

信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

[2015] 第四季度报告

2015年第四季度报告

2015年12月31日
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
报告送达日期:2016年1月22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基金合同的约定，于2016年1月21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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信诚深度价值混合(LOF)
场内简称	信诚深值
基金主代码	166308
基金的运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月6日
报告期末基金资产净值	61,062,062.02
投资目标	通过对行业基本面的研究，深入分析股票价值被低估的原因，从而挖掘具有深度价值的股票，以求获得资本的长期增值。
投资策略	本基金将主要投资于具有稳定增长的行业，同时精选具有行业领导地位的公司，通过深入的行业研究，挖掘具有深度价值的股票，以求获得资本的长期增值。
业绩比较基准	上证180指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合基金，其预期风险和预期收益水平介于货币基金和股票基金，低于股票基金，属于证券投资基金中的中等风险、中等收益品种。
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

注:本基金管理人2015年9月28日发布公告，自2015年10月1日本基金业绩比较基准由“上证180指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)				
1.本期实现收益	13,483,196.74			
2.本期利润	41,132,407.18			
3.期初至报告期利润本期利润	7,076.90			
4.期末未分配利润	111,710,266.14			2,036
5.期末可供分配利润	101,206,642.60			90.00

注:1、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。

2、自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“上证180指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

§ 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

邓伟 基金经理助理、基金经理、信诚基金管理有限公司基金经理 2008年10月至2009年8月担任华泰证券资产管理有限公司研究员，2009年9月至2010年6月担任信诚基金管理有限公司基金经理助理，2010年7月担任信诚基金管理有限公司基金经理，2010年7月至今担任信诚基金管理有限公司基金经理助理，2011年4月至今担任信诚基金管理有限公司基金经理。

注:1.上述任职日期、任期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《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的情况说明

在本报告期内，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《信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚深度价值混合型证券投资基金(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以实际落实公平交易管理制度的各项要求。各部在公平交易执行中各司其职，投资研究部门不断研究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，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易用系统，以及其它的风控措施，确保各基金在一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，在事后加强了严格的监控、分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，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

本基金本报告期内未发现基金与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量超过该证券当日成交量5%的交易或完全复制的指数基金除外。

4.4 报告期内基金的证券投资策略和运作分析

股市在二季报季末出现大幅下跌，市场在三季度触底，随后出现反弹。4季度上证指数上涨15.9%，创业板上涨30.3%，其间指数大幅震荡，市场结构性行情特征明显。在这一轮反弹行情中，热点不多，只有少数股票表现较好。本基金及时预测反弹行情，并在3季度末调整了行业组合，增加了军工、传媒、计算机等行业的配置，在季报中净申购比例表现较好。

4.5 报告期内基金的净值表现

本基金本报告期内基金净值增长率率为5.290%，同期业绩比较基准收益率为11.51%，基金超越业绩比较基准41.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期内，基金持有人数或基金份额净值低于五千元/基金份额持有人数量不满

两百人)的情形。

§ 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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 101,206,642.60 99.77

2 固定收益投资 101,206,642.60 99.77

3 货币市场基金 - -

4 货币资产 - -

5 买入返售金融资产 - -

其中:质押式回购的买入返售金融资产 - -

6 衍生工具 - -

7 其他资产 434,646.07 0.37

8 合计 116,640,976.68 100.00

注:1、本基金资产组合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、本期已实现收益指本基金利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 6.200% 2.26% 11.51% 1.28% 41.39% 1.28%

3.2.2 本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。

2、自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准由“上证180指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

§ 6 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

邓伟 基金经理助理、基金经理、信诚基金管理有限公司基金经理 2008年10月至2009年8月担任华泰证券资产管理有限公司研究员，2009年9月至2010年6月担任信诚基金管理有限公司基金经理助理，2010年7月担任信诚基金管理有限公司基金经理，2010年7月至今担任信诚基金管理有限公司基金经理助理，2011年4月至今担任信诚基金管理有限公司基金经理。

注:1.上述任职日期、任期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《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的情况说明

在本报告期内，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《信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚深度价值混合型证券投资基金(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以实际落实公平交易管理制度的各项要求。各部在公平交易执行中各司其职，投资研究部门不断研究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，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易用系统，以及其它的风控措施，确保各基金在一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，在事后加强了严格的监控、分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，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

本基金本报告期内未发现基金与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量超过该证券当日成交量5%的交易或完全复制的指数基金除外。

4.4 报告期内基金的证券投资策略和运作分析

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《信诚基金公平交易管理制度》，公司采取了一系列的行动以实际落实公平交易管理制度的各项要求。各部在公平交易执行中各司其职，投资研究部门不断研究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，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易用系统，以及其它的风控措施，确保各基金在一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，在事后加强了严格的监控、分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.5 报告期内基金的净值表现

本基金本报告期内基金净值增长率率为5.290%，同期业绩比较基准收益率为11.51%，基金超越业绩比较基准41.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期内，基金持有人数或基金份额净值低于五千元/基金份额持有人数量不满

两百人)的情形。

§ 7 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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 101,206,642.60 99.77

2 固定收益投资 101,206,642.60 99.77

3 货币市场基金 - -

4 货币资产 - -

5 买入返售金融资产 - -

其中:质押式回购的买入返售金融资产 - -

6 衍生工具 - -

7 其他资产 434,646.07 0.37

8 合计 116,640,976.68 100.00

注:1、本基金资产组合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、本期已实现收益指本基金利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 3.19% 0.11% 2.41% 0.03% 0.78% 0.03%

3.2.2 本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。