

信诚深度价值混合型证券投资基金(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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理人根据有关法律法规的规定，于2015年10月23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财产，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

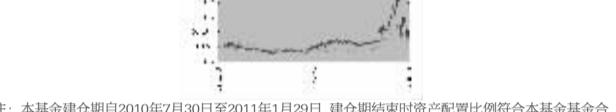
| 基金简称 | 信诚深度价值混合(LOF) |
|-------------------|---|
| 场内简称 | 信诚深混 |
| 基金代码 | 166608 |
| 基金运作方式 | 契约型上市开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,200,164.20份 |
| 投资目标 | 通过公司深入的研究，深入剖析股票价值被低估的原因，从而挖掘具有深度价值的股票，以力求获得超额的长期回报。 |
| 投资策略 | 本基金定位于混合型基金，其购买资产主要以股票为主，并不进行市场的中期变化而操作。本基金的经理是理性的投资决策者，根据对市场价格低于内在公允价值的股票，本基金的投资操作“百折而不挠”，但同时也结合行业研究分析以及对宏观经济的判断，在不同的市场条件下，本基金将在一定范围内操作成股票型基金和债券型基金，以期达到最佳的收益。 |
| 投资策略 | 本基金的经理是理性的投资决策者，根据对市场价格低于内在公允价值的股票，本基金的操作“百折而不挠”，但同时也结合行业研究分析以及对宏观经济的判断，在不同的市场条件下，本基金将在一定范围内操作成股票型基金和债券型基金，以期达到最佳的收益。 |
| § 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(2015年7月1日至2015年9月30日) |
| 1.本期已实现收益 | -22,408,996.68 |
| 2.本期利润 | -47,380,362.36 |
| 3.期初基金份额总额 | -10,839.00 |
| 4.期末基金份额净值 | 71,834,306.08 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.431 |

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示数字。
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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金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 | 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 |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|
| 过去三个月 | -33.13% | 4.25% | -22.11% | 2.68% |

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 |

郑伟 本基金基金经理，信诚新兴产业、信诚深度价值混合基金经理
2015年6月20日 - 10

2006年9月至2009年8月期间于华泰资产管理有限公司担任助理研究员及客户资产管理业务部研究员，2009年8月加入信诚基金管理有限公司，先担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2010年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2011年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2012年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2013年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2014年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员，2015年1月担任股票研究员及客户服务部客户资产管理业务部研究员。

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《证券投资基金公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《信诚基金公平交易执行办法》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理制度。各部分在公平交易执行中各司其职，投资研究部不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享受公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境，交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保定期基金会在二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善公平交易分析系统，在事后加入了严格的监控、评估、分析评价以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金及其它投资组合之间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量5%的交易(全复制型基金除外)。

4.4 报告期内基金的绩效评价

根据中国证监会颁布的《证券投资基金评价办法》，《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施<公开募集证券投资基金监督管理办法>有关问题的规定》等法规及信诚基金管理有限公司以下简称“信诚基金管理人”旗下部分基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，自2015年8月1日起，本基金名称变更为“信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)”，基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

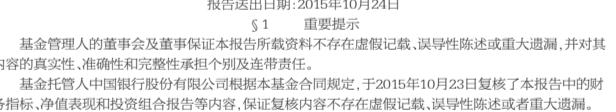
| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|-------------------|---------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 68,859,576,28 | 80.89 |
| 其中:股票 | | 68,859,576,28 | 80.89 |
| 2 固定收益投资 | | - | - |
| 其中:债券 | | - | - |
| 货币市场基金 | | - | - |
| 3 贵金属投资 | | - | - |
| 4 货币衍生品投资 | | - | - |
| 5 买入返售金融资产 | | - | - |
| 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | | - | - |
| 6 银行存款和结算备付金合计 | 13,562,980.89 | 1.86 | |
| 7 其他资产 | 266,238.00 | 0.04 | |
| 8 合计 | 72,768,801.05 | 100.00 | |

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示数字。
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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金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 | 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 |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|
| 过去六个月 | -12.30% | 0.30% | -1.81% | 0.05% |

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:本基金转型日期为2015年4月13日，截至报告期末，本基金未满一年。

2.本基金建仓日自2012年4月13日至2012年12月31日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.4 管理人报告

3.4.1 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。

基金托管人和基金管理人根据有关法律法规的规定，于2015年10月23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财产，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

| 基金简称 | 信诚深混 |
|-------------------|---|
| 场内简称 | 信诚深混 |
| 基金代码 | 166617 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,200,164.20份 |
| 投资目标 | 通过公司深入的研究，深入剖析股票价值被低估的原因，从而挖掘具有深度价值的股票，以力求获得超额的长期回报。 |
| 投资策略 | 本基金定位于混合型基金，其购买资产主要以股票为主，并不进行市场的中期变化而操作。本基金的经理是理性的投资决策者，根据对市场价格低于内在公允价值的股票，本基金的操作“百折而不挠”，但同时也结合行业研究分析以及对宏观经济的判断，在不同的市场条件下，本基金将在一定范围内操作成股票型基金和债券型基金，以期达到最佳的收益。 |
| § 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(2015年7月1日至2015年9月30日) |
| 1.本期已实现收益 | -22,408,996.68 |
| 2.本期利润 | -47,380,362.36 |
| 3.期初基金份额总额 | -10,839.00 |
| 4.期末基金份额净值 | 71,834,306.08 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.431 |

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示数字。
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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金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 | 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 |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|
| 过去六个月 | -12.30% | 0.30% | -1.81% | 0.05% |

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:1.本基金转型日期为2015年4月13日，截至报告期末，本基金未满一年。

2.本基金建仓日自2012年4月13日至2012年12月31日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.4 管理人报告

3.4.1 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。

基金托管人和基金管理人根据有关法律法规的规定，于2015年10月23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财产，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

| 基金简称 | 信诚深混 |
|--------|------|
| 场内简称</ | |