

信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)

[2014] 第一季度报告

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4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。

基金托管人对本基金定期报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。投资人在作出投资决策前应当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2014年1月1日起至3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 | 16509 |
| 基金运作方式 | 契约型,基金合同生效后三年(含三年)为封闭期,根据本基金合同相关规定定以及基金份额持有人大会的表决结果,本基金的运作方式已封闭期届满后转为上市开放式。 |
| 基金合同生效日 | 2010年9月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 351,239,843.91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,超越业绩比较基准的证券投资策略,力争在扣除相关费用后取得超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金将综合运用多种投资策略,包括但不限于久期策略、利率预期策略、信用策略、行业配置策略、风险管理策略等,在控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,属于较低风险品种,其预期风险与预期收益均低于股票型基金。 |
| 基金经理 | 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

单位:人民币元

报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)

1.本期实现收入 -10,526,540.54

2.本期利润 3,756,753.59

3.本期平均基金份额本期利润 0.0107

4.期末基金份额净值 345,393,160.27

5.期末基金份额净值 0.983

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.本期已实现收益指本基金利息收入、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.基金净值的表现

3.21 本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(%) 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

2014年第1季度 1.13% 0.33% 1.42% 0.05% -0.29% 0.26%

3.22 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

王相巍 基金经理,信诚添益分级债券基金和信诚新溢分级债券基金基金经理,信诚基金管理有限公司固定收益总监 - 19 经济学硕士,19年金融从业经验,历任基金行业从业人员,曾先后担任职工中国(深圳)证券交易所债券部债券分析师,信诚基金管理有限公司债券部债券分析师,信诚基金管理有限公司固定收益总监。

注:1.上述任职日期、离任日期均指本基金基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的规定执行。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

在本基金报告期内,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》、《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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 公平交易制度执行的情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金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》,公司采取了一系列行动实施公平交易管理制度的要求。各部分在公平交易执行中坚持公平原则,投资研究部门严格执行《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚基金管理人公平交易管理制度V1.2》,《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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》,公司采取了一系列行动实施公平交易管理制度的要求。各部分在公平交易执行中坚持公平原则,投资研究部门严格执行《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚基金管理人公平交易管理制度V1.2》,《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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。

4.4.2 公平交易制度执行情况的说明

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的情况。

5.11.6 投资组合报告对基金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尾差。

§ 5 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额 398,258,862.12

报告期期间基金申购份额 189,260,327.53

报告期期间基金赎回份额 236,279,345.74

报告期期末基金份额总额 351,239,843.91

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.证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的规定执行。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

在本基金报告期内,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》、《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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 公平交易制度执行的情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金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》,公司采取了一系列行动实施公平交易管理制度的要求。各部分在公平交易执行中坚持公平原则,投资研究部门严格执行《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚基金管理人公平交易管理制度V1.2》,《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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。

4.4 公平交易制度执行情况的说明

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的情况。

5.11.6 投资组合报告对基金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尾差。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金报告期内未使用固有资金投资本基金。

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》,公司采取了一系列行动实施公平交易管理制度的要求。各部分在公平交易执行中坚持公平原则,投资研究部门严格执行《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚基金管理人公平交易管理制度V1.2》,《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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。

4.3.2 公平交易制度执行情况的说明

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的情况。

5.11.6 投资组合报告对基金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尾差。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资资本金情况

本基金报告期内未使用固有资金投资资本金。

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》,公司采取了一系列行动实施公平交易管理制度的要求。各部分在公平交易执行中坚持公平原则,投资研究部门严格执行《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚基金管理人公平交易管理制度V1.2》,《信诚增溢货币型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则运用基金财产,本基金基金管理人通过不断完善售后服务,加强内部控制,规范基金运作。本基金报告期内,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。

4.3.2 公平交易制度执行情况的说明

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的情况。

5.11.6 投资组合报告对基金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尾差。

§ 8 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 9 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 10 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 11 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 12 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 13 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金设立的文件;

2. 基金章程;

3. 基金托管协议;

4. 基金份额发售公告;

5. 基金募集说明书;

6. 基金临时公告;

7. 其他备查文件。

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。

§ 14 备查文件目录