

## 信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)

## [2014] 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:2015年1月20日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书不存在虚假记载、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2015年1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2014年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)
场内简称	信诚深度
基金代码	165508
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月8日
报告期末基金资产总额	86,792,263.00
投资目标	本基金主要投资于深证综合指数成分股,通过深入研究,精选投资价值被低估的股票,从而把握具有深
投资策略	本基金主要投资于深证综合指数成分股,通过深入研究,精选投资价值被低估的股票,从而把握具有深
业绩比较基准	80%×上证50指数收益+20%×中信普债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险收益特征与股票型基金相同,并可能大于混合型基金、债券型基金和货币
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	26,572,171.68
2.本期利润	39,547,849.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.5229
4.期末基金资产净值	146,869,750.86
5.期末基金份额净值	1.092

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。

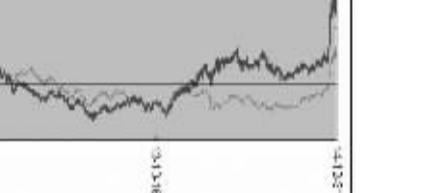
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③
过去三个月	48.94%	2.20%	39.96%

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7月30日至2011年1月29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间	证券从业年限	说明
谭鹏飞	本基金基金经理 和基金经理助理	2011年9月8日	7	经济学博士,曾任华信信托有限责任公司高级分析师,2008年加入信诚基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,现任信诚深度价值股票型证券投资基金基金经理。本基金持有人通过不断完善基金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,基金运作合规合规,没有发生损害基金份额持有人利益的事件。

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》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理制度。各部分公平交易执行中各自独立,投资研究前端和投资决策流程、确保各投资组合享有公平的决策机会。

4.2. 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

在本报告期内,本基金持有人严格按照《证券投资基金管理法》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,诚信经营,勤勉尽责的履行管理职责和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

4.3.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为48.94%,同期业绩比较基准收益率为39.96%,基金表现超越业绩比较基准8.08%。

4.4 报告期内基金的经营情况

本基金坚持长期投资的策略,积极寻找具有较高成长的行业和个股,第四季度超配了地产、机械、汽车、钢铁、增配了金融类,目前看涨不看跌。

4.5.2 本基金从2014年2月7日起免收赎回费,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.3 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘赵巍为中国建设银行投资托管部总经理。

4.5.4 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.5 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理。

4.5.6 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.7 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.8 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.9 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.10 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.11 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.12 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.13 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.14 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.15 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.16 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.17 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.18 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.19 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.20 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.21 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.22 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.23 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.24 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.25 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.26 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.27 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.28 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.29 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.30 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.31 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.32 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.33 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.34 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.35 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.36 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.37 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.38 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.39 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.40 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.41 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.42 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.43 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.44 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.45 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.46 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.47 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.48 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.49 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.50 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.51 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.52 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.53 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.54 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.55 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.56 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.57 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.58 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.59 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.60 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.61 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.62 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.63 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.64 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹东华担任中国建设银行投资托管部总经理助理职务。

4.5.65 本基金从2014年11月03日起发布公告,解聘尹