

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(LOF)
场内简称	信诚深股
基金代码	165598
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2010年7月30日
报告期末基金份额总额	86,792,263.18份
投资目标	通过对公司基本面的研究,深入发掘价值被低估的个股,从而挖掘具有深度价值的股票以力争实现资本的长期增值。
投资策略	本基金定位为股票型基金,其投资组合资产配置以股票为主,并不同市场的中长期变化而改变。本基金的核心理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。本基金的投资范围以“自下而上”为主,同时也会根据组合行业分布和行业“自下而上”的行业配置。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。
业绩比较基准	80%×上证180指数收益率+20%×中国债券综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,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

3.1 主要财务指标

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	146,809,750.86
5.期末基金份额净值	1.692

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。

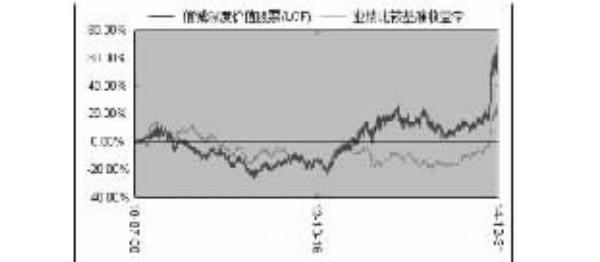
3.2 基金净值表现

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②	①-②	②-①
----	--------	-----------	-----	-----

过去三个月 48.94% 2.26% 39.68% 1.45% 8.98% 0.81%

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20日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
谭颖	本基金基金经理、投资决策委员会成员和风险控制委员会成员	2011年5月8日	-	7

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资产。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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门不断完善研究方法和投资决策流程,确保投资组合享有公平的投资决策机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.3 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.5 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.6 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.7 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.8 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.9 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.10 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.11 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.12 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.13 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.14 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.15 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.16 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.17 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.18 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.19 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.20 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.21 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.22 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.23 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.24 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.25 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

4.3.26 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间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5%的交易。

4.3.27 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》,以及公司制定的《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制度的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	131,677,642.82	86.30
其中:股票		131,677,642.82	86.30
2	固定收益投资	-	-
其中:债券		-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产		-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,625,511.90	8.27
7	其他资产	8,275,768.75	5.42
8	合计	152,578,923.47	100.00

序号	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	-	-
C	制造业	43,505,600.00	29.62
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	2,184,000.00	1.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	24,207,135.76	16.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	38,062,402.12	25.92
K	房地产业	22,807,600.00	15.53
L	租赁和商业服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	905,904.94	0.62
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	131,677,642.82	89.66

5.2 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	000002	万科A	570,000	7,923,000.00	5.39
2	601336	新华保险	156,927	7,777,302.12	5.30
3	601628	中国人寿	212,000	7,239,800.00	4.93
4	601111	中国国航	910,000	7,134,400.00	4.86
5	600048	保利地产	640,000	6,924,800.00	4.71
6	601601	中国太保	210,000	6,783,000.00	4.62
7	601318	中国平安	90,000	6,723,900.00	4.58
8	600157	宝钢股份	800,000	5,448,000.00	3.85
9	600019	宝钢股份	760,000	5,327,600.00	3.63
10	600031	三一重工	510,000	5,089,800.00	3.47

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序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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未进行权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 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。

5.13 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。

5.14 报告期末本基金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。

5.15 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。

5.16 投资组合中报告附注的其他文字描述部分

5.16.1 报告期内,投资组合中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在误差。

§6 开放式基金份额变动

序号	项目	金额(元)
1	期初基金份额总额	80,813,960.00
2	期间基金净申购份额	6,079,697.44
3	期间基金净赎回份额	-
4	期间基金净申购份额	3,392.55
5	期间基金净赎回份额	-
6	其他基金份额变动	1,465,130.60
7	期间基金净申购份额	-
8	期间基金净赎回份额	-
9	合计	8,275,768.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本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

本基金管理人于2014年2月7日发布公告,聘任赵蔚为中国建设银行投资管理业务部总经理助理职务。本基金管理人于2014年11月03日发布公告,聘任赵蔚为中国建设银行投资管理业务部总经理。

§9 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. 信诚基金管理有限公司营业执照、公司章程、基金合同、基金托管协议

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. 本报告期内基金管理人发布的公告

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号上海金融中心汇丰银行大楼9层。

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。

亦可访问公司网站查阅,公司网址为www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2015年1月20日

信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

【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	信诚盛世蓝筹股票
基金代码	350003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
报告期末基金份额总额	198,053,36.96份
投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、货币各品种的长期配置比例,根据本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为股票型基金,其投资组合资产配置以股票为主,并不同市场的中长期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。
业绩比较基准	80%×中信证券50指数收益率+20%×中国债券指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,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

3.1 主要财务指标

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	33,513,395.58
2.本期利润	1,103,765.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	334,382,342.61
5.期末基金份额净值	1.686

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。

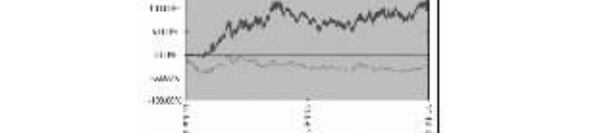
3.2 基金净值表现

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②	①-②	②-①
----	--------	-----------	-----	-----

过去三个月 0.06% 1.26% 43.20% 1.67% -45.20% -0.41%

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2008年6月4日至2008年12月3日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

§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
张成成	本基金基金经理、投资决策委员会成员和风险控制委员会成员	2011年10月28日	-	10

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《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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