信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月15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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚增强收益债券(LOF)(场内简称:信诚增强)
基金主代码	165509
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,根据本基金基金合同相关约定以及基金份额持有人大会的召开结果,本基金的运作方式已于封闭期届满后转为上市开放式。
基金合同生效日	2010年9月29日
报告期末基金份额总额	398,258,862.12份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上,通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中债券、股票、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,其战略性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。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
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(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,399,758.98
2.本期利润	-26,604,613.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0276
4.期末基金资产净值	386,987,300.81
5.期末基金份额净值	0.972

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。

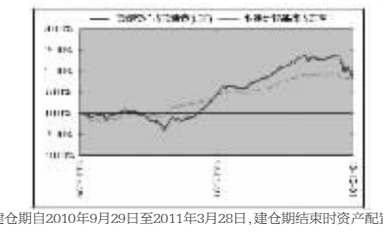
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2013年第4季度	-3.76%	0.34%	-1.20%	0.06%	-2.56%	0.28%

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2010年9月29日至2011年3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。

§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基金经理,信诚基金管理有限公司副首席投资官、固定收益总监	2010年9月29日	-	19	经济学硕士,19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、固定收益总监。

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《信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚增强收益债券型证券投资基金(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v1.2》,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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年四季度,受流动性冲击影响7天回购利率中值攀升至4.5%左右,居高不下,债券收益率继续大幅上升。主要有以下几个原因:(1)央行实行控制增量、盘活存量,把好流动性总闸门的偏紧政策,使得市场悲观气氛蔓延。(2)党中央反腐倡廉、例行节约,财政支出控制趋严,财政存款投放带来的流动性低于往年。(3)三季度以来基建投资高增长、房地产销售火爆,融资需求旺盛,在信贷收紧、信托到期高峰下,债务融资滚动需求较大,资金通过非标途径流出速度加快。(4)债券基金赎回压力较大,债券各品种在四季度进入加速下跌,品种上来看,信用债跌幅更大,期限上来看,中短期跌幅更大,评级上来看,低评级跌幅更大。

在组合管理方面,四季度继续净减持债券超过17.8亿,但本基金三年封闭期结束后,在全市场去杠杆的大背景下净赎回量很大,债券仓位被动上升,目前仓位仍在200%以上。投资策略以债券票息收益和利差收益为主,基本没有权益类(股票和可转债)投资。

展望2014年,新一届政府的改革方案已经出台,政策预期逐步明朗,有利于市场投资者形成一致预期,提振信心。我们认为债市经过半年多调整,2014年有望迎来相对平稳时期,以AA评级为代表的城投类债券收益率已攀升至8%以上,具备很高投资价值。同时我们也注意到金融去杠杆进展尚未完成,金融资产期限错配依然存在,政府容忍经济增速适度回落。2014年将迎来债券到期兑付高峰,信用风险不容乐观。2014年我们将高度关注信用风险,加强甄别、加强管控、加强调研。在大类资产配置上,重点投资城投类信用债,尽量规避低评级、民企类、产业类的信用债;权益方面将适当关注可转债和新股投资;坚持债券基金以债券票息收益和利差收益为主要盈利模式的投资策略;尽可能实行稳定分红。我们将一如既往,勤勉尽职,努力工作,回馈基金持有人。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-3.76%,同期业绩比较基准收益率为-1.20%,基金表现落后基准2.56个百分点。

§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	812,970,604.20	94.44
	其中:债券	812,970,604.20	94.44
	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	27,462,319.78	3.19
6	其他资产	20,357,402.86	2.36
7	合计	860,790,326.84	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,793,000.00	7.70
	其中:政策性金融债	29,793,000.00	7.70
4	企业债券	744,557,604.20	192.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	38,620,000.00	9.98
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	812,970,604.20	210.08

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

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	124156	13涪国资	629,940	60,436,443.60	15.62
2	124054	12株云龙	599,800	59,308,224.00	15.33
3	122912	10鄂国资	539,640	52,884,720.00	13.67
4	122871	10镇交投	529,930	51,339,618.40	13.27
5	111064	11长交债	420,000	40,866,000.00	10.56

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,075.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,218,228.01
5	应收申购款	99.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,357,402.86

5.10.4 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可转债。

5.10.5 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的情况。

5.10.6 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	2,266,065,663.27
报告期期间基金总申购份额	428,031.36
减:报告期期间基金总赎回份额	1,868,234,832.51
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	398,258,862.12

§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

基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动:

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、信诚增强收益债券型证券投资基金(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、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)基金合同

4、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)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
2014年1月21日

信诚中小盘股票型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月15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2013年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚中小盘股票
基金主代码	550009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月10日
报告期末基金份额总额	122,773,126.12份
投资目标	本基金通过重点投资于具有较高成长性或具有价值优势的中小盘股票,追求高于业绩比较基准的超额收益,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	1.资产配置策略:本基金的资产配置策略基于MVSR分析框架来制定。MVSR分析框架包括四个部分:M-宏观经济情况,V-估值水平,S-市场情况,R-风险状况。对上述四个部分,本基金会进行最近三个月和未来12个月的分析和预测,从而得出乐观、中性、谨慎和悲观的看法,在这些分析的基础上,得出对市场、行业的整体判断和指数运行空间的判断,并根据这些判断来决定本基金的大类资产配置比例和行业配置策略。 2.股票投资策略:本基金通过重点投资中小盘股票,以期把握中小企业两类投资机会:高速成长预期所带来的上升动量以及由于低关注度所带来的价格回归。本基金的股票投资将以"自下而上"的精选策略为主,同时结合"自上而下"的分析对公司成长性进行逻辑性判断,以甄别具有较高成长性抑或具有价值优势的中小盘股票。通过广泛深入的实地调研和细致严谨的案头分析,本基金将根据对中小盘股票的成长性及其可持续性、行业前景及行业地位,结合估值水平,进行股票组合的构建。
业绩比较基准	40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,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(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	8,478,437.63
2.本期利润	5,969,577.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0521
4.期末基金资产净值	116,501,883.71
5.期末基金份额净值	0.949

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。

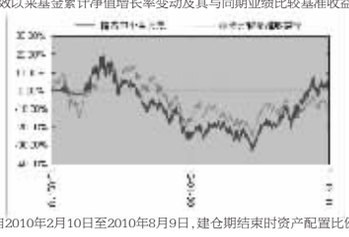
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2013年第4季度	5.44%	1.35%	-1.74%	0.99%	7.18%	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:本基金建仓期自2010年2月10日至2010年8月9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		
程兆	本基金基金经理	2011年8月16日	-	6	金融学硕士。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司、华泰联合证券研究所。2009年6月加入信诚基金管理有限公司
阎志刚	信诚四季红混合基金基金经理	2010年2月10日	2013年10月23日	12	清华大学MBA,12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《信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同》、《信诚中小盘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

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v1.2》,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。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年四季度,本基金份额净值增长率为5.44%,同期业绩比较基准增长率为-1.74%。

展望2014年一季度,流动性和资金利率较2013年四季度好,但利率高启对经济增速的影响以及IPO供给冲击将制约主板及中小板、创业板市场表现。对市场较为谨慎,但放在较长的时间周期中,我们认为市值结构将发生显著变化,符合转型和改革方向的消费和新兴产业将提供更好的投资环境和土壤,优选其中盈利加速增长的行业和公司是基金投资的基石。

本基金将采取积极的心态和稳健的操作,重点关注不同行业利润周期驱动下的投资机会。组合管理上重视下行风险、波动度和跟踪误差,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为5.44%,同期业绩比较基准收益率为-1.74%,基金表现领先基准7.18个百分点。

§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	102,085,145.74	80.15
	其中:股票	102,085,145.74	80.15
2	固定收益投资	5,974,800.00	4.69
	其中:债券	5,974,800.00	4.69
	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	18,775,619.48	14.74
6	其他资产	534,502.63	0.42
7	合计	127,370,067.85	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	567,424.00	0.49
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,387,199.74	44.11
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	3,652,380.00	3.14
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	7,752,168.20	6.65
J	金融业	3,458,455.00	2.97
K	房地产业	4,195,040.00	3.60
L	租赁和商务服务业	13,209,872.60	11.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,307,996.20	14.00
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	1,554,610.00	1.33
S	综合	-	-
	合计	102,085,145.74	87.63

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	300070	碧水源	257,630	10,560,253.70	9.06
2	300058	蓝色光标	200,082	10,364,247.60	8.90
3	002475	立讯精密	219,782	7,345,114.44	6.30
4	002148	北纬通信	126,400	5,749,936.00	4.94
5	600872	中炬高新	481,914	5,479,362.18	4.70
6	000661	长春高新	45,652	4,962,372.40	4.26
7	600887	伊利股份	109,498	4,279,181.84	3.67
8	600383	金地集团	628,000	4,195,040.00	3.60
9	600832	东方明珠	391,000	3,820,070.00	3.28
10	000625	长安汽车	331,746	3,798,491.70	3.26

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	5,974,800.00	5.13
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,974,800.00	5.13

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

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	019314	13国债14	60,000	5,974,800.00	5.13

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1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

5.8.2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。

5.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.9.3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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1长春高新股份有限公司于2013年4月12日发布"关于收到吉林证监局对公司采取责令改正措施决定的公告",该决定书认为:长春高新技术产业股份有限公司未将长春医药有限责任公司作为关联方予以持续披露,关联方长期占用公司资金未归还,违反了《公司法》、《证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知》的相关规定。为此,要求公司在2013年4月底前清收被占用资金,并于2013年5月10日前向吉林证监局提交书面整改报告,吉林证监局将对整改情况进行检查验收。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为该公司近年来生产、销售和利润保持稳定增长,处罚事项未对其长期企业经营和投资价值产生重大实质性影响。该证券投资已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。

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。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,176.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	106,235.31
5	应收申购款	361,090.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,502.63

5.10.4 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。

5.10.5 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的情况。

5.10.6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	111,428,375.15
报告期期间基金总申购份额	38,363,806.85
减:报告期期间基金总赎回份额	27,019,055.88
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	122,773,126.12

§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

基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动:

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、信诚中小盘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、信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同

4、信诚中小盘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

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
2014年1月21日

信诚中证500指数分级证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月15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2013年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚中证500指数分级(场内简称:信诚500)
基金主代码	165511
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年2月11日
报告期末基金份额总额	2,032,170,208.59份
投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证500指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证500指数的有效工具。
投资策略	本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证500指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。 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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属三级基金的基金简称	信诚中证500指数分级A(场内简称:信诚500A)	信诚中证500指数分级B(场内简称:信诚500B)	信诚中证500指数分级(场内简称:信诚500)
下属三级基金的交易代码	150028	150029	165511
报告期末下属三级基金的份额总额	696,930,569.00份	1,045,395,855.00份	289,843,784.59份
下属三级基金的风险收益特征	信诚中证500 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征	信诚中证500 B份额具有高风险、高预期收益的特征	本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金

§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(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	84,850,955.21
2.本期利润	17,455,016.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	1,544,837,186.00
5.期末基金份额净值	0.760

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。

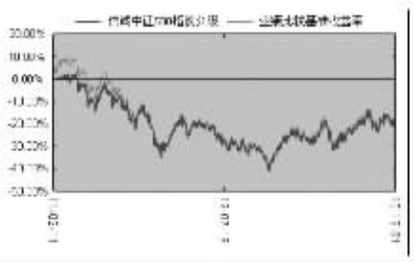
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2013年第4季度	0.40%	1.29%	-1.04%	1.33%	1.44%	-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



注:本基金建仓期自2011年2月11日至2011年8月10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		
吴雅楠	本基金基金经理,兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金和信诚中证800金融指数分级基金基金经理,信诚基金管理有限公司投资管理部数量投资总监	2011年2月11日	-	17	统计物理学博士,CFA,17年证券、基金从业经验,拥有丰富的量化投资和指数基金管理经验。曾任职于加拿大Greydanus, Boeckh & Associates公司和加拿大道明资产管理公司(TD Asset Management)。现任公司投资管理部数量投资总监兼信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金和信诚中证800金融指数分级基金的基金经理。

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《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证500指数分级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