信诚新兴产业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	信诚新兴产业混合
基金主代码	000209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月17日
报告期末基金份额总额	16,883,230.98份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于新兴产业的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金在大类资产配置过程中,将优先考虑对于股票类资产的配置,在采取精选策略构造股票组合的基础上,将剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产上。 2.股票投资策略 (1)行业配置策略 本基金的行业配置,首先是基于以上对新兴产业的定义确定属于新兴产业的行业,并且,随着技术和经济的发展动态调整新兴产业的范围。本基金将研究社会发展趋势、经济发展趋势、科学技术发展趋势、消费者需求变化趋势,根据行业景气状况、新兴技术、新兴生产模式以及新兴商业模式等的成熟度,在充分考虑估值的原则下,实现不同行业的资产配置。重点配置于那些核心技术和模式适宜于大规模生产、产品符合市场趋势变化、具有较强带动作用、得到国家政策支持并且估值合理的子行业。 (2)个股精选策略 本基金在进行新兴产业相关行业个股筛选时,主要从定性和定量两个角度对行业内上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司。 3.债券投资策略 本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。 4.权证投资策略 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,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。 5.股指期货投资策略 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。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*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"中证新兴产业指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%"变更为"中证新兴产业指数收益率*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	6,247,424.45
2.本期利润	13,410,110.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.7801
4.期末基金资产净值	38,817,360.27
5.期末基金份额净值	2.299

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。

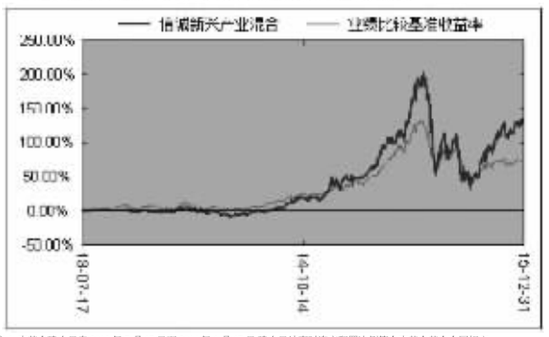
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.7370%	0.0019%	0.0882%	0.0000%	0.6488%	0.0019%

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2013年7月17日至2014年1月17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"中证新兴产业指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%"变更为"中证新兴产业指数收益率*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、信诚深度价值混合基金(LOF)、信诚中小盘混合基金基金经理	2013年8月16日	-	10	2005年9月至2009年8月期间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,先后担任股票研究员及特定客户资产管理业务的投资经理职务;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《信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同》、《信诚新兴产业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,本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

经历了股灾的市场在9月底触底,随后出现反弹。整个4季度上证指数上涨15.9%,创业板指数上涨30.3%,其间指数大幅震荡,市场结构性行情特征明显。在这一轮反弹行情中,热点不多,只有少数股票表现较好。本基金及时预判反弹行情,并在3季度末调整了行业组合,增加了军工、传媒、计算机等行业的配置,在4季度反弹中净值表现较好。

年末市场的反弹一定程度上是对股灾其间过于悲观预期的修复,实际上来看,各领域的改革仍在深化、国内经济的转型仍在持续推进、上市公司的创新业务也出现了新的投资热点,同时流动性依然比较宽松,"资产荒"的特点明显,这些在中长期都是市场向好的基础。同时,我们也看到,注册制的推进在加快、美国加息的影响还是存在、市场对大小非减持解禁担忧增加等,这些因素使得国内资本进入压力测试期。市场短期可能还是处于震荡的格局当中,但中长期看,我们对市场还是充满信心。

我们看好计算机、传媒、军工、工业4.0、医疗服务、大消费等行业的投资机会,将积极研究和挖掘这些行业中好的投资标的,争取持续为持有人创造收益。

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50.75%,同期业绩比较基准收益率为16.20%,基金超越业绩比较基准34.55%。

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30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	35,034,116.52	88.38
	其中:股票	35,034,116.52	88.38
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	4,146,063.85	10.46
7	其他资产	461,164.71	1.16
8	合计	39,641,345.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	568,030.00	1.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,769,154.00	50.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,298,580.00	3.35
F	批发和零售业	337,680.00	0.87
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	6,739,512.52	17.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,619,400.00	4.17
L	租赁和商务服务业	510,000.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	688,520.00	1.77
N	水利、环境和公共设施管理业	680,160.00	1.75
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	2,823,080.00	7.27
S	综合	-	-
	合计	35,034,116.52	90.25

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	002123	荣信股份	66,000	1,692,900.00	4.36
2	300083	劲胜精密	29,000	1,372,280.00	3.54
3	002137	麦达数字	54,925	1,263,275.00	3.25
4	002467	二六三	60,000	1,259,400.00	3.24
5	002188	新嘉联	28,000	1,244,600.00	3.21
6	300095	华伍股份	80,000	1,213,600.00	3.13
7	600990	四创电子	14,500	1,198,135.00	3.09
8	300299	富春通信	25,000	1,176,750.00	3.03
9	600351	亚宝药业	75,000	1,171,500.00	3.02
10	002172	澳洋科技	72,100	1,072,848.00	2.76

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投资。

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投资。

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。

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	27,267.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	889.44
5	应收申购款	433,007.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	461,164.71

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	600990	四创电子	1,198,135.00	3.09	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	17,186,633.10
报告期期间基金总申购份额	7,699,969.48
减:报告期期间基金总赎回份额	8,003,371.60
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	16,883,230.98

§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.(原)信诚新兴产业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.信诚新兴产业混合型证券投资基金基金合同 4.信诚新兴产业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

信诚薪金宝货币市场基金

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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	信诚薪金宝货币
基金主代码	000599
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
报告期末基金份额总额	13,941,716,792.80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,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	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	106,992,226.61
2.本期利润	106,992,226.61
3.期末基金资产净值	13,941,716,792.80

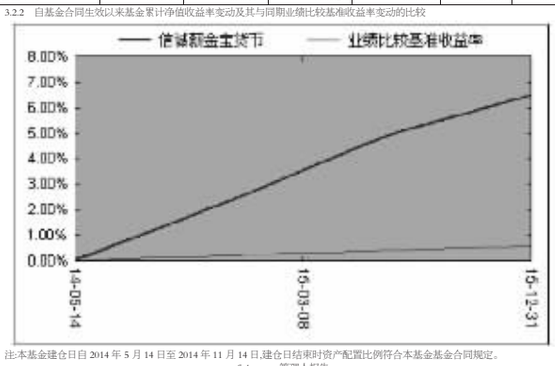
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

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	0.7370%	0.0019%	0.0882%	0.0000%	0.6488%	0.0019%

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



注:本基金建仓日自2014年5月14日至2014年11月14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新双盈分级债券基金、信诚薪锐回报灵活配置混合基金、信诚薪鑫回报灵活配置混合基金、信诚增强收益债券型(LOF)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9月9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(LOF)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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚薪金宝货币市场基金基金合同》、《信诚薪金宝货币市场基金招募说明书》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;对于对权益资产,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,本基金份额净值增长率为5.31%,同期业绩比较基准收益率为2.41%,基金超越业绩比较基准2.90%。

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	固定收益投资	3,405,077,798.04	23.50
	其中:债券	3,405,077,798.04	23.50
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,655,327,942.99	11.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	9,292,564,540.18	64.14
4	其他资产	135,540,769.07	0.94
5	合计	14,488,511,050.28	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.41	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	538,128,472.80	3.86
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

注:本基金合同约定,本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在120天以内,以规避较长期限债券的利率风险。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内,未出现投资组合平均剩余期限超过120天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	25.71	3.86
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	31.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	9.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.95	3.86

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	摊余成本(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	1,092,120,920.22	7.83
	其中:政策性金融债	1,092,120,920.22	7.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,015,060,718.97	14.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	297,896,158.85	2.14
8	其他	-	-
9	合计	3,405,077,798.04	24.42
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150206	15国开06	3,500,000	351,200,381.11	2.52
2	150202	15国开02	1,600,000	160,153,372.37	1.15
3	150411	15农发11	1,500,000	150,275,350.82	1.08
4	150403	15农发03	1,500,000	150,219,632.73	1.08
5	150211	15国开11	1,300,000	130,207,215.62	0.93
6	150416	15农发16	1,000,000	100,068,617.06	0.72
7	041566016	15包钢CP001	1,000,000	99,984,567.26	0.72
8	041578002	15宿迁经开CP001	1,000,000	99,949,518.70	0.72
9	041551054	15海亮CP002	1,000,000	99,946,912.39	0.72
10	111591653	15宁波银行CD097	1,000,000	99,401,325.87	0.71

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1386%
报告期内偏离度的最低值	0.0796%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1028%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.8.4 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	应收利息	135,540,769.07
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	135,540,769.07

5.8.5

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	15,108,664,774.02
报告期期间基金总申购份额	30,148,021,066.89
报告期期间基金总赎回份额	31,314,969,048.11
报告期期末基金份额总额	13,941,716,792.80

注:总申购份额含红利再投、份额强增和转换入份额;总赎回份额含份额强减、转换出份额。

§7 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	申购	2015-10-08	230,000,000.00	230,000,000.00	-
2	赎回	2015-10-12	230,000,000.00	230,000,000.00	-
3	申购	2015-10-23	700,000.00	700,000.00	-
4	申购	2015-11-05	190,000.00	190,000.00	-
5	赎回	2015-11-12	119.66	119.66	-
6	申购	2015-12-03	300,000.00	300,000.00	-
7	赎回	2015-12-09	150,254.00	150,254.00	-
合计			461,340,373.66	461,340,373.66	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

1.信诚薪金宝货币市场基金相关批准文件 2.信诚基金管理公司营业执照、公司章程 3.信诚薪金宝货币市场基金基金合同 4.信诚薪金宝货币市场基金招募说明书 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

信诚新双盈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	信诚新双盈分级债券
基金主代码	000091
基金运作方式	契约型,开放式。本基金以"运作周年滚动"的方式运作。新双盈A日基金合同生效日起每4个月开放申购和赎回一次,新双盈B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	2013年5月9日
报告期末基金份额总额	99,210,556.50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类、货币类等大类资产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、市场信