信诚四季红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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	信诚四季红混合	
基金主代码	550001	
交易代码	550001	551001
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年4月29日	
报告期末基金份额总额	942,474,290.46份	
投资目标	在有效配置资产的基础上,精选投资标的,追求在稳定分红的基础上,实现基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金在充分借鉴美国保诚集团的资产配置理念和方法的基础上,建立了适合国内市场的资产配置体系。本基金的资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA),战略性资产配置(SAA)额决定投资组合中股票、债券和现金各自的长期均衡比重,按照本基金的风险偏好以及对资本市场各大类资产在长期均衡状态下的期望回报率假定而作出,战术性资产配置(TAA)是本基金资产配置的核心,是指依据特定市场情况对在一定时段持有某类资产的预期回报作出预测,并围绕基金资产的战略性资产配置基准,进行相应的短中期资产配置的过程。	
业绩比较基准	62.5%×新华富时全A指数收益率+32.5%×中证国债指数收益率+5%×金融同业存款利率	
风险收益特征	作为一只混合型基金,本基金的资产配置中线(股票62.5%,债券32.5%)确立了本基金在平衡型基金中的中等风险定位,因此本基金在证券投资基金中属于中等风险。同时,通过严谨的研究和稳健的操作,本基金力争在严格控制风险的前提下谋求基金资产的中长期稳定增值。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

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"新华富时全A指数收益率*62.5%+中信国债指数收益率*32.5%+金融同业存款利率*5%"变更为"新华富时全A指数收益率*62.5%+中证国债指数收益率*32.5%+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	34,058,874.43
2.本期利润	258,484,496.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.2592
4.期末基金资产净值	1,185,258,282.83
5.期末基金份额净值	1.2576

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。

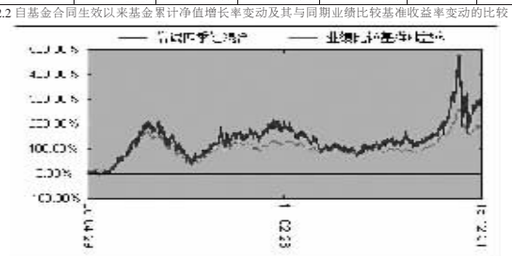
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	25.02%	1.49%	14.95%	1.10%	10.07%	0.39%

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4月29日至2006年10月28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"富时中国全A指数收益率*62.5%+中信国债指数收益率*32.5%+金融同业存款利率*5%"变更为"富时中国全A指数收益率*62.5%+中证国债指数收益率*32.5%+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		
阎志刚	本基金基金经理	2010年5月25日	-	14	清华大学MBA,14年证券、基金从业经验,曾先后在世纪证券、平安证券、平安资产管理有限公司从事投资研究工作。2008年加盟信诚基金管理有限公司,曾担任保诚韩国中国龙A股基金(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),现任信诚四季红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《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》、《信诚四季红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

四季度,在证金公司入场防止市场出现系统性风险之后,市场出现了一轮力度较大的反弹,中小板和创业板反弹幅度高于沪深主板,其中诸多主题类个股创出了新高。在经济下行、利率下调的宽松环境中,市场的投资主线依然延续转型加成长的逻辑,不过,由于经济基本面下行,基于盈利驱动的成长逻辑遭到了抛弃,转型和基于很难准确把握的新兴产业成长的预期炒作成为市场追逐的热点。

在本季度,经过三季度的深度调整,部分优质成长股已经体现出其合理价值,因此,在十月份本组合参与了本次反弹,十月份的组合表现尚可;但在十月份末期,由于中小板和创业板的估值水平又呈泡沫,本组合降低了仓位,以致十一月的组合业绩表现不佳;十二月份市场处于区间震荡之中,结构性机会尚存,本月组合表现领先于绝大多数指数。在整个四季度的操作中,十一月份操作的失败之处主要在于对中小创高估值的谨慎,过早地降低了中小创股票的仓位,这源于这样两个方面的认识:一是认为经过三季度的深度调整后,市场的风险偏好会降低;二是中小创的估值泡沫难以持续,稳健投资应成为投资管理人牢记的重要原则;但出乎意料的是,存量市场中留下的是一群高风险偏好者,他们对高估值的容忍限度和存量博弈的程度超出了我的经验和判断,这值得我学习和总结,以便后续能更好地应对这复杂多变的市场。

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25.02%,同期业绩比较基准收益率为14.95%,基金超越业绩比较基准10.07%。

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	731,543,677.81	58.68
	其中:股票	731,543,677.81	58.68
2	固定收益投资	100.00	0.00
	其中:债券	100.00	0.00
	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	512,580,817.45	41.12
7	其他资产	2,444,543.39	0.20
8	合计	1,246,569,138.65	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	586,586,479.89	49.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,362,000.00	1.63
E	建筑业	5,368,000.00	0.45
F	批发和零售业	43,641,517.99	3.68
G	交通运输、仓储和邮政业	12,199,939.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,386,520.93	4.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,999,220.00	1.43
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	-	-
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	731,543,677.81	61.72

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	601126	四方股份	3,650,000	48,472,000.00	4.09
2	300017	网宿科技	789,907	47,386,520.93	4.00
3	002123	梦百合家居	1,749,991	44,887,269.15	3.79
4	600422	昆药集团	1,099,964	43,800,566.48	3.70
5	002444	巨星科技	1,980,000	40,986,000.00	3.46
6	002172	澳洋科技	2,699,822	40,173,351.36	3.39
7	300458	全志科技	314,906	37,473,814.00	3.16
8	600351	亚宝药业	2,349,927	36,705,859.74	3.10
9	002241	歌尔声学	1,059,924	36,673,370.40	3.09
10	002355	兴民钢缆	1,750,000	35,105,000.00	2.96

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	100.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100.00	0.00

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	123001	蓝标转债	1	100.00	-

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	1,788,134.63
2	应收证券清算款	301,251.29
3	应收股利	-
4	应收利息	101,582.23
5	应收申购款	253,575.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,444,543.39

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
本基金本报告期末股票中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

报告期期初基金份额总额	1,043,691,285.86
报告期期间基金总申购份额	22,347,063.90
减:报告期期间基金总赎回份额	123,564,059.30
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	942,474,290.46

§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

1.信诚四季红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.信诚四季红混合型证券投资基金合同
4.信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书
5.本报告期内按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

信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)

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	信诚新机遇混合(LOF)
场内简称	信诚机遇
基金主代码	165512
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
报告期末基金份额总额	14,564,791.08份
投资目标	本基金力求前瞻性地把握中国经济发展过程中涌现的新机遇,精选受益其中的优势行业和个股,在严格控制风险并充分保证流动性的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金关注的"新机遇"是指中国经济发展过程中涌现的投资机遇。本基金将从新机遇挖掘、行业的新机遇受益状况分析、个股精选三个层面构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。
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"沪深300指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%"变更为"沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%"。

§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	3,325,366.34
2.本期利润	8,664,805.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.5757
4.期末基金资产净值	34,772,582.28
5.期末基金份额净值	2.387

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。

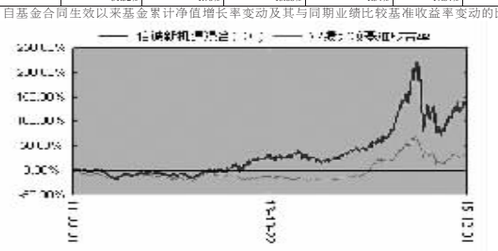
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	31.52%	1.70%	13.68%	1.34%	17.84%	0.36%

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、本基金建仓日自2011年8月1日至2012年1月31日,建仓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"沪深300指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%"变更为"沪深300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		
聂桦	本基金基金经理、信诚盛世蓝筹混合基金基金经理	2014年9月15日	-	7	硕士学位,CFA,7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	-	9	硕士学位,9年证券、基金行业经验。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理研究员、信诚基金管理有限公司股票研究员,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《信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚新机遇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

2015年4季度,国内迎来一次降息、降准。市场在经历3季度的调整后,出现较大幅度的反弹,上证指数上涨16%,沪深300指数上涨16%,中小板指数上涨24%,创业板指数上涨30%;11月中旬开始,随着IPO恢复以及美国加息,市场进入震荡整理。结构上,电子、房地产、计算机、通信涨幅居前,建筑建材、银行、国防军工、交通运输、钢铁涨幅较小。

四季度,本基金重点增持了机械设备、房地产、化工等行业,基金净值表现跑赢了业绩基准。

目前国内经济仍未见起色,政府坚定推动供给侧改革可能短期带来压力,但长期利于经济转型发展;人民币相对美元贬值压力增加,国债收益率持续下行,使得2016年货币政策的宽松余地缩减,美国步入加息周期对全球经济和资金流向的影响需要密切关注。2016年伊始,市场波动加剧遭遇2次全天熔断,展望全年我们仍将警惕市场系统性风险,美国进入加息周期、注册制推行和限售股解禁,都会增加市场的不确定性;结构上围绕供给侧改革和新型消费升级,代表未来中国经济转型升级方向的板块,如云计算、现代服务业、先进制造业在其资本化过程中仍将实现超额收益。我们将继续从中选取优质标的,为投资者赚取收益

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31.52%,同期业绩比较基准收益率为13.68%,基金超越业绩比较基准17.84%。

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6月26日起至2015年12月31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	30,047,690.00	84.10
	其中:股票	30,047,690.00	84.10
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	5,588,196.53	15.64
7	其他资产	93,301.55	0.26
8	合计	35,729,188.08	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	1,499,754.00	4.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,432,383.00	55.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,291,600.00	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	869,400.00	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,307,094.00	12.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,661,809.00	4.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	758,650.00	2.18
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	227,000.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	30,047,690.00	86.41

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	002226	江南化工	146,300	1,321,089.00	3.80
2	002632	道明光学	45,000	1,184,850.00	3.41
3	600718	东软集团	37,000	1,148,850.00	3.30
4	002421	达实智能	44,000	963,600.00	2.77
5	600467	好当家	86,700	920,754.00	2.65
6	002513	蓝丰生化	45,000	877,050.00	2.52
7	603167	渤海轮渡	70,000	869,400.00	2.50
8	000633	合金投资	58,000	850,280.00	2.45
9	600203	福日电子	60,000	822,600.00	2.37
10	300201	海伦哲	40,000	801,200.00	2.30

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。

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。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

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 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	37,324.53
2	应收证券清算款	54,610.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,168.90
5	应收申购款	197.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,301.55

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
本基金报告期末股票中不存在流通受限的情况。

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	15,289,681.89
报告期期间基金总申购份额	447,749.99
减:报告期期间基金总赎回份额	1,172,640.80
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	14,564,791.08

§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

1.信诚新机遇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.信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)基金合同
4.信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)招募说明书
5.本报告期内按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

信诚添金分级债券型证券投资基金

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: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	信诚添金分级债券	
基金主代码	550017	
基金运作方式	契约型,本基金以"整作周年滚动"的方式运作。季季添金自基金合同生效日起每3个月开放申购和赎回一次,岁岁添金在任一运作周年内封闭运作,仅在每个运作周年到期日开放申购和赎回一次,每次开放仅开放一个工作日。	
基金合同生效日	2012年12月12日	
报告期末基金份额总额	708,313,635.65份	
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争追求超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金投资组合中债券、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。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
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	信诚季季添金	信诚岁岁添金
下属分级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属分级基金的份额总额	495,809,921.01份	212,503,714.64份
下属分级基金的风险收益特征	季季添金份额为低风险、收益相对稳定的基金份额	岁岁添金份额为中高风险、中高收益的基金份额

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"中信标普全债指数收益率"变更为"中证综合债指数收益率"。

§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	7,819,781.66
2.本期利润	19,034,005.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0358
4.期末基金资产净值	713,337,759.60
5.期末基金份额净值	1.007

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。

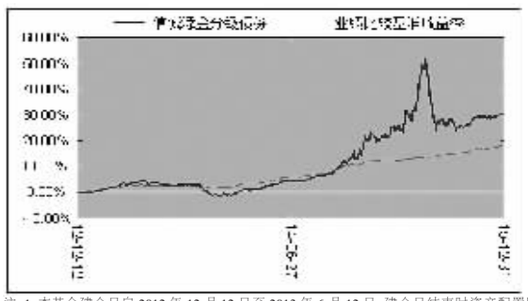
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	3.48%	0.17%	2.41%	0.06%	1.07%	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:1、本基金建仓日自2012年12月12日至2013年6月12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10月1日起,本基金的业绩比较基准由"中信标普全债指数收益率"变更为"中证综合债指数收益率"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理