	0.02
8	000869	张裕A	11,400	521,892.00	0.02
9	603696	安记食品	9,278	513,722.86	0.02
10	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02

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	130,021,000.00	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,462,378.30	0.70
5	企业短期融资券	40,158,000.00	1.61
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,660,001.80	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	190,301,380.10	7.65

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	150027	15附息国债27	700,000	70,063,000.00	2.82
2	150018	15附息国债18	600,000	59,958,000.00	2.41
3	041558042	15中建安工CP001	100,000	10,055,000.00	0.40
4	011599747	15巨石SCP005	100,000	10,041,000.00	0.40
5	011599692	15陕延油SCP003	100,000	10,038,000.00	0.40

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
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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。
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	452,355.84
2	应收证券清算款	2,137,260.58
3	应收股利	-
4	应收利息	2,332,188.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,921,804.72

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	000002	万科A	750,001.00	0.03	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

项目	信诚新选混合A	信诚新选混合B
报告期期初基金份额总额	158,757,572.99	-
报告期期间基金总申购份额	55,725.13	2,330,151,489.69
减:报告期期间基金总赎回份额	4,555,496.45	10,010,010.01
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	154,257,801.67	2,320,141,479.68

§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

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》等相关法律法规及《信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,为更好的满足广大投资人的理财要求,本基金管理人经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,决定于2015年11月16日起对本基金增加收取销售服务费的B类份额(基金代码:002030),并对本基金的基金合同作相应修改。详见本基金管理人于2015年11月14日发布的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚新选回报灵活配置混合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、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同
4、信诚新选回报灵活配置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

信诚中证基建工程指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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: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	信诚中证基建工程指数分级		
场内简称	基建工程		
基金主代码	165525		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月6日		
报告期末基金份额总额	41,599,450.09份		
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,实现对中证基建工程指数的有效跟踪,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%×中证基建工程指数收益率+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。		
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	信诚中证基建工程指数分级A	信诚中证基建工程指数分级B	信诚中证基建工程指数分级
下属分级基金的场内简称	基建A	基建B	基建工程
下属分级基金的交易代码	150313	150314	165525
报告期末下属分级基金的份额总额	1,845,135.00份	1,845,136.00份	37,909,179.09份
下属分级基金的风险收益特征	基建A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	信诚基建B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。	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,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。

§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	-150,317.62
2.本期利润	-150,317.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0031
4.期末基金资产净值	41,099,051.91
5.期末基金份额净值	0.988

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。

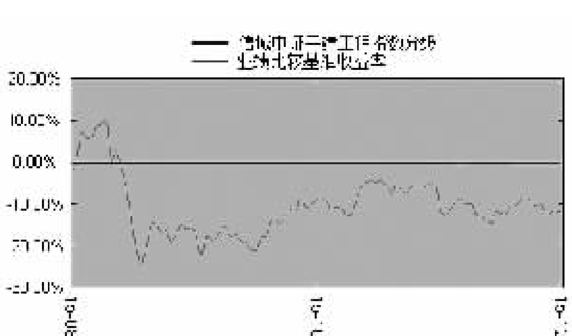
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.37%	0.03%	10.86%	1.84%	-11.23%	-1.81%

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.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2015年8月6日)。
2.本基金建仓期自2015年8月6日至2016年2月6日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
杨旭	本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证智能家居指数分级基金的基金经理	2015年6月26日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methods公司数量分析师,华尔街对冲基金WSFA Group公司助理基金经理,该基金为股票多空型对冲基金。2012年8月加入信诚基金,曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理。

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《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证基建工程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

过去一个季度,首先经济层面上,实体经济继续没有形成可被加杠杆的资产,政府从过去改善需求端的产能输出政策转化为产能兼并整合的供给侧改革政策,经济上时间换空间不可避免,经济需要货币继续宽松调结构。其次政策面上,IPO的开启,券商解禁减持,看出政府延续上半年对资本市场的思路,即建立资本市场给高新企业融资,给经济转型提供所需资金,而股市的走势会被高度监管。再次从资金面,利率继续向下行,中美国债息差制约国内利率下行空间,叠加明年继续缺少资产与资本管制,市场出现低利率,低增长,低回报的环境。对A股市场,从市场角度看,指数到了筹码密集区,在缺乏增量资金的情况下,指数向上的空间有限,但向下又有流动性脱底,加上内外政策与国内外市场的不确定性,导致市场波动变大;整体上四季度A股震荡向上,指数向上空间有限与板块和主题机会出现的局面。在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中,有效地管理跟踪误差。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。

基建工程:截至本报告期末,本基金份额净值增长率为-0.37%,同期业绩比较基准收益率为10.86%。报告期内,本基金日均跟踪误差为1.34%,年化跟踪误差为29.25%。

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-0.37%,同期业绩比较基准收益率为10.86%,基金落后业绩比较基准11.23%。

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	-	-
	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	20,000,000.00	48.31
	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	21,384,863.45	51.65
7	其他资产	18,618.16	0.04
8	合计	41,403,481.61	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股票投资组合
本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
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
本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
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
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,618.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,618.16

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
本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
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
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
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	信诚中证基建工程指数分级A	信诚中证基建工程指数分级B	信诚中证基建工程指数分级
报告期期初基金份额总额	2,271,153.00	2,271,154.00	56,476,983.63
报告期期间基金总申购份额	-	-	91,050.91
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	19,865,684.11
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-426,018.00	-426,018.00	1,206,828.66
报告期期末基金份额总额	1,845,135.00	1,845,136.00	37,909,179.09

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《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚基金关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的提示性公告》、《信诚基金关于信诚中证基建工程指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告》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2015年12月4日(折算基准日)对本基金进行了基金份额定期份额折算。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基建工程份额354,792.66份。

§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

项目	信诚中证基建工程指数分级A	信诚中证基建工程指数分级B	信诚中证基建工程指数分级
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	20,017,900.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-	167,557.51
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	20,185,457.51
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	-	0.53

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	-	2015-12-07	167,557.51	-	-
合计			167,557.51	-	

§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、信诚中证基建工程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、信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同
4、信诚中证基建工程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--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