

信诚优质纯债债券型证券投资基金

[2017]第一季度报告

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送达日期:2017年4月21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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月20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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

报告书中的财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 信诚优质纯债债券型证券投资基金

基金主代码 650018

基金托管方式 银行的托管方式

基金合同生效日 2013年2月7日

报告期基金资产总额 430,561,1972.00元

报告期基金目标 在严格控制风险的基础上，本基金主要通过投资于精选的优质债券，力求实现基金资产的长期稳定增值。

报告书中的财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 信诚优质纯债债券型证券投资基金报告期2017年1月1日至2017年3月31日

1.本期已实现收益 1,122,303.13

2.期初可供分配利润 10,669.67

3.本期可供分配利润本期利润 0.0000

4.期末可供分配利润 150,583,800.34

5.期末可供分配利润 1,062

注:1.上述基金业绩指标不包括持有认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示的数字。

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.基金的业绩表现指标

3.1 本基金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

信诚优质纯债债券A

阶段 净值增长率① -0.10% 净值增长率标准差② -0.00% 业绩比较基准收益率③ -0.13% 业绩比较基准收益率标准差④ 0.00% ①-③ -0.03% ②-④ 0.00%

信诚优质纯债债券B

阶段 净值增长率① -0.10% 净值增长率标准差② -0.00% 业绩比较基准收益率③ -0.13% 业绩比较基准收益率标准差④ 0.00% ①-③ -0.03% ②-④ 0.00%

3.2 本基金合同生效以来本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

信诚优质纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.00% 净值增长率标准差② 0.00% 业绩比较基准收益率③ 0.00% 业绩比较基准收益率标准差④ 0.00%

信诚优质纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.00% 净值增长率标准差② 0.00% 业绩比较基准收益率③ 0.00% 业绩比较基准收益率标准差④ 0.00%

注:1.本基金建仓期自2013年2月7日至2013年8月6日，建仓日结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

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

3.3 其他指标

§ 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时间 证券从业年限 说明

王丽丽 基金经理,信诚基金管理有限公司基金经理,信诚基金管理有限公司基金经理,信诚基金管理有限公司基金经理,信诚基金管理有限公司基金经理

2014年2月1日 - 17

注:1.上述人员情况，尚未经基金托管人复核。

2.本基金的业绩表现遵从《信诚优质纯债债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本基金实行信用、勤勉尽责的内部控制制度，加强内部管理，勤勉尽责的运用基金资产，本基金管理人不承诺基金一定盈利，也不保证最低收益。

3.本基金的业绩表现遵从《信诚优质纯债债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本基金实行信用、勤勉尽责的内部控制制度，加强内部管理，勤勉尽责的运用基金资产，本基金管理人不承诺基金一定盈利，也不保证最低收益。

4.2 管理人对报告期内本基金运作揭示信息的说明

在报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《信诚优质纯债债券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运用基金资产，本基金管理人不承诺基金一定盈利，也不保证最低收益。

5.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会发布的《证券投资基金公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《信诚基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列的行动来实现公平交易的原则，各部分在公平交易执行中各司其职，投资研究部不断改善研究方法和决策流程，确保各组合投资有公平的平等待遇；建立公平交易的管理制度，交易执行环节严格执行公平交易制度，公平交易制度执行情况良好，未发现不公平交易和利益输送行为。

5.2 公平交易执行的定期报告

根据《信诚基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列的行动来实现公平交易的原则，各部分在公平交易执行中各司其职，投资研究部不断改善研究方法和决策流程，确保各组合投资有公平的平等待遇；建立公平交易的管理制度，交易执行环节严格执行公平交易制度，公平交易制度执行情况良好，未发现不公平交易和利益输送行为。

5.3 其他指标

§ 5 备查文件目录

1.备查文件目录

2.基金合同

3.托管协议

4.招募说明书

5.基金产品资料概要

6.基金定期报告

7.临时公告及信息披露文件

8.基金份额净值公告

9.季度报告

10.半年度报告

11.年度报告

12.基金上市交易公告书

13.基金临时公告

14.基金清算报告

15.基金信息披露文件

16.基金销售机构信息

17.基金销售费用

18.基金募集申请表

19.基金募集申请表

20.基金募集申请表

21.基金募集申请表

22.基金募集申请表

23.基金募集申请表

24.基金募集申请表

25.基金募集申请表

26.基金募集申请表

27.基金募集申请表

28.基金募集申请表

29.基金募集申请表

30.基金募集申请表

31.基金募集申请表

32.基金募集申请表

33.基金募集申请表

34.基金募集申请表

35.基金募集申请表

36.基金募集申请表

37.基金募集申请表

38.基金募集申请表

39.基金募集申请表

40.基金募集申请表

41.基金募集申请表

42.基金募集申请表

43.基金募集申请表

44.基金募集申请表

45.基金募集申请表

46.基金募集申请表

47.基金募集申请表

48.基金募集申请表

49.基金募集申请表

50.基金募集申请表

51.基金募集申请表

52.基金募集申请表

53.基金募集申请表

54.基金募集申请表

55.基金募集申请表

56.基金募集申请表

57.基金募集申请表

58.基金募集申请表

59.基金募集申请表

60.基金募集申请表

61.基金募集申请表

62.基金募集申请表

63.基金募集申请表

64.基金募集申请表

65.基金募集申请表

66.基金募集申请表

67.基金募集申请表

68.基金募集申请表

69.基金募集申请表

70.基金募集申请表

71.基金募集申请表

72.基金募集申请表

73.基金募集申请表

74.基金募集申请表

75.基金募集申请表

76.基金募集申请表

77.基金募集申请表

78.基金募集申请表

79.基金募集申请表

80.基金募集申请表

81.基金募集申请表

82.基金募集申请表

83.基金募集申请表

84.基金募集申请表

85.基金募集申请表

86.基金募集申请表

87.基金募集申请表

88.基金募集申请表

89.基金募集申请表

90.基金募集申请表

91.基金募集申请表

92.基金募集申请表

93.基金募集申请表

94.基金募集申请表

95.基金募集申请表

96.基金募集申请表

97.基金募集申请表

98.基金募集申请表

99.基金募集申请表

100.基金募集申请表

101.基金募集申请表

102.基金募集申请表

103.基金募集申请表

104.基金募集申请表

105.基金募集申请表

106.基金募集申请表