信诚添金分级债券型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚添金分级债券	
基金主代码	550017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月12日	
报告期末基金份额总额	1,286,819,384.99份	
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争追求超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率	
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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	信诚季季添金	信诚岁岁添金
下属两级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属两级基金的份额总额	359,604,330.60份	927,215,054.39份
下属两级基金的风险收益特征	季季添金分额为低风险、收益相对稳定的基金分额	岁岁添金分额为中高风险、中高收益的基金分额

§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

主要财务指标	报告期（2013年7月1日至2013年9月30日）
1.本期已实现收益	28,806,121.00
2.本期利润	-7,474,989.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0035
4.期末基金资产净值	1,334,884,571.28
5.期末基金份额净值	1.037

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。

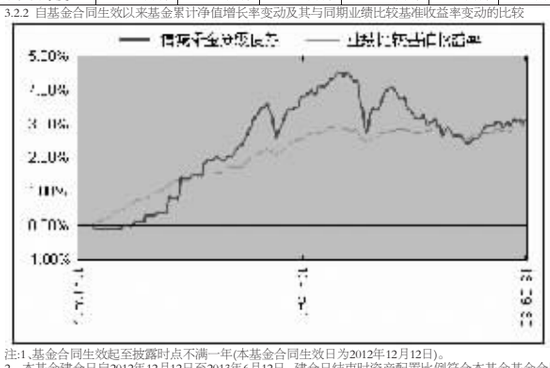
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	①-③	②-④
2013年第3季度	-0.30%	0.10%	0.35%	0.04%	-0.65%	0.06%

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、基金合同生效起至披露时点不满一年(本基金合同生效日为2012年12月12日)。

2、本基金建仓日自2012年12月12日至2013年6月12日，建仓日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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王国强	本基金基金经理,信诚三得益债券基金及信诚理财7日盈债券基金基金经理	2012年12月12日	-	14	管理学硕士,14年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚三得益债券基金、信诚理财7日盈债券基金以及信诚添金分级债券基金的基金经理。
王旭巍	本基金基金经理、信诚增强收益债券(LOF)基金和信诚新双盈分级债券基金基金经理,信诚基金管理有限公司副首席投资官、固定收益总监	2013年1月15日	-	19	经济学硕士,19年金融、证券、基金行业从业经验。曾先后任职于中国(深圳)物资工贸集团有限公司大连期货部、宏达期货经纪有限公司、中信证券资产管理部和华宝兴业基金管理有限公司。2010年加盟信诚基金管理有限公司,现任公司副首席投资官、固定收益总监。

注:1.上述任职日期、离任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《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。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《证券投资基金管理公司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v1.2》,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。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断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相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,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 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长企稳回升,投资、出口微幅回升,消费增长平稳,物价小幅上行,通胀压力不大。货币政策总体上中性偏紧,流动性紧张的局面相对于二季度末有所缓解,但是资金利率总体水平仍然较高。本季度债券呈震荡调整态势,前跌后涨,本季度前期,受流动性偏紧和监管风暴的持续发酵影响,跌幅较深,本季度后期则随着资金面的改善,债券利率小幅下行,价格上涨。本季度产业债信用风险较为突出,部分行业和领域的企业经营出现恶化,信用评级下调,收益率大幅上行。债市三季度期间投资收益较低,标普全债指数上涨0.38%,中信标普企债指数上涨0.42%。

三季度,本基金持仓以企业债、公司债、短期融资券等信用债为主,组合久期维持较低水平,规避利率波动风险。6月7日本基金的季季添金份额打开,赎回份额较多,导致三季度初杠杆较高,在市场下跌的情况下,风险有所放大。9月12日,本基金季季添金份额第三次打开,赎回金额仍然较大,导致本基金在本季度末杠杆再次上升。本基金在杠杆二度被动放大的过程中,坚持积极的减仓策略,降低投资风险,首先是减持长久期债券,缩短久期,降低利率波动风险,其次是降低信用风险,通过严格的内部信用评级体系,甄别信用风险,减持信用风险较高的债券品种,出清信用风险较为突出的行业的债券,如钢铁、电解铝、煤化工等行业的债券;再次是减持风险收益特征上性价比较低的品种。本基金对可转债投资较为审慎,参与较少。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本季度本基金母基金比较基准收益率为0.35%,本基金份额净值增长率为-0.30%,落后基准0.65%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,653,809,000.81	93.79
	其中:债券	2,653,809,000.81	93.79
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	9,900,134.85	0.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	58,220,237.13	2.06
6	其他资产	107,484,550.64	3.80
7	合计	2,829,413,923.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	69,780,000.00	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,330,298,356.97	174.57
5	企业短期融资券	160,462,000.00	12.02
6	中期票据	60,050,000.00	4.50
7	可转债	33,218,643.84	2.49
8	其他	-	-
9	合计	2,653,809,000.81	198.80

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122621	12赣城债	760,620	76,632,465.00	5.74
2	122891	10通辽债	657,640	64,777,540.00	4.85
3	122588	12益城投	600,010	62,551,042.50	4.69
4	124095	12六开投	600,000	60,840,000.00	4.56
5	122702	12海安债	500,000	52,800,000.00	3.96

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.8.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.9.3本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.10投资组合报告附注

5.10.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	574,659.80
2	应收证券清算款	29,999,976.60
3	应收股利	-
4	应收利息	76,909,914.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,484,550.64

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	32,801,100.00	2.46

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚季季添金	信诚岁岁添金
报告期期初基金份额总额	1,378,851,789.18	927,215,054.39
报告期期间基金总申购份额	9,830,733.31	-
减:报告期期间基金总赎回份额	1,044,468,441.93	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	15,390,250.04	-
报告期期末基金份额总额	359,604,330.60	927,215,054.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本封闭式基金。

§8 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚添金分级债券型证券投资基金相关批准文件
2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同
4、信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书
5、本报告期内按照规定披露的各项公告

9.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2013年10月25日

信诚精萃成长股票型证券投资基金

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 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本基金合同规定，于2013年7月12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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚精萃成长股票
基金主代码	550002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月27日
报告期末基金份额总额	5,354,191,606.63份
投资目标	本基金通过考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘具备长期稳定成长潜力的上市公司,以实现基金资产的长期增值和风险调整后的超额收益。
投资策略	本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。在实际投资过程中,本基金将根据满足本基金选股标准的股票的数量、估值水平、股票资产相对于无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产,调整本基金股票的投资比重。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+15%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	作为一只股票型基金,本基金的资产配置确立了本基金较高回报、较高风险的产品特征。
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 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

主要财务指标	报告期（2013年7月1日至2013年9月30日）
1.本期已实现收益	96,615,868.43
2.本期利润	356,544,589.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0790
4.期末基金资产净值	2,907,816,010.55
5.期末基金份额净值	0.5431

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。

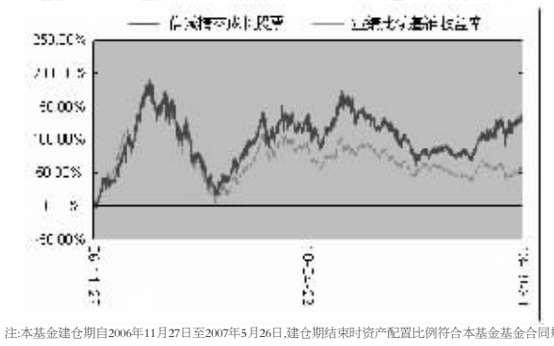
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	①-③	②-④
2013年第3季度	12.80%	1.43%	8.65%	1.11%	4.15%	0.32%

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2006年11月27日至2007年5月26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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谭鹏万	本基金基金经理,信诚深度价值股票(LOF)基金和信诚新兴产业股票基金基金经理	2012年8月28日	-	6	经济学博士,曾任华宝信托有限责任公司高级分析师。2008年7月加入信诚基金管理有限公司。现任信诚新兴产业股票型、信诚深度价值股票型基金和信诚精萃成长股票型基金的基金经理。

注:1.上述任职日期、离任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《信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同》、《信诚精萃成长股票型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。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《证券投资基金管理公司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v1.2》,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。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断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相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,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 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金2013年上半年坚持基金合同的要求,精选个股,挖掘成长,超配了安防、医药、地产、银行、大众消费品、环保、汽车类个股,从成长的角度去把握投资机会,取得了一定的成效。

在经历了一年多时间的反复确认后,市场已经达成共识,即中国已经走上了转型之路,然而如何走,有哪些产业会崛起?市场依然充满很多疑惑。环顾四周,我们发现欧美已经走上了复苏之路,而其他新兴市场国家,很多面临美元外流的压力,中国则鹤立新兴市场国家中。

在这样的背景下,我依然将投资的主要方向集中在转型方向上,同时在中国经济依然健康,结构调整逐步取得进展的情况下,已经出现转折性变化的周期性行业也将出现不错的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额净值为0.5431元,本报告期份额净值增长率为12.80%,同期业绩比较基准收益率为8.65%,基金领先业绩比较基准4.15%。

§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	2,654,517,147.12	90.99
	其中:股票	2,654,517,147.12	90.99
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	261,969,780.06	8.98
6	其他资产	953,835.68	0.03
7	合计	2,917,440,762.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,688,026,659.92	58.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	41,696,230.85	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,017,196.25	2.48
J	金融业	217,190,000.00	7.47
K	房地产业	340,840,000.00	11.72
L	租赁和商务服务业	42,796,757.20	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	190,693,152.90	6.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	30,067,039.80	1.03
S	综合	31,190,110.20	1.07
	合计	2,654,517,147.12	91.29

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	23,981,698	247,011,489.40	8.49
2	002415	海康威视	8,799,949	232,318,653.60	7.99
3	002236	大华股份	4,871,934	222,062,751.72	7.64
4	000024	招商地产	8,400,000	201,600,000.00	6.93
5	300026	红日药业	4,266,791	173,573,057.88	5.97
6	600887	伊利股份	3,126,472	139,690,768.96	4.80
7	600535	天士力	3,005,379	135,302,162.58	4.65
8	600422	昆明制药	4,595,734	123,992,903.32	4.26
9	300070	碧水源	2,711,997	110,378,277.90	3.80
10	600872	中炬高新	8,605,555	86,227,661.10	2.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.8.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.9.3本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.10投资组合报告附注

5.10.1本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	638,394.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111,764.60
5	应收申购款	203,676.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	953,835.68

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,511,054,214.84
报告期期间基金总申购份额	3,032,748,419.27
减:报告期期间基金总赎回份额	2,189,611,027.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,354,191,606.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	红利再投资	2013-09-12	1,746,532.41	-
合计			1,746,532.41	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、信诚精萃成长股票型证券投资基金相关批准文件
2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同
4、信诚精萃成长股票型证券投资基金招募说明书
5、本报告期内按照规定披露的各项公告

8.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2013年10月25日

信诚优质纯债债券型证券投资基金

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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚优质纯债债券	
基金主代码	550018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年2月7日	
报告期末基金份额总额	807,303,106.10份	
投资目标	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,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	1、资产配置策略 本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 2、固定收益类资产的投资策略 (1)类属资产配置策略 在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。 (2)普通债券投资策略 对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。 3、资产支持证券的投资策略 本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	信诚优质纯债债券A	信诚优质纯债债券B
下属两级基金的交易代码	550018	550019
报告期末下属两级基金的份额总额	210,148,582.91份	597,154,523.19份

§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

主要财务指标	信诚优质纯债债券A报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)	信诚优质纯债债券B报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,184,858.62	6,172,405.28
2.本期利润	932,528.02	3,848,203.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0045
4.期末基金资产净值	210,221,683.51	595,478,211.78
5.期末基金份额净值	1.000	0.997

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

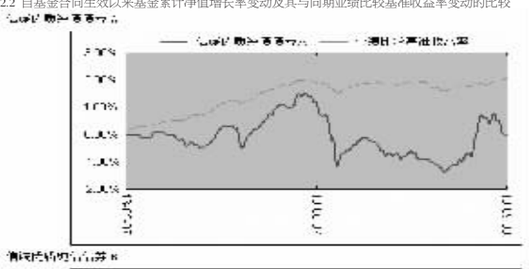
信诚优质纯债债券A

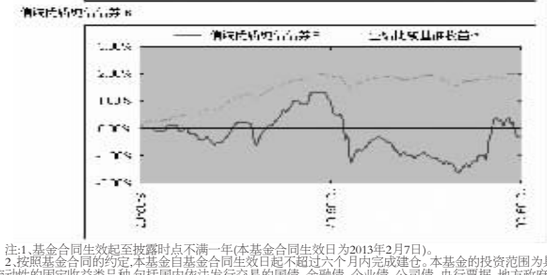
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年第3季度	0.60%	0.16%	0.38%	0.04%	0.22%	0.12%

信诚优质纯债债券B

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	①-③	②-④
2013年第3季度	0.50%	0.15%	0.38%	0.04%	0.12%	0.11%

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、基金合同生效起至披露时点不满一年(本基金合同生效日为2013年2月7日)。

2、按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具,因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过20个交易日的时间内卖出。本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李仲	本基金基金经理,信诚三得益债券基金及信诚经典优债债券基金基金经理	2013年2月7日	-	13	13年证券从业经验。曾任职于宝钢集团财务有限责任公司资金部、宝钢集团有限公司资产部、宝岛(香港)贸易有限公司、华宝信托有限责任公司。2011年4月加入信诚基金管理有限公司。、

注:1.上述任职日期、离任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《信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同》、《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、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。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《证券投资基金管理公司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v1.2》,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。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断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相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析