

信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金 2010 年第二季度报告

2010 年 6 月 30 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：2010 年 7 月 19 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 2010 年 7 月 16 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 2010 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信诚盛世蓝筹股票
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	503,583,732.28 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。本基金定位为股票型基金,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	80%×中信标普 50 指数收益率+20%×中信全债指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
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(2010 年 4 月 1 日-2010 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-1,561,620.85
2. 本期利润	-56,973,834.38
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1348
4. 期末基金资产净值	823,642,671.31
5. 期末基金份额净值	1.636

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。

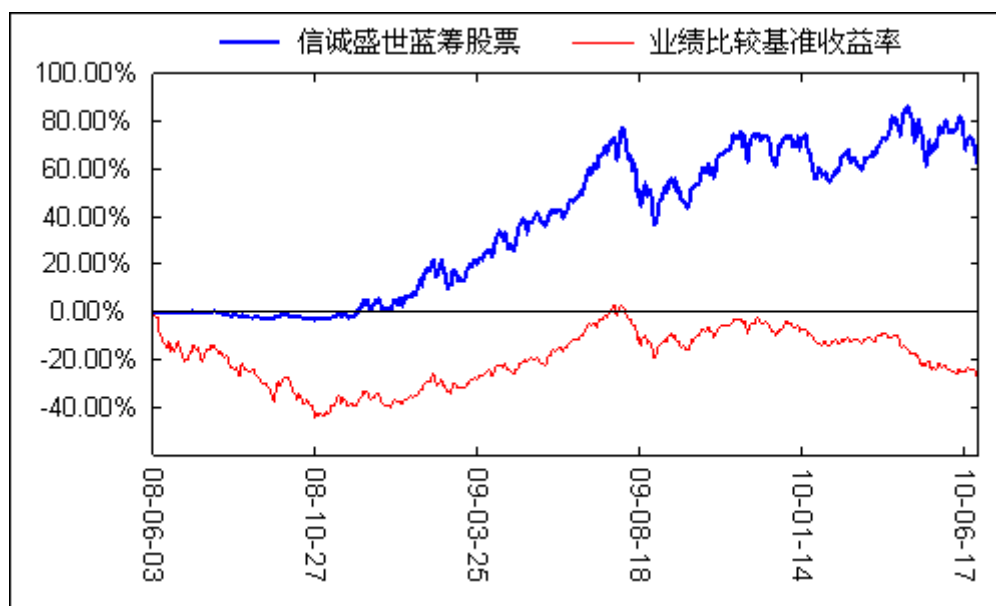
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2010 年第 2 季度	-4.50%	1.77%	-19.25%	1.45%	14.75%	0.32%

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:本基金建仓期自 2008 年 6 月 4 日至 2008 年 12 月 4 日,建仓期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		
张锋	本基金基金 经理、股票 投资副总监	2008 年 6 月 6 日	-	11	复旦大学经济学硕士。历任上海证券有限公司行业研究员、兴业证券股份有限公司行业研究员、上海融昌资产管理有限公司行业研究员。

注: 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

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《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹股票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

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列行动来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任，在日常交易中，严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控。对于交易所公开竞价交易，在恒生交易系统中执行公平交易程序，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易，通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年 2 季度，宏观经济总体仍然保持了高位运行态势，但由于信贷控制和房地产行业调控等因素在 2 季度逐渐发挥影响，经济增速出现见顶回落。至 2 季度末，PMI 等先行指标已经连续下降，而 CPI 还由于惯性因素继续上行，企业成本上升明显。股市也在 2 季度做出了相应的反应，沪深 300 指数下跌 23.85%。

对于 3 季度的市场，本基金认为在经历了 2 季度的大幅下跌后，系统性风险已经大为降低。大盘走势取决于经济增速进一步回落的速度以及政策如何应对。在两方面都难以出现显著变化的情况下，市场出现趋势性行情的概率并不大。投资上主要以把握阶段和结构板块的机会为主。

本基金在 2 季度一方面降低了整体仓位以规避系统性风险，另一方面，在结构上延续了年初以来的思路，避开了地产和地产投资相关产业链上的强周期性行业，重仓配置了消费、区域和部分新兴产业，此外辅以自下而上挖掘个股机会，取得了较好的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2 季度本基金净值下跌 4.5%，超越业绩基准 14.75 个百分点。基金净值波动率高于基准。

§ 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	529,159,913.53	62.67
	其中：股票	529,159,913.53	62.67
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	309,324,691.33	36.63
6	其他资产	5,917,972.71	0.70
7	合计	844,402,577.57	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	采掘业	—	—
C	制造业	343,211,903.85	41.67
C0	食品、饮料	56,958,672.40	6.92
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,341,595.50	3.08
C5	电子	18,819,552.00	2.28
C6	金属、非金属	73,384,868.10	8.91
C7	机械、设备、仪表	11,973,760.00	1.45
C8	医药、生物制品	156,733,455.85	19.03
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	30,804,151.00	3.74
G	信息技术业	47,234,754.20	5.73
H	批发和零售贸易	15,425,119.44	1.87
I	金融、保险业	49,553,412.00	6.02
J	房地产业	36,184,010.80	4.39
K	社会服务业	6,746,562.24	0.82
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	529,159,913.53	64.25

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	002422	科伦药业	429,950	40,329,310.00	4.90
2	000538	云南白药	579,879	37,402,195.50	4.54
3	600256	广汇股份	1,298,780	36,184,010.80	4.39
4	600518	康美药业	2,929,960	35,979,908.80	4.37
5	000423	东阿阿胶	1,013,755	35,238,123.80	4.28
6	600036	招商银行	2,450,000	31,874,500.00	3.87
7	600125	铁龙物流	2,280,100	30,804,151.00	3.74
8	000848	承德露露	813,860	29,298,960.00	3.56
9	600406	国电南瑞	741,285	28,457,931.15	3.46
10	600458	时代新材	847,545	25,341,595.50	3.08

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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	-	-

注：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名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	917,040.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,522.82
5	应收申购款	4,945,409.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,917,972.71

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	310,089,270.69
本报告期基金总申购份额	337,045,411.83
减: 本报告期基金总赎回份额	143,550,950.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	503,583,732.28

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、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、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同
4、信诚盛世蓝筹股票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

7.2 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。

7.3 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.citicprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司

2010 年 7 月 19 日