

信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF)

2012 第四季度 报告

2012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
报告送出日期:2013年1月22日

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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告中财务资料截止于2012年10月31日,净值资料截止于2012年12月31日。

基金产品概况
信诚深度价值股票(LOF)场内简称:信诚深度

基金代码:165308
场内简称:165308
基金运作方式:契约型上市开放式

基金合同生效日期:2010年7月30日
基金份额总额:188,780,992.58份

投资目标:通过积极主动的资产配置,深入研究,发掘具备成长潜力的优质股票,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争获取长期增值。

投资策略:本基金定位为股票型基金,其战略资产配置以股票为主,并不因市场的中短期波动而改变。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。

业绩比较基准:80%*上证180指数收益率+20%*中债综合指数收益率

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
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年10月1日至2012年12月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值.

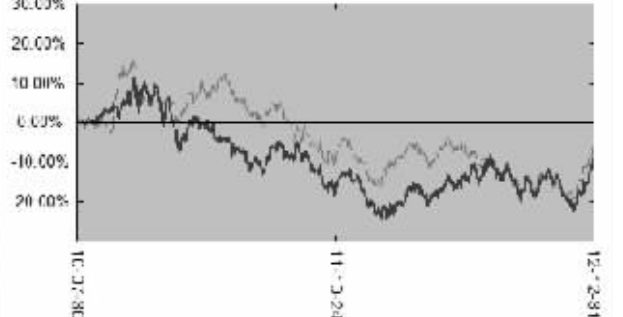
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

Table with 5 columns: 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. Rows include 2012年第四季度.

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合同规定。

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 从业年限 说明

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 从业年限, 说明. Rows include 王斌, 王斌, 2011年9月8日, 4, 曾任华夏基金有限资产管理公司高级分析师, 2008年7月加入信诚基金管理有限公司, 现任高级分析师。

注:1.上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任职日期。

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,本基金运作合法合规,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(12)》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有与交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过证监会规定当日成交5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内本基金的投资策略和运作分析:积极寻找具有深度价值的个股和个股,坚持寻找具有较高成长性的行业和公司作为投资重点。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

本报告期末基金份额净值为6.34%,同期业绩比较基准收益率为10.18%,落后业绩基准3.84%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 资产配置报告

5.3 投资组合报告

5.4 投资组合报告

5.5 投资组合报告

5.6 投资组合报告

5.7 投资组合报告

5.8 投资组合报告

5.9 投资组合报告

5.10 投资组合报告

5.11 投资组合报告

5.12 投资组合报告

5.13 投资组合报告

5.14 投资组合报告

5.15 投资组合报告

5.16 投资组合报告

5.17 投资组合报告

5.18 投资组合报告

5.19 投资组合报告

5.20 投资组合报告

5.21 投资组合报告

5.22 投资组合报告

5.23 投资组合报告

5.24 投资组合报告

5.25 投资组合报告

5.26 投资组合报告

5.27 投资组合报告

5.28 投资组合报告

5.29 投资组合报告

5.30 投资组合报告

5.31 投资组合报告

5.32 投资组合报告

5.33 投资组合报告

5.34 投资组合报告

5.35 投资组合报告

5.36 投资组合报告

5.37 投资组合报告

5.38 投资组合报告

5.39 投资组合报告

5.40 投资组合报告

5.41 投资组合报告

5.42 投资组合报告

5.43 投资组合报告

5.44 投资组合报告

5.45 投资组合报告

5.46 投资组合报告

5.47 投资组合报告

5.48 投资组合报告

5.49 投资组合报告

5.50 投资组合报告

5.51 投资组合报告

5.52 投资组合报告

5.53 投资组合报告

5.54 投资组合报告

5.55 投资组合报告

5.56 投资组合报告

5.57 投资组合报告

5.58 投资组合报告

5.59 投资组合报告

5.60 投资组合报告

5.61 投资组合报告

5.62 投资组合报告

5.63 投资组合报告

5.64 投资组合报告

5.65 投资组合报告

5.66 投资组合报告

5.67 投资组合报告

5.68 投资组合报告

5.69 投资组合报告

5.70 投资组合报告

5.71 投资组合报告

5.72 投资组合报告

5.73 投资组合报告

5.74 投资组合报告

5.75 投资组合报告

5.76 投资组合报告

5.77 投资组合报告

5.78 投资组合报告

5.79 投资组合报告

5.80 投资组合报告

5.81 投资组合报告

5.82 投资组合报告

5.83 投资组合报告

5.84 投资组合报告

5.85 投资组合报告

5.86 投资组合报告

5.87 投资组合报告

5.88 投资组合报告

5.89 投资组合报告

5.90 投资组合报告

5.91 投资组合报告

5.92 投资组合报告

5.93 投资组合报告

5.94 投资组合报告

5.95 投资组合报告

5.96 投资组合报告

5.97 投资组合报告

5.98 投资组合报告

5.99 投资组合报告

5.100 投资组合报告

5.101 投资组合报告

5.102 投资组合报告

5.103 投资组合报告

5.104 投资组合报告

5.105 投资组合报告

5.106 投资组合报告

5.107 投资组合报告

5.108 投资组合报告

5.109 投资组合报告

5.110 投资组合报告

5.111 投资组合报告

5.112 投资组合报告

5.113 投资组合报告

5.114 投资组合报告

5.115 投资组合报告

5.116 投资组合报告

5.117 投资组合报告

5.118 投资组合报告

5.119 投资组合报告

5.120 投资组合报告

5.121 投资组合报告

5.122 投资组合报告

5.123 投资组合报告

5.124 投资组合报告

5.125 投资组合报告

5.126 投资组合报告

5.127 投资组合报告

5.128 投资组合报告

5.129 投资组合报告

5.130 投资组合报告

5.131 投资组合报告

5.132 投资组合报告

5.133 投资组合报告

5.134 投资组合报告

5.135 投资组合报告

5.136 投资组合报告

5.137 投资组合报告

5.138 投资组合报告

5.139 投资组合报告

5.140 投资组合报告

5.141 投资组合报告

5.142 投资组合报告

5.143 投资组合报告

5.144 投资组合报告

5.145 投资组合报告

5.146 投资组合报告

5.147 投资组合报告

5.148 投资组合报告

5.149 投资组合报告

5.150 投资组合报告

5.151 投资组合报告

5.152 投资组合报告

5.153 投资组合报告

5.154 投资组合报告

5.155 投资组合报告

5.156 投资组合报告

5.157 投资组合报告

5.158 投资组合报告

5.159 投资组合报告

5.160 投资组合报告

5.161 投资组合报告

5.162 投资组合报告

5.163 投资组合报告

5.164 投资组合报告

5.165 投资组合报告

5.166 投资组合报告

5.167 投资组合报告

5.168 投资组合报告

5.169 投资组合报告

5.170 投资组合报告

5.171 投资组合报告

5.172 投资组合报告

5.173 投资组合报告

5.174 投资组合报告

5.175 投资组合报告

5.176 投资组合报告

5.177 投资组合报告

5.178 投资组合报告

5.179 投资组合报告

5.180 投资组合报告

5.181 投资组合报告

5.182 投资组合报告

5.183 投资组合报告

5.184 投资组合报告

5.185 投资组合报告

5.186 投资组合报告

5.187 投资组合报告

5.188 投资组合报告

5.189 投资组合报告

5.190 投资组合报告

5.191 投资组合报告

5.192 投资组合报告

5.193 投资组合报告

5.194 投资组合报告

5.195 投资组合报告

5.196 投资组合报告

5.197 投资组合报告

5.198 投资组合报告

5.199 投资组合报告

5.200 投资组合报告

5.201 投资组合报告

5.202 投资组合报告

5.203 投资组合报告

5.204 投资组合报告

5.205 投资组合报告

5.206 投资组合报告

5.207 投资组合报告

5.208 投资组合报告

5.209 投资组合报告

5.210 投资组合报告

5.211 投资组合报告

5.212 投资组合报告

5.213 投资组合报告

5.214 投资组合报告

5.215 投资组合报告

5.216 投资组合报告

5.217 投资组合报告

5.218 投资组合报告

5.219 投资组合报告

5.220 投资组合报告

5.221 投资组合报告

5.222 投资组合报告

5.223 投资组合报告

5.224 投资组合报告

5.225 投资组合报告

5.226 投资组合报告

5.227 投资组合报告

5.228 投资组合报告

5.229 投资组合报告

5.230 投资组合报告

5.231 投资组合报告