信诚新兴产业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	信诚新兴产业股票
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	131,527,237.68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	80%×中证新兴产业指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险、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

§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	-1,279,213.06
2.本期利润	-1,317,247.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0091
4.期末基金资产净值	130,758,473.27
5.期末基金份额净值	0.994

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。

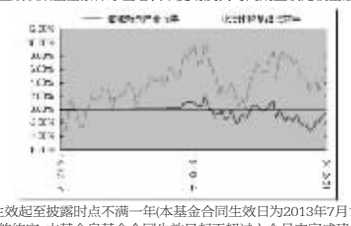
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.00%	0.63%	-0.95%	1.21%	-0.05%	-0.58%

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、基金合同生效起至披露时点不满一年(本基金合同生效日为2013年7月17日)。

2、按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于60%,其中投资于本基金定义的价值型股票的资产占股票资产的比例不低于80%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的比例不高于40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证不超过基金资产净值的3%。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
谭鹏万	本基金基金经理,信诚深度价值股票(LOF)基金和信诚精萃成长股票基金基金经理	2013年7月17日	-	6	经济学博士,曾任华宝信托有限责任公司高级分析师。2008年7月加入信诚基金管理有限公司。现任信诚新兴产业股票基金、信诚深度价值股票基金和信诚精萃成长股票基金的基金经理。
郑伟	本基金基金经理	2013年8月16日	-	8	2005年9月至2009年9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

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《信诚新兴产业股票型证券投资基金基金合同》、《信诚新兴产业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

本基金在报告期内重点配置了安防产业、医药行业、装备制造行业、消费品行业、天然气及油服行业,通过深入研究,重点投资了这些新兴产业中的优秀公司。

4季度宏观经济复苏趋势比较缓慢。从发电量来看,12月中旬增速为7.5%,延续了8月份以来持续回落的趋势。11月工业增加值较10月回落0.3个百分点,降至10.0%,11月固定资产投资累计增速为19.9%,比上月小幅回落0.2个百分点。

我们认为,未来国内经济增长仍会面临两个约束,地方政府债务约束和制造业产能过剩的约束。未来的一段时间,经济增长仍会维持平稳,难有大的周期性波动。

明年各领域改革的推进,将带来较多的投资机会。我们看好经济结构调整和人口结构变化带来的消费、医药、装备制造、服务、环保等行业的投资机会。明年各种改革主题,如要素价格改革、国企改革、军工资产证券化改革等,也将带来较多的主题投资机会。

我们将在新兴产业这个方向上不断深入挖掘投资机会,通过投资成长性行业的优秀公司为持有人创造回报。

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-1.00%,同期业绩比较基准收益率为-0.95%,基金表现落后基准0.05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	74,447,263.90	56.30
	其中:股票	74,447,263.90	56.30
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	29,069,915.15	21.98
6	其他资产	28,722,482.47	21.72
7	合计	132,239,661.52	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	5,679,000.00	4.34
C	制造业	50,550,922.64	38.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,816,000.00	2.92
F	批发和零售业	6,050,900.31	4.63
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	1,421,587.50	1.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	6,928,853.45	5.30
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	74,447,263.90	56.93

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	000516	开元投资	1,023,841	6,050,900.31	4.63
2	002415	海康威视	257,930	5,927,231.40	4.53
3	002554	惠博普	450,000	5,679,000.00	4.34
4	300124	汇川技术	87,000	5,088,630.00	3.89
5	002236	大华股份	120,950	4,944,436.00	3.78
6	600872	中炬高新	420,810	4,784,609.70	3.66
7	002353	杰瑞股份	52,366	4,156,289.42	3.18
8	300349	金卡股份	84,000	4,151,280.00	3.17
9	601117	中国化学	477,000	3,816,000.00	2.92
10	300070	碧水源	87,995	3,606,915.05	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名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

本基金投资范围不包括股指期货投资。

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	35,304.59
2	应收证券清算款	28,630,164.08
3	应收股利	-
4	应收利息	6,866.01
5	应收申购款	50,147.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,722,482.47

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	195,712,476.95
报告期期间基金总申购份额	693,569.90
减:报告期期间基金总赎回份额	64,878,809.17
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	131,527,237.68

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、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、信诚新兴产业股票型证券投资基金基金合同
4、信诚新兴产业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

8.2 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。

8.3 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

信诚优胜精选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	信诚优胜精选股票
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	762,130,611.60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%×中信全债指数收益率
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	-1,351,471.82
2.本期利润	-69,769,244.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0942
4.期末基金资产净值	796,582,916.52
5.期末基金份额净值	1.045

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。

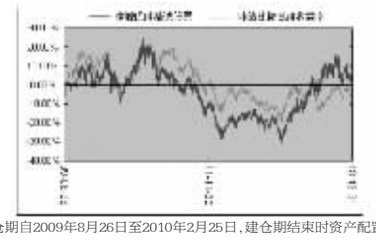
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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年第四季度	-8.17%	1.63%	-1.78%	0.94%	-6.39%	0.69%

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。

§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		
黄小坚	本基金基金经理,本公司副总经理,首席投资官,股票投资总监	2009年8月26日	-	12	经济学硕士,12年证券、基金从业经验。曾先后任职于申银万国证券研究所,银华基金和华宝兴业基金公司。曾先后担任银华道琼斯88精选基金、基金天华、银华优势企业基金、华宝多策略增长基金的基金经理。2007年加盟信诚基金管理有限公司,现任公司副总经理、首席投资官、股票投资总监兼信诚优胜精选股票基金基金经理。
杨建标	本基金基金经理,信诚新机遇股票(LOF)基金基金经理	2011年3月29日	-	12	理学硕士。12年证券金融从业经验。历任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部投资经理助理、平安证券有限责任公司综合研究所行业研究员、生命人寿股份有限公司投资管理中心研究总监、浙商基金管理有限公司(筹)投资管理部研究负责人。2010年3月加入信诚基金管理有限公司,担任投资经理,现任信诚优胜精选股票基金与信诚新机遇股票(LOF)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《信诚优胜精选股票型证券投资基金基金合同》、《信诚优胜精选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,欧美股市在良好的经济增长支撑下大幅上扬,即便是美联储宣布量化宽松政策退出计划,也没有影响到市场的良好表现;A股市场则因受到资金紧张的压制振荡走低,十八届三中全会会议决定分布后市场曾一度兴奋,但在IPO重启和年底利率飙升的打击下再度反复。结构上,家用电器、农林牧渔、交运设备、纺织服装、机械设备表现较好;信息服务、有色金属、商业贸易、房地产、采掘表现落后。

四季度,本基金依然将资金重点配置在信息服务、医药生物、信息设备、电子、食品饮料等行业上,但在个股比例上作了调整。由于重仓品种出现了一些波动,基金净值有所回落,业绩表现在第四季度没能超越基准,但2013全年仍然大幅超越了业绩基准。

展望明年,转型升级、改革仍然是最重要的投资背景,投资主线和个股机会依然必须围绕这两个主题词来展开与寻找;与此同时,利率难以迅速下降、资金难以大幅宽松,可能造成趋势性的行情甚至是如2013年一样的行业性机会都难以再现;但历经长期下跌后,传统蓝筹股的估值也基本到位,唯有其基本面可能继续受挫,然而由于中国经济仍然具有较强的活力,传统蓝筹股基本面再度大幅转差的可能性也不大,这就封杀了市场大幅下跌的空间;此外,改革难以一蹴而就,势必会影响到投资者的情绪从而导致市场振荡。综合这些因素分析,我们判断2014年市场波动较多、但幅度不大,投资机会仍然集中在消费服务、环保、健康产业、移动互联应用、工业自动化等代表转型升级的行业和国企改革这个主题上,不过投资机会不是行业性的,而是集中在优质的、有持续业绩增长的公司上面。

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-8.17%,同期业绩比较基准收益率为-1.78%,基金表现落后基准6.39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	662,750,092.53	77.92
	其中:股票	662,750,092.53	77.92
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	186,917,410.35	21.98
6	其他资产	835,082.78	0.10
7	合计	850,502,585.66	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	964,000.00	0.12
B	采矿业	9,486,000.00	1.19
C	制造业	449,186,727.62	56.39
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	37,428,621.00	4.70
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	42,269,709.64	5.31
J	金融业	17,981,000.00	2.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,993,154.40	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	50,722,339.31	6.37
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	46,718,540.56	5.86
S	综合	-	-
	合计	662,750,092.53	83.20

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	300115	长盈精密	1,039,758	39,250,864.50	4.93
2	000516	开元投资	6,333,100	37,428,621.00	4.70
3	300273	和佳股份	1,439,856	37,306,668.96	4.68
4	002017	东信和平	2,389,904	37,258,603.36	4.68
5	300026	红日药业	889,836	33,244,272.96	4.17
6	300070	碧水源	683,658	28,023,141.42	3.52
7	300171	东富龙	815,178	27,822,025.14	3.49
8	600872	中炬高新	2,435,000	27,685,950.00	3.48
9	002475	立讯精密	739,860	24,726,121.20	3.10
10	002631	德尔家居	1,483,431	24,476,611.50	3.07

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 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	595,971.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,855.89
5	应收申购款	202,255.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	835,082.78

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	747,410,212.86
报告期期间基金总申购份额	131,031,514.66
减:报告期期间基金总赎回份额	116,311,115.92
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	762,130,611.60

§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、信诚优胜精选股票型证券投资基金基金合同
4、信诚优胜精选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

信诚优质纯债债券型证券投资基金

【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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	824,410,224.27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,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
下属两级基金的基金简称	信诚优质纯债债券A / 信诚优质纯债债券B
下属两级基金的交易代码	550018 / 550019
报告期末下属两级基金的份额总额	392,579,413.36份 / 431,830,810.91份

§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(2013年10月1日至2013年12月31日)	信诚优质纯债债券B报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-562,940.28	-1,991,461.41
2.本期利润	-8,355,822.15	-16,878,276.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0353	-0.0329
4.期末基金资产净值	380,182,123.82	416,497,625.11
5.期末基金份额净值	0.968	0.964

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

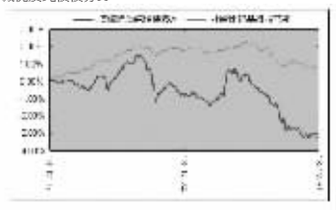
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年第4季度	-3.20%	0.16%	-1.20%	0.06%	-2.00%	0.10%

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
2013年第4季度	-3.31%	0.17%	-1.20%	0.06%	-2.11%	0.11%

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