

## 信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)

## [2015] 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:2015年10月24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、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的规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务数据、净值表现数据、投资组合报告和投资收益分配情况。

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未来的业绩,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。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30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
基金代码	16509
基金管理人首次募集合同生效日期	2015年10月23日
基金合同生效日	2015年9月29日
报告期末基金份额总额	178,774,384.43份
投资目标	本基金投资于国债、股票、现金等金融工具,通过主动管理,追求超越业绩比较基准的持续收益,力争在风险控制的前提下为基金份额持有人谋取稳定的资产增值。
投资策略	本基金投资于国债、股票、现金等金融工具,通过主动管理,追求超越业绩比较基准的持续收益,力争在风险控制的前提下为基金份额持有人谋取稳定的资产增值。
业绩比较基准	中证银行指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,但低于股票基金和混合基金。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,419,975.03
2.本期利润	-2,533,057.95
3.加权平均基金份额利润	-0.0230
4.期末基金份额净值	205,060,146.20
5.期末可供分配基金份额利润	-0.0347

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.2 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.3 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.4 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.5 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.6 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.7 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.8 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.9 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.10 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.11 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.12 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.13 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.14 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.15 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.16 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.17 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.18 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.19 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.20 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.21 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.22 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.23 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.24 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.25 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.26 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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利润。

3.2.27 本报告期基金份额净值增长率为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调整③

过去一个月 -0.95% 0.41% 1.81% 0.05% -2.76% 0.36%

3.2.28 本报告期基金份额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

序号 ①-③ ②-④

注:1. 上述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的现金费用,计算费用后实际收益可能低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、其他收入(不含公允价值变动收益