

信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日
重要提示:基金管理人及基金托管人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...

Table with columns: 姓名, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%)

5.1 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布
5.2 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股票投资明细

3.1 主要财务指标

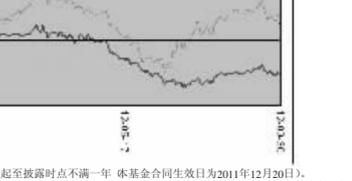
Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

注:1.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...

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

注:1.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.基金合同生效日至披露时点不满一年,本基金合同生效日为2011年12月20日。

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产...

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(1.2)》,公司采取了一系列的行动严格落实公平交易管理的各项要求...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

第三基金投资策略:第二季下起影响,对未发生风险资产的看法偏稳健,在投资策略上低配能源、高配黄金及新兴市场,看好黄金将持续受到央行及通胀宽松政策影响,未来仍有上涨的空间...

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 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大股票投资明细

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产支持证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本报告期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受到公开谴责、处罚。

5.9 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

7.1 备查文件目录

- 1.信诚全球商品主题证券投资基金(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.信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同
4.信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书
5.本报告期内按照相关规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理公司办公地—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。

投资者可在营业时间内至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件,亦可过公司网站查询,公司网址为www.citicifunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日
重要提示:基金管理人及基金托管人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...

3.1 主要财务指标

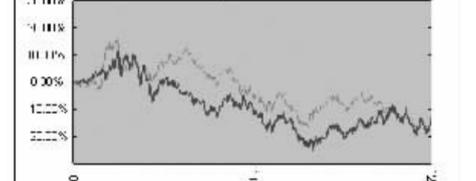
Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

注:1.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...

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

注:1.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.基金合同生效日至披露时点不满一年,本基金合同生效日为2010年7月30日。

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产...

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(1.2)》,公司采取了一系列的行动严格落实公平交易管理的各项要求...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本行业严格恪守基金合同的要求,积极寻找具有深度价值特征的行业和个股,坚持寻找具有较高成长性的行业作为配置的重点。3季度增持了医药、汽车类,降低了地产股的持仓。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 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大股票投资明细

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产支持证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本报告期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受到公开谴责、处罚。

5.9 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

7.1 备查文件目录

- 1.信诚深度价值股票型证券投资基金(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.信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同
4.信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)招募说明书
5.本报告期内按照相关规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理公司办公地—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。

投资者可在营业时间内至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件,亦可过公司网站查询,公司网址为www.citicifunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚三得益债券型证券投资基金

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日
重要提示:基金管理人及基金托管人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...

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

注:1.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...

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

注:1.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

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚三得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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产...

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(1.2)》,公司采取了一系列的行动严格落实公平交易管理的各项要求...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金严格恪守基金合同的要求,积极寻找具有深度价值特征的行业和个股,坚持寻找具有较高成长性的行业作为配置的重点。3季度增持了医药、汽车类,降低了地产股的持仓。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 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大股票投资明细

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产支持证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本报告期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受到公开谴责、处罚。

5.9 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

7.1 备查文件目录

- 1.信诚三得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.信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)基金合同
4.信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)招募说明书
5.本报告期内按照相关规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理公司办公地—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。

投资者可在营业时间内至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件,亦可过公司网站查询,公司网址为www.citicifunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚三得益债券型证券投资基金

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日
重要提示:基金管理人及基金托管人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...

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

注:1.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...

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

注:1.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

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚三得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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产...

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(1.2)》,公司采取了一系列的行动严格落实公平交易管理的各项要求...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金严格恪守基金合同的要求,积极寻找具有深度价值特征的行业和个股,坚持寻找具有较高成长性的行业作为配置的重点。3季度增持了医药、汽车类,降低了地产股的持仓。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 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大股票投资明细

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产支持证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本报告期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受到公开谴责、处罚。

5.9 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

7.1 备查文件目录

- 1.信诚三得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.信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)基金合同
4.信诚三得益债券型证券投资基金(LOF)招募说明书
5.本报告期内按照相关规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理公司办公地—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。

投资者可在营业时间内至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件,亦可过公司网站查询,公司网址为www.citicifunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日