信诚优胜精选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	信诚优胜精选混合
基金主代码	550008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	89,855,821.70份
投资目标	通过投资于具有积极变化特征的上市公司,追求高于基准的超额收益,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
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。在不同的市场条件下,本基金将根据MVRS模型,综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内作战术性资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 本基金认为,上市公司的长期发展遵循“优胜劣汰”的规律。企业应根据所处的外部环境变化而不断积极变化。精选该类“优胜”上市公司,能够实现基金长期稳定增值的投资目标。同时,上市公司的积极变化会依次在管理人态度、公司财务数据和股票价格上先后反映。在积极变化反映到股票价格之前,介入该类上市公司的投资,能够创造超额收益。 鉴于此,本基金的股票投资将以“自下而上”的精选策略为主,以甄别产生积极变化的上市公司。
业绩比较基准	80%×中信标普A股综合指数收益率+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“中信标普A股综合指数收益率*80%+中信全债指数收益率*20%”变更为“中信标普A股综合指数收益率*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	27,969,780.20
2.本期利润	54,410,237.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.6082
4.期末基金资产净值	195,327,235.87
5.期末基金份额净值	2.174

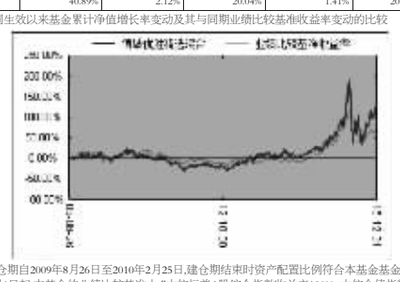
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	40.89%	2.12%	20.04%	1.41%	20.85%	0.71%

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2009年8月26日至2010年2月25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A股综合指数收益率*80%+中信全债指数收益率*20%”变更为“中信标普A股综合指数收益率*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		
王睿	本基金基金经理,信诚基金研究副总监职务,信诚精萃成长混合基金基金经理。	2015年4月30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、现任信诚基金研究副总监职务,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管理人对投资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《信诚优胜精选混合型证券投资基金基金合同》、《信诚优胜精选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

四季度经济增长较弱,投资、出口延续放缓态势,消费增长平稳,消费物价指数维持较低水平。央行继续实施稳健的货币政策,运用新型数量调节工具,保持流动性适度增长,流动性宽裕,央行7天逆回购投放资金利率为2.25%,比上季降低10BP。四季度,债市资金面宽松,货币市场利率维持低位,债券市场平稳上涨,中证综合债指数上涨2.5%。2015年,钢铁、煤炭、有色等产能过剩行业的企业经营仍然较为困难,信用风险仍不容忽视。

四季度,本基金保持适度杠杆水平,配置较高评级的信用债包括城投债和公司债,基金净值保持平稳增长。12月份,机构申购本基金较为踊跃,资金流入较多,杠杆有所下降,本基金配置较多短期融资券,未来逐步转换成中高等级公司债。本基金特别注重信用风险管理,通过严格的内部信用评级体系,甄别信用风险,规避负债率高、经营性现金流持续为负和经营亏损的公司发行的债券,以及信用风险较为突出的行业的债券,如房地产、钢铁、电解铝、煤化工等行业的债券。

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2.90%和2.43%,同期业绩比较基准收益率为2.41%,基金超越业绩比较基准分别为0.49%,0.02%。

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	158,989,258.88	80.80
	其中:股票	158,989,258.88	80.80
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	31,367,095.77	15.94
7	其他资产	6,410,059.37	3.26
8	合计	196,766,414.02	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	87,192,752.10	44.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,438,000.00	1.76
E	建筑业	5,166,000.00	2.64
F	批发和零售业	10,654,712.78	5.45
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	19,308,868.60	9.89
J	金融业	5,428,500.00	2.78
K	房地产业	1,396,500.00	0.71
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	8,932,320.00	4.57
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	13,379,605.40	6.85
S	综合	4,092,000.00	2.09
	合计	158,989,258.88	81.40

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	400,000	9,612,000.00	4.92
2	002665	首航节能	280,000	8,540,000.00	4.37
3	600351	亚宝药业	500,000	7,810,000.00	4.00
4	000952	广济药业	279,936	6,438,528.00	3.30
5	300395	菲利华	130,000	6,357,000.00	3.25
6	002172	澳洋科技	420,000	6,249,600.00	3.20
7	002036	汉森产业	200,000	6,160,000.00	3.15
8	002159	三特索道	189,900	5,848,920.00	2.99
9	600845	宝信软件	100,000	5,782,000.00	2.96
10	300198	纳川股份	360,000	5,662,800.00	2.90

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
5.11.12015年6月26日,根据媒体报道的情况,武穴市环保局对广济药业进行现场检查,并于2015年6月27日向广济药业下达了《武穴市环境保护局行政处罚事先(听证)告知书》(武环罚听告字[2015]第11号)。2015年6月30日,广济药业接到武穴市环保局下达的《行政处罚决定书》(武环罚听告字[2015]第21号):责令广济药业拆除排水泵排污设施,并处以人民币10万元的罚款。广济药业结合维生素B2生产线搬迁,对环保部门现场检查提出的问题启动整改,截至2015年6月30日,广济药业已全部完成整改事项。
对广济药业的投资决策程序的说明:根据广济药业于2015年7月1日发布的“澄清公告”,公司已经于6月30日完成相关整改,同时伴随VB2生产基地搬迁至“生物产业园”,我们预计后续发生环保问题的可能性比较小。另外,公司各货充足,不会因环保停产等问题导致业绩出现大幅下滑。综上,我们认为该处理不会影响广济药业的经营业绩,不会对公司股价造成明显的负面影响。此外,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。
5.11.2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。
5.11.3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。
5.11.4其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	155,633.42
2	应收证券清算款	6,097,954.10
3	应收股利	-
4	应收利息	6,597.82
5	应收申购款	149,874.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,410,059.37

5.11.5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。
5.11.6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。
5.11.7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	74,601,029.27
报告期间基金总申购份额	23,923,089.07
减:报告期期间基金总赎回份额	8,668,296.64
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	89,855,821.70

§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、(原)信诚优胜精选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、信诚优胜精选混合型证券投资基金基金合同
4、信诚优胜精选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

信诚优质纯债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	信诚优质纯债债券	
基金主代码	550018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年2月7日	
报告期末基金份额总额	2,255,256,200.70份	
投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金主要通过投资于精选的优质债券,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	1、资产配置策略 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。 2、固定收益类资产的投资策略 (1)类属资产配置策略 在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。 (2)普通债券投资策略 对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。 3、资产支持证券的投资策略 本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。	
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,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚优质纯债债券A	信诚优质纯债债券B
下属分级基金的交易代码	550018	550019
报告期末下属分级基金的份额总额	233,113,153.51份	2,022,143,047.19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	信诚优质纯债债券A报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)	信诚优质纯债债券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	6,814,762.63	12,496,411.49
2.本期利润	10,418,992.13	19,597,630.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0163
4.期末基金资产净值	241,218,007.64	2,057,605,124.97
5.期末基金份额净值	1.035	1.018

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

信诚优质纯债债券A

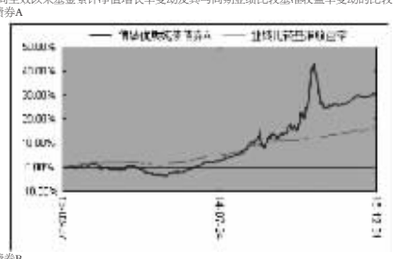
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.90%	0.11%	2.41%	0.06%	0.49%	0.05%

信诚优质纯债债券B

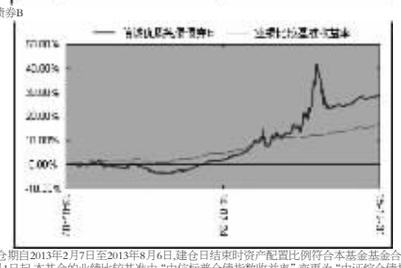
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.43%	0.10%	2.41%	0.06%	0.02%	0.04%

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

信诚优质纯债债券A



信诚优质纯债债券B



注:1、本基金建仓期自2013年2月7日至2013年8月6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(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,信诚理财日盈债券基金兼信诚添金分级债券基金基金经理。	2014年2月11日	-	16	管理学硕士,16年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚年年有余定期开放债券型基金、信诚理财7日盈债券基金兼信诚优质纯债债券基金基金经理和信诚添金分级债券基金基金经理。

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管理人对投资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《信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同》、《信诚优质纯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

四季度经济增长平稳,消费物价指数维持较低水平。央行继续实施稳健的货币政策,运用新型数量调节工具,保持流动性适度增长,流动性宽裕,央行7天逆回购投放资金利率为2.25%,比上季降低10BP。四季度,债市资金面宽松,货币市场利率维持低位,债券市场平稳上涨,中证综合债指数上涨2.5%。2015年,钢铁、煤炭、有色等产能过剩行业的企业经营仍然较为困难,信用风险仍不容忽视。

四季度,本基金保持适度杠杆水平,配置较高评级的信用债包括城投债和公司债,基金净值保持平稳增长。12月份,机构申购本基金较为踊跃,资金流入较多,杠杆有所下降,本基金配置较多短期融资券,未来逐步转换成中高等级公司债。本基金特别注重信用风险管理,通过严格的内部信用评级体系,甄别信用风险,规避负债率高、经营性现金流持续为负和经营亏损的公司发行的债券,以及信用风险较为突出的行业的债券,如房地产、钢铁、电解铝、煤化工等行业的债券。

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2.90%和2.43%,同期业绩比较基准收益率为2.41%,基金超越业绩比较基准分别为0.49%,0.02%。

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	2,631,951,336.40	95.70
	其中:债券	2,631,951,336.40	95.70
	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	34,905,272.47	1.27
7	其他资产	83,284,974.81	3.03
8	合计	2,750,141,583.68	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投资。
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投资。
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	120,158,233.10	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	902,934,198.10	39.28
5	企业短期融资券	1,559,257,000.00	67.83
6	中期票据	-	-
7	可转债	49,601,905.20	2.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,631,951,336.40	114.49

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	041569001	15北控集CP001	3,000,000	302,820,000.00	13.17
2	011599320	15腰地铁SCP002	2,500,000	251,075,000.00	10.92
3	011599467	15中电信SCP004	2,500,000	250,725,000.00	10.91
4	011599165	15国药控股SCP001	2,200,000	221,606,000.00	9.64
5	011590007	15苏交通SCP007	1,300,000	130,390,000.00	5.67

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	71,593.22
2	应收证券清算款	24,099,601.22
3	应收股利	-
4	应收利息	58,728,300.78
5	应收申购款	385,479.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,284,974.81

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	110031	航信转债	201,252.00	0.01

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

项目	信诚优质纯债债券A	信诚优质纯债债券B
报告期期初基金份额总额	217,911,216.17	223,402,811.82
报告期期间基金总申购份额	2,235,102,915.47	8,035,355,000.60
减:报告期期间基金总赎回份额	2,219,900,978.13	6,236,614,765.23
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	233,113,153.51	2,022,143,047.19

§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、信诚优质纯债债券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、信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同
4、信诚优质纯债债券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

信诚幸福消费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	信诚幸福消费混合
基金主代码	000551
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月29日
报告期末基金份额总额	11,402,724.47份
投资目标	本基金主要投资于消费服务行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金从各子行业国家政策、经济周期和行业估值等三个维度来对消费服务行业各个子类行业进行研究和分析,并在此基础之上实现基金权益资产在各个子行业之间的合理配置和灵活调整。本基金在进行个股筛选时,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。 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。 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	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	256,674.91
2.本期利润	4,741,430.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.4415
4.期末基金资产净值	22,715,432.34
5.期末基金份额净值	1.992

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