

信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月25日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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10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,投资者投资于本基金面临的风险详见本报告的风险揭示章节。
本报告所载数据截至2013年9月30日止。

1.2 基金产品概况

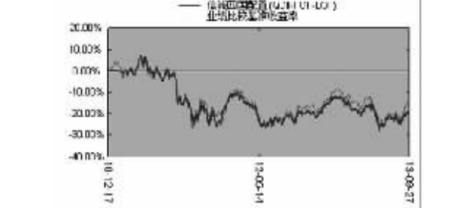
Table with 2 columns: 基金名称 (信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)), 基金代码 (165510), 上市开始方式 (上市开放式基金), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2010年9月29日), 报告期末基金份额总额 (2,266,065,663.27), 投资目标 (本基金在严格控制风险的基础上,通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益,力争实现基金资产的长期稳定增值。), 投资策略 (资产配置策略:本基金资产配置和地区配置两个维度,在宏观大类资产配置策略上,本基金根据对全球主要经济体宏观经济形势、政策走向、估值水平、市场情绪、行业景气度、企业盈利、利率水平、汇率水平、大宗商品价格走势等因素的综合分析,动态调整资产配置比例,在微观个股选择上,本基金采取自下而上的策略,在符合基金合同约定的前提下,选择具有良好成长性和估值优势的个股进行投资。), 业绩比较基准 (金砖四国主要市场综合指数收益率), 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,低于混合型基金和股票型基金。), 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), 境外投资顾问 (英文名称:Emping Investment (Singapore) Limited; 中文名称:盈平投资管理(新加坡)有限公司), 境外资产托管人 (英文名称:Bank of China (Hong Kong) Limited; 中文名称:中国银行(香港)有限公司)

1.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日). Rows include: 1.本期已实现收益 (-64,816.92), 2.本期利润 (2,824,853.69), 3.加权平均基金份额本期利润 (0.0453), 4.期末基金份额净值 (1.0286), 5.期末基金资产净值 (2,266,065,663.27), 6.期末基金份额持有人数 (6,986).

注:1.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。
2.本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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.



注:本基金合同自2010年12月17日至2011年6月16日建仓期按照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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes: 刘黎明 (2010年12月17日 -), 王刚 (2013年1月18日 -), Kevin Blacklock (2013年9月22日 -), Nicholas Ferns (2013年9月22日 -).

注:1.上述人员任职日期指本基金管理人对外披露的任职日期。
2.证券从业的含义按照国家证监会《证券投资基金销售人员资格管理规定》的相关规定。
4.2 境外投资顾问的基本情况

Table with 5 columns: 姓名, 在境外投资顾问的职务, 证券从业资格, 说明. Includes: Kevin Blacklock (Global Fund Advisor), Nicholas Ferns (Global Fund Advisor).

4.3 报告期内本基金运作情况说明
4.4 公平交易专项说明
4.4.1 公平交易制度的执行情况
4.4.2 公平交易专项说明

4.5 报告期内本基金投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (12,632,415.53), 2. 固定收益 (12,632,415.53), 3. 银行存款 (36,708,238.04), 4. 买入返售金融资产 (30,708,238.04), 5. 应收利息 (4,551,879.99), 6. 其他资产 (28,548.81), 7. 负债 (48,126,078.17).

Table with 2 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%). Rows include: 信息技术 (3,514,000.63), 金融地产 (2,893,445.19), 消费品 (1,790,371.53), 工业 (1,702,268.09), 非必需消费品 (1,520,003.95), 其他 (1,018,342.55), 债券 (508,348.58), 必需消费品 (468,123.15), 材料 (96,579.89), 合计 (12,632,415.53).

注:本基金持有的股票及存托凭证采用行业分类和全球行业分类标准(GICS)进行分类。
5.4 投资组合报告
5.4.1 报告期末公允价值占基金资产净值比例前十大重仓股

Table with 7 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司简称(中文), 证券代码, 所属证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. CHINA MERCHANTS BHK-H, 2. CHINA LONGYUAN-H, 3. GREAT WALL MOTOR, 4. WHEQAO TEXTILE CO-H, 5. YY INC-ADR, 6. HUANENG RENEWABLES COMPT LTD/HONG KONG, 7. ZTE CORP-H, 8. SINO BIOPHARMACEUTICAL, 9. TONG REN TANG-H, 10. SEMICONDUCTOR MFC.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:1.上述人员任职日期指本基金管理人对外披露的任职日期。
2.证券从业的含义按照国家证监会《证券投资基金销售人员资格管理规定》的相关规定。
4.2 境外投资顾问的基本情况

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes: 王知顺 (2010年9月29日 -), 刘黎明 (2010年12月17日 -), 王刚 (2013年1月18日 -), Kevin Blacklock (2013年9月22日 -), Nicholas Ferns (2013年9月22日 -).

注:1.上述人员任职日期指本基金管理人对外披露的任职日期。
2.证券从业的含义按照国家证监会《证券投资基金销售人员资格管理规定》的相关规定。
4.2 境外投资顾问的基本情况

4.3 报告期内本基金运作情况说明
4.4 公平交易专项说明
4.4.1 公平交易制度的执行情况
4.4.2 公平交易专项说明

4.5 报告期内本基金投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (12,632,415.53), 2. 固定收益 (12,632,415.53), 3. 银行存款 (36,708,238.04), 4. 买入返售金融资产 (30,708,238.04), 5. 应收利息 (4,551,879.99), 6. 其他资产 (28,548.81), 7. 负债 (48,126,078.17).

Table with 2 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%). Rows include: 信息技术 (3,514,000.63), 金融地产 (2,893,445.19), 消费品 (1,790,371.53), 工业 (1,702,268.09), 非必需消费品 (1,520,003.95), 其他 (1,018,342.55), 债券 (508,348.58), 必需消费品 (468,123.15), 材料 (96,579.89), 合计 (12,632,415.53).

注:本基金持有的股票及存托凭证采用行业分类和全球行业分类标准(GICS)进行分类。
5.4 投资组合报告
5.4.1 报告期末公允价值占基金资产净值比例前十大重仓股

Table with 7 columns: 序号, 公司名称(英文), 公司简称(中文), 证券代码, 所属证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. CHINA MERCHANTS BHK-H, 2. CHINA LONGYUAN-H, 3. GREAT WALL MOTOR, 4. WHEQAO TEXTILE CO-H, 5. YY INC-ADR, 6. HUANENG RENEWABLES COMPT LTD/HONG KONG, 7. ZTE CORP-H, 8. SINO BIOPHARMACEUTICAL, 9. TONG REN TANG-H, 10. SEMICONDUCTOR MFC.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.

注:本基金以上述前十大重仓股为限,披露其公允价值占基金资产净值比例。
5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1. 权益投资 (741,353,413.30), 2. 其中:沪市 (741,353,413.30), 3. 资产支持证券 (78,113,457.17), 4. 其他 (1,591,044,818.95), 5. 其他资产 (54,632,748.29), 6. 合计 (2,491,144,151.71).

Table with 2 columns: 序号, 报告期末基金份额净值, 项目, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1. 报告期末基金份额净值 (1.0286), 2. 报告期末基金份额净值增长率 (0.0453), 3. 报告期末基金份额净值增长率标准差 (0.0046), 4. 报告期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较 (0.0453 vs 0.0453).

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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及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 for 2013 第三季度 and 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的比较.