

## 信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金 2016 年第四季度报告

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。

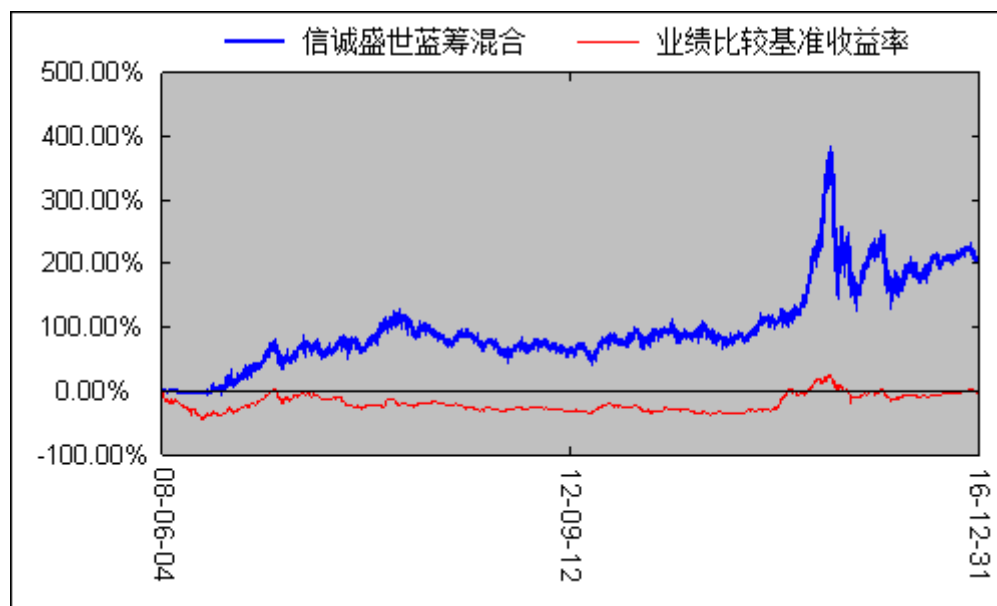
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>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<br>业年限 | 说明  |
|----|--|---------------------|------|------------|---|
|    |  | 任职日期                | 离任日期 |            |   |
| 聂炜 | 本基金基金经理,<br>信诚新机遇混合基金<br>(LOF)<br>基金经理 | 2015 年<br>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,<br>信诚新机遇混合基                   | 2015 年<br>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   |

|  |                    |  |  |  |  |
|--|--------------------|--|--|--|--|
|  | 金<br>(LOF)<br>基金经理 |  |  |  | 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相关程序, 及其它的流程控制, 确保不同基金在一、二级市场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 股市场市场先涨后跌, 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 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 年客户接入 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基金。

### 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](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司

2017年1月20日