

信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6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: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。
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。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资范围, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日), 单位:人民币元.

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可能低于所列数字。

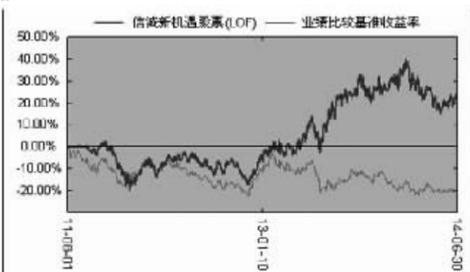
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 7 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.

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:本基金建仓日自2011年8月1日至2012年1月31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 基金管理人(或基金基金经理)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明.

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免日期。

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。

3.在报告期内,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《信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚新机遇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》,以及公司制定的《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来落实公平交易管理的各项要求,各部门在公平交易机制中各司其职,投资研究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,建立立体化的制度环境,交易环节加强交易的内控制衡,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它流程控制,确保不同基金在一级、二级市场同一证券交易时的公平,并同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加强了严格的监控,分析和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良好,未发现异常公平交易的情况。

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,未发现本基金有公允价值反向交易成交较多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年二季度,政策市场继续良好表现,A股市场经历了经济数据不断超预期好转和IPO重启的影响,市场分化明显,主板指数涨幅较大,市场情绪乐观,创业板则先后走弱,整体表现较好,结构上,国防军工、通信、计算机表现较好;交通物流、纺织服装、商业贸易表现较好。

二季度,本基金的持仓重点依然在医药生物、电子设备、食品饮料等行业,基金净值表现略好于业绩比较基准。

展望未来,市场关注的热点仍聚焦集中在符合经济转型升级和产业升级的方向上,因此,信息服务、医疗服务、工业自动化和机器人、节能环保和新能源汽车等行业不断衍生投资机会,与此同时,随着经济转型升级的深入,传统产业公司基于业务发现者有管理需要在积极向新兴产业渗透,这些产业中管理层的素质、团队执行力的公司也可能蕴藏较好投资机会。

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1.81%,同期业绩比较基准收益率为1.22%,基金表现超越基准0.59个百分点。

信诚基金管理有限公司 2014年7月21日

信诚基金 信息披露

2014年7月21日

5 投资组合报告

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 6 columns: 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

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序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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

5.7 报告期末按公允价值前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

本基金报告期内未进行股指期货投资。

5.10 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包括国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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

Table with 3 columns: 序号, 项目名称, 金额(元)

5.11.4 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。

5.11.5 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情况。

5.10.4 本报告期末股指期货投资的其他合同能源说明

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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