

信诚新兴产业股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月21日

§1 重要提示

基金管理人及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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17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。

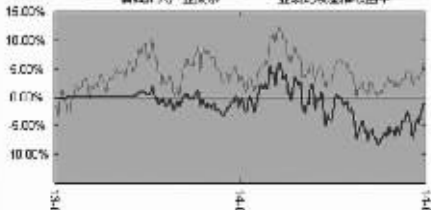
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	信诚新兴产业股票
基金代码	000209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月17日
报告期末基金份额总额	54,800,416.59份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资新兴产业的优质上市公司,在有效控制风险的前提下,力争超越业绩比较基准实现长期资本增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金在大类资产配置过程中,将优先考虑对于股票类资产的配置,在采取精选个股和构造投资组合的基础上,将剩余资产配置于固定收益类和现金类大类资产上。 2、股票投资策略 本基金的行业配置,首先是基于以上对新兴产业的定义确定属于新兴产业的行业,并且随着技术和经济的发展动态调整新兴产业的范围。本基金将研究社会发展趋势、经济发展趋势、行业技术发展趋势、消费需求变化趋势、行业技术状况、新兴技术、新兴产业模式以及新兴产业商业模式的成功度,在充分估值的基础上,选择具有良好发展前景、具备核心技术优势和商业模式优势的上市公司,产品符合发展趋势、具有较强带动作用,得到国家政策扶持且具备估值优势的子行业。 3、个股投资策略 本基金在进行新兴产业相关行业个股筛选时,主要从定性和定量两个角度对行业内上市公司投资价值进行综合评价,筛选具有较高投资价值的上市公司。 4、风险控制策略 本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现债市增值和风险控制收益。 5、投资组合风险管理 本基金将按照相关法律法规通过利用衍生工具进行套期、避险交易,控制投资组合风险,实现风险控制。本基金通过进行权证投资时,将在对权证和标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用量化定价模型进行模型,确定其合理价值,从而确定参与交易或组合的资产。
业绩比较基准	中信新兴产业指数收益率*20%+中信全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元	报告期 2014年4月1日至2014年6月30日
主要财务指标	
1.本期已实现收益	-781,684.25
2.本期利润	2,130,469.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0362
4.期末基金资产净值	54,206,457.54
5.期末基金份额净值	0.989
注:1.上述基金净值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。	
3.2.1 基金净值表现	

3.2.1 本报告期基金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
过去三个月	3.89%	1.10%	3.83%	0.81%	0.06%	0.29%
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.基金合同生效日起截至披露时点不满一年(本基金合同生效日为2013年7月17日)。 2.本基金投资于股票资产占资产净值比例不低于60%,其中投资于本基金定义的“新兴产业股票”资产占股票资产的比例不低于80%债券、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的比例不高于40%现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%权证不超过基金资产净值的3%。						

注1:本基金合同生效日至披露时点前未任一在本基金合同生效日至2013年7月17日。				
2.本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例不低于60%;其中投资于本基金定义的股票型资产的资产占股票资产的比例不低于80%;本基金投资于固定收益类资产和货币市场工具资产占基金资产净值的比例不高于40%;从成立到目前为止一年中的权重持仓比例不低于基金资产净值的5%或不超过基金资产净值的3%。				

§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,信诚新兴产业股票型LOF基金和信诚新兴产业股票基金基金经理	2013年7月17日	-	6
邓伟	本基金基金经理,信诚小盘价值基金基金经理	2013年8月16日	-	8

2008年9月至2009年8月期间于华泰资产管理有限公司担任基金经理,2009年8月加入信诚基金管理有限公司,先后担任信诚研究部员工及特定资产管理业务的投资管理职务,现任信诚新兴产业股票基金和信诚新兴产业股票基金基金经理。				
---	--	--	--	--

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7月21日	
§1 重要提示	
基金管理人及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2014年7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财产,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,投资者有风险,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4月1日起至6月30日止。	
§2 基金产品概况	
基金名称	信诚新双盈分级债券
基金代码	000091
基金运作方式	契约、开放式。本基金以“运作周期滚动”的方式运作。新双盈A自基金合同生效后起每4个月开放申购赎回一次,新双盈B在每一运作周期结束后,仅在每月运作周期到期日开放申购和赎回一次。每次开放仅开放一个工作日。
基金合同生效日	2013年5月9日
报告期末基金份额总额	1,028,087,141.92份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金投资组合包括债券、货币等大类资产,各自的目标长期配置权重,按照本基金的风险偏好进行确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并适度配置货币资产和权益类资产。在资产配置上,本基金将综合考虑宏观经济、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捕捉系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中信新双盈指数收益率
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
下属两级基金的基金名称	信诚新双盈分级债券 A
下属两级基金的交易代码	000092
报告期末下属两级基金的份额总额	719,639,998.98份
下属两级基金的风险收益特征	信诚新双盈分级债券 A 为低风险、收益中低风险品种的基金。

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 报告截止日期:2014年7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。 会计师事务所天中国建信(北京)证券有限公司根据基金合同规定,于 2014 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值、基金份额变动情况等内,并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预示其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。	
§ 2 基金产品概况	
基金简称	信诚新双盈分级债券
基金主代码	000901
基金运作方式	契约型、开放式 运作方式:自成立日起,每个工作日开放申购和赎回的万份运作。新股自 A 股上市交易之日起每日按 4 个开放日申购赎回一次,新股 B 在任一运作期间内申购运作,仅在每个运作周期到期日开放申购和赎回一次。每次开放只开放一个工作日。
基金合同生效日	2013 年 5 月 9 日
报告期末基金份额总额	1,028,572,119.92 份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争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类、货币类等大类资产各自的比例长期均固定,按照本基金的投资目标和风险收益特征,本基金定位为中长期债券基金。其资产配置以债券资产为主,并依据市场环境动态调整资产配置。在不同的市场条件下,本基金将动态调整宏观配置、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进行调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中债新综合债券指数收益率
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中低风险品种。其预期风险与收益水平低于货币市场基金和股票型基金,高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
下属两级基金的名称简称	信诚新双盈分级债券 A 信诚新双盈分级债券 B
下属两级基金的交易代码	000903 000904
下属两级基金份额的净值总额	719,639,998.92 719,637,142.94
下属两级基金的风险收益特征	信诚新双盈分级债券 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额。 信诚新双盈分级债券 B 为中高风险、中-偏高风险的基金份额。

3.1 主要财务指标

主要财务指标(单位:人民币元)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 2014 年 4 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1.本期已实现收益	-8,110,675.47
2.本期利润	26,869,384.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0227
4.期末基金资产净值	1,041,425,130.96
5.期末基金份额净值	1.013

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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.36%	0.13%	2.41%	0.04%	-0.05%	0.09%

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

信诚新双盈分级债券基金
中证转债指数收益率

2013年9月9日 2013年11月8日 2014年6月30日

注:本基金合同自2013年5月9日至2013年11月8日,按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过6个月

注:本基金建仓期自2013年5月9日至2013年11月8日,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。

同时,总体上也反映了宏观经济结构调整和结构调整带来的新兴产业的投资机会。后续将继续跟踪TMT、大消费、医疗服务、移动互联网、高端装备、节能环保行业的投资机会,力争保持持有人利益的投资。

5.1 报告期末基金资产组合情况		§5 投资组合报告	
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,946,603.55	87.50
	其中:股票	47,946,603.55	87.50
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	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	5,822,413.32	10.63
7	其他资产	1,024,898.65	1.87
8	合计	54,793,915.52	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	29,166,157.52	53.81
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	2,318,623.83	4.28
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	7,803,360.00	14.40
J	金融业	1,019,200.00	1.88
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	1,254,590.00	2.31
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
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	6,384,672.20	11.78
S	综合	--	--
	合计	47,946,603.55	88.45

§5 投资组合报告					
5.1 报告期末基金资产组合情况					
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	000023	海特新科	161,192	3,078,767.20	5.68
2	300133	华策影视	95,996	3,067,072.20	5.66
3	002266	浙新控股	250,000	1,772,500.00	3.27
4	000516	开元投资	263,241	1,768,979.52	3.26
5	000997	新大陆	99,000	1,718,640.00	3.17
6	002111	威海广泰	110,000	1,677,500.00	3.09
7	300027	华谊兄弟	70,000	1,674,400.00	3.09
8	002108	沧州明珠	132,000	1,672,440.00	3.09
9	002038	天虹商场	96,000	1,664,640.00	3.07
10	600466	中国国贸	19,004	1,630,975.36	3.01
5.4 报告期末按投资组合分类的股票投资明细					
本基金本报告期末未持有股票投资。					
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十名债券投资明细					
本基金本报告期末未持有债券投资。					
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投资。					
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投资。					
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					
本基金投资范围不包括股指期货投资。					
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					
本基金本报告期末未进行国债期货投资。					
5.10.3 本期国债期货投资评价					
本基金本报告期末未持有国债期货投资。					
5.11 投资组合报告附注					
5.11.1 本基金投资的前十名证券中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,没有卖出基金合同约定股票品种的股票。					