鑫元货币市场基金

2014 第一季度 报告

2014 年 3 月 31 日

基金管理人:鑫元基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014 年 4 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 4 月 16 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 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鑫元货币	
交易代码	000483	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年 12 月 30 日	
报告期末基金份额总额	1,264,744,155.84 份	
投资目标	本基金将在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	1、整体资产配置策略 本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测;在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例;在此框架之下,通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。 2、类属配置策略 类属配置是指基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断,采用相对价值和信用利差策略,挖掘不同类别金融工具的差异化投资价值,合理配置并灵活调整不同类属债券在组合中的构成比例,形成合理组合以实现稳定的投资收益。 3、个券选择策略 在确定债券平均组合久期、期限结构配置和类属配置的基础上,对影响个别债券定价的主要因素,包括信用风险、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析,有限选择央票、短期国债等高等级债券品种以规避违约风险,在此基础上通过拟合收益率曲线寻找定价低估、收益率偏高的券种进行重点关注。 4、回购策略 该策略是利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入债券进行正回购,在利用回购融入资金购买收益率较高债券品种,如此循环至回购期结束卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时,基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。基金管理人也将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。 5、收益率曲线策略 根据债券市场收益率曲线的动态变化以及隐含的即期利率和远期利率提供的价值判断基础,结合对当期和远期资金面的分析,寻求在一段时期内获取因收益率曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。本基金将比较分析子弹策略、哑铃策略和梯形策略等在不同市场环境下的表现,构建优化组合,获取合理收益。	
业绩比较基准	同期活期存款利率 (税后) 本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率 (税后) 作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。 如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险产品。一般情况下,其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	鑫元货币 A	鑫元货币 B
下属两级基金的交易代码	000483	000484
报告期末下属两级基金的份额总额	146,810,346.17 份	1,117,933,809.67 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	报告期 (2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 3 月 31 日)	
	鑫元货币 A	鑫元货币 B
1. 本期已实现收益	5,171,505.53	16,137,691.35
2.本期利润	5,171,505.53	16,137,691.35
3.期末基金资产净值	146,810,346.17	1,117,933,809.67

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.3991%	0.0051%	0.0863%	0.0000%	1.3128%	0.0051%

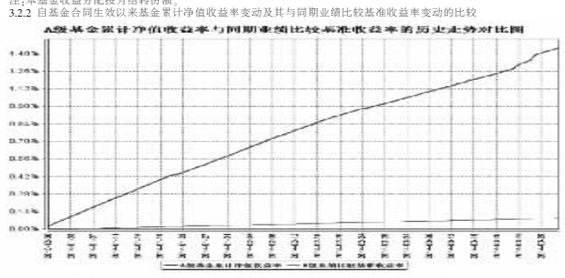
注:本基金收益分配按月结转份额。

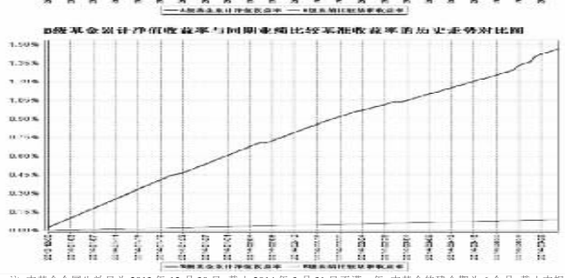
鑫元货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.4345%	0.0059%	0.0863%	0.0000%	1.3482%	0.0059%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金合同生效日为 2013 年 12 月 30 日,截止 2014 年 3 月 31 日不满一年;本基金的建仓期为 6 个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期内,将在 6 个月建仓期结束时,确保各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
张明凯	本基金基金经理、基金投资决策委员会委员	2013年 12 月 30 日	-	6年	学历:数量经济学专业,经济学硕士。从业经历:2008 年 7 月至 2013 年 8 月,任职于南京银行股份有限公司,担任资深信用研究员,精通信用债的行情与风险研判,参与创立了南京银行内部债券信用风险控制体系,对债券市场行情具有较为精准的研判能力。2013 年 8 月加入鑫元基金管理有限公司担任投资研究部信用研究员。自 2013 年 12 月 30 日起担任本基金基金经理。

注:1. 基金的首任基金经理,任职日期为基金合同生效日,离职日期为根据公司决议确定的解聘日期;
2. 非首任基金经理,任职日期和离任日期分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期;
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,基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鑫元货币市场基金基金合同》的规定,基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及公司制度关于公平交易的相关规定,通过完善相应制度及流程,通过系统控制和人工控制等各种方式,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现本基金与公司旗下其他投资组合间存在同向交易与反向交易的情况,未发现有违公平交易要求的其他情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及《鑫元基金管理有限公司投资管理制度》、《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》、《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度,对本基金的异常交易行为进行监督检查。

本报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为,未出现涉及本基金的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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度货币市场利率延续去年末态势处于高位,本基金抓住市场机遇,在报告期初积极配置协议存款。从货币基金的收益走势来看,在报告期内呈现出前高后低,再逐步走高的形态;主要原因系出于流动性考虑,在 2014 年年初配置的协议存款期限大都在 1 个月以内,春节后协议存款利率大幅走低,同时本基金银行间帐户尚未开立,故不能进行债券投资和融资回购,投资范围相对较少,故存在一段时间的真空期。随后本基金按照正常程序于 2 月末申请通过相关资格,开始逐步参与债券投资和融资回购业务,收益在 2 月末开始逐步走高。总体来看,本基金从风险分散的角度出发,配置产品结构合理,把握住了市场机遇,为投资者创造出相对稳定且较为可观的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元货币 A 的基金份额净值收益率为 1.3991%,鑫元货币 B 的基金份额净值收益率为 1.4345%,同期业绩比较基准收益率为 0.0863%。

§ 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	固定收益投资	320,777,949.80	25.02
	其中:债券	320,777,949.80	25.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	367,846,590.77	28.69
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	571,092,482.22	44.54
4	其他资产	22,533,203.91	1.76
5	合计	1,282,250,226.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.58
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	45.76	1.11
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.35	-
2	30天 (含)-60 天	-	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天 (含)-90 天	32.42	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天 (含)-180 天	2.38	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180天 (含)-397 天 (含)	19.04	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.60	1.11

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	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,877,830.73	8.69
	其中:政策性金融债	109,877,830.73	8.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	210,900,119.07	16.68
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	320,777,949.80	25.36
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	29,777,207.13	2.35

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	140204	14国开 04	700,000	70,111,998.78	5.54
2	041351059	13康美 CP002	500,000	50,510,210.70	3.99
3	041464010	14华数 CP001	300,000	30,000,138.67	2.37
4	130215	13国开 15	300,000	29,777,207.13	2.35
5	041351035	13冀衡 CP001	200,000	20,152,655.05	1.59
6	041463005	14青特 CP001	200,000	20,093,736.45	1.59
7	041361047	13渝高科 CP001	200,000	20,080,409.03	1.59
8	041462004	14东方 CP001	200,000	20,000,137.04	1.58
9	041458005	14兰石	200,000	20,000,069.24	1.58
10	071437001	14中银国际 CP001	200,000	19,998,650.10	1.58

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0141%
报告期内偏离度的最低值	-0.0613%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0068%

5.7 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本未超过基金资产净值的 20%。

5.8.3 本报告期内基金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、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,729,809.91
4	应收申购款	13,803,394.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,533,203.91

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鑫元货币 A	鑫元货币 B
报告期期初基金份额总额	804,848,555.21	1,649,853,989.24
报告期期间基金总申购份额	240,946,269.71	1,398,544,442.25
减:报告期期间基金总赎回份额	898,984,478.75	1,930,464,621.82
报告期期末基金份额总额	146,810,346.17	1,117,933,809.67

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准鑫元货币市场基金设立的文件;
2、《鑫元货币市场基金基金合同》;
3、《鑫元货币市场基金基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批复、营业执照;
5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司
2014 年 4 月 19 日

信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)

2014 第一季度 报告

2014 年 3 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:2014 年 4 月 19 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 2014 年 4 月 16 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 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信诚增强收益债券 (LOF) (场内简称:信诚增强)
基金主代码	165509
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内 (含三年)为封闭期,根据本基金基金合同相关约定以及基金份额持有人大会的召开结果,本基金的运作方式已于封闭期届满后转为上市开放式。
基金合同生效日	2010年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	351,239,843.91 份
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	本基金投资组合中债券、股票、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,其战略性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,在一定的范围内作战术性资产配置调整,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 (2014 年 1 月 1 日至 2014 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-10,526,540.54
2.本期利润	3,756,753.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107
4.期末基金资产净值	345,393,160.27
5.期末基金份额净值	0.983

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。

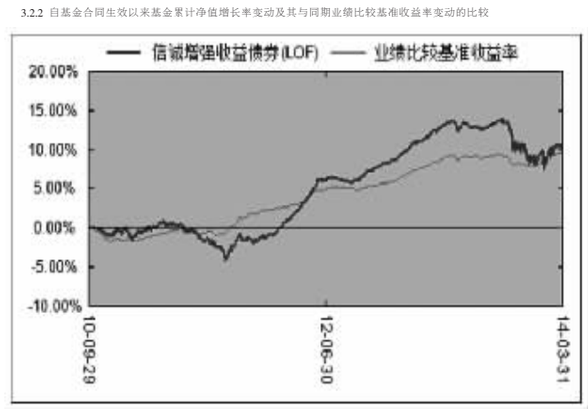
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2014年第 1 季度	1.13%	0.33%	1.42%	0.05%	-0.29%	0.28%

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 9 月 29 日至 2011 年 3 月 28 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		
王旭巍	本基金基金经理、信诚添金分级债券基金和信诚新双益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、固定收益总监兼信诚增强收益债券型基金、信诚添金分级债券型证券投资基金和信诚新双益分级债券基金的基金经理。	2010年 9 月 29 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、固定收益总监兼信诚增强收益债券型基金、信诚添金分级债券型证券投资基金和信诚新双益分级债券基金的基金经理。

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《信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚增强收益债券型证券投资基金(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

本报告期内,未发现本基金有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

2014 年一季度宏观经济数据低于预期,资金面也较宽松,加上前期超跌,推动了一季度债券市场的修复行情。为配合改革措施落实,货币政策目标需兼顾各方需求。年初以来货币政策中性,年内不排除降低存准的可能性,我们对债券市场持谨慎乐观态度。超日债违约事件引发市场震动,二季度随着年报集中披露及债券兑付高峰来临,可能会有更多信用事件暴发,我们将高度关注。

春节之后债券市场流动性明显改善、交投活跃。本基金投资管理主要有以下三方面,一是总体减持债券,降低杠杆比例;二是持仓结构调整,降低产业债的持仓比重,提高城投债的持仓比重;三是通过信用风险排查出清一批信用资质相对较差的品种。目前中等评级城投债作为高票息且相对安全的品种具有投资价值,可以获取稳定的票息收益;同时,城投债票面利率与市场回购资金成本约有 2%利差空间。因此重点投资城投债获取票息收益,保持适当杠杆比例获取利差收益仍是有效的策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 1.13%,同期业绩比较基准收益率为 1.42%,基金表现落后基准 0.29 个百分点。

§ 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	633,207,102.05	90.50
	其中:债券	633,207,102.05	90.50
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,625,058.88	1.95
7	其他资产	52,870,957.98	7.56
8	合计	699,703,118.91	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投资。

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投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,978,000.00	5.78
	其中:政策性金融债	19,978,000.00	5.78
4	企业债券	560,294,372.45	162.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	38,712,000.00	11.21
7	可转债	14,222,729.60	4.12
8	其他	-	-
9	合计	633,207,102.05	183.33

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122871	10镇交投	450,000	45,000,000.00	13.03
2	122912	10邪国资	420,000	41,580,000.00	12.04
3	122776	11新光债	407,000	40,891,290.00	11.84
4	1382143	13尧柏 MTN1	400,000	38,712,000.00	11.21
5	122805	11大同债	370,000	36,644,800.00	10.61

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	116,236.27
2	应收证券清算款	37,075,318.16
3	应收股利	-
4	应收利息	15,679,403.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,870,957.98

5.11.4 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	113003	重工转债	11,257,229.60	3.26

5.11.5 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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	398,258,862.12
报告期期间基金总申购份额	189,260,327.53
减:报告期期间基金总赎回份额	236,279,345.74
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	351,239,843.91

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)相关批准文件
2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)基金合同
4、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)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
2014 年 4 月 19 日

淄博万昌科技股份有限公司

2014 第一季度 报告

证券代码:002581 证券简称:万昌科技 公告编号:2014-015

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

除下列董事外,其他董事亲自出席了审议本次季报的董事会会议

未亲自出席董事姓名	未亲自出席董事职务	未亲自出席会议原因	被委托人姓名
王磊	独立董事	因公在外地出差	侯本领

公司负责人于秀媛、主管会计工作负责人孙铭娟及会计机构负责人(会计主管人员)于文杰声明:保证季度报告中财务报表的真实、