

信诚增强收益债券型证券投资基金(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: 基金简称, 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, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

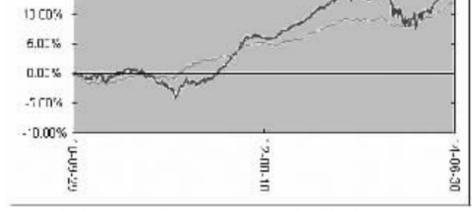
3 主要财务指标和基金净值表现

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), 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

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据。

2. 本期期末收益指基金份额持有人应得收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期公允价值变动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



注:本基金建仓自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合同约定。

4 管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期,指任期开始时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《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。

4.1 基金业绩或基金经理小组简介

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

4.2 投资策略

4.3 资产配置策略

4.4 异常交易专项说明

4.5 公平交易策略

4.6 2014年二季度投资回顾

4.7 报告期内本基金投资运作情况

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

4.9 基金文件目录

4.10 基金业绩或基金经理小组简介

4.11 基金业绩或基金经理小组简介

4.12 基金业绩或基金经理小组简介

4.13 基金业绩或基金经理小组简介

4.14 基金业绩或基金经理小组简介

4.15 基金业绩或基金经理小组简介

4.16 基金业绩或基金经理小组简介

4.17 基金业绩或基金经理小组简介

4.18 基金业绩或基金经理小组简介

4.19 基金业绩或基金经理小组简介

4.20 基金业绩或基金经理小组简介

4.21 基金业绩或基金经理小组简介

4.22 基金业绩或基金经理小组简介

4.23 基金业绩或基金经理小组简介

4.24 基金业绩或基金经理小组简介

4.25 基金业绩或基金经理小组简介

4.26 基金业绩或基金经理小组简介

4.27 基金业绩或基金经理小组简介

4.28 基金业绩或基金经理小组简介

4.29 基金业绩或基金经理小组简介

4.30 基金业绩或基金经理小组简介

4.31 基金业绩或基金经理小组简介

4.32 基金业绩或基金经理小组简介

4.33 基金业绩或基金经理小组简介

4.34 基金业绩或基金经理小组简介

4.35 基金业绩或基金经理小组简介

4.36 基金业绩或基金经理小组简介

4.37 基金业绩或基金经理小组简介

4.38 基金业绩或基金经理小组简介

4.39 基金业绩或基金经理小组简介

4.40 基金业绩或基金经理小组简介

4.41 基金业绩或基金经理小组简介

4.42 基金业绩或基金经理小组简介

4.43 基金业绩或基金经理小组简介

4.44 基金业绩或基金经理小组简介

信达澳银领先增长股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
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。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 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, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

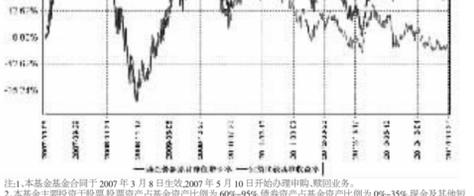
3 主要财务指标和基金净值表现

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), 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(如认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平可能低于所列数据。

2. 本期期末收益指基金份额持有人应得收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期公允价值变动加上本期公允价值变动收益。

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



注:本基金建仓于2007年3月8日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同约定。

4 管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.基金业绩或基金经理小组简介

2. 基金业绩或基金经理小组简介

3. 基金业绩或基金经理小组简介

4. 基金业绩或基金经理小组简介

4.1 基金业绩或基金经理小组简介

4.2 基金业绩或基金经理小组简介

4.3 基金业绩或基金经理小组简介

4.4 基金业绩或基金经理小组简介

4.5 基金业绩或基金经理小组简介

4.6 基金业绩或基金经理小组简介

4.7 基金业绩或基金经理小组简介

4.8 基金业绩或基金经理小组简介

4.9 基金业绩或基金经理小组简介

4.10 基金业绩或基金经理小组简介

4.11 基金业绩或基金经理小组简介

4.12 基金业绩或基金经理小组简介

4.13 基金业绩或基金经理小组简介

4.14 基金业绩或基金经理小组简介

4.15 基金业绩或基金经理小组简介

4.16 基金业绩或基金经理小组简介

4.17 基金业绩或基金经理小组简介

4.18 基金业绩或基金经理小组简介

4.19 基金业绩或基金经理小组简介

4.20 基金业绩或基金经理小组简介

4.21 基金业绩或基金经理小组简介

4.22 基金业绩或基金经理小组简介

4.23 基金业绩或基金经理小组简介

4.24 基金业绩或基金经理小组简介

4.25 基金业绩或基金经理小组简介

4.26 基金业绩或基金经理小组简介

4.27 基金业绩或基金经理小组简介

4.28 基金业绩或基金经理小组简介

4.29 基金业绩或基金经理小组简介

4.30 基金业绩或基金经理小组简介

4.31 基金业绩或基金经理小组简介

4.32 基金业绩或基金经理小组简介

4.33 基金业绩或基金经理小组简介

4.34 基金业绩或基金经理小组简介

4.35 基金业绩或基金经理小组简介

4.36 基金业绩或基金经理小组简介

4.37 基金业绩或基金经理小组简介

4.38 基金业绩或基金经理小组简介

4.39 基金业绩或基金经理小组简介

4.40 基金业绩或基金经理小组简介

4.41 基金业绩或基金经理小组简介

4.42 基金业绩或基金经理小组简介

4.43 基金业绩或基金经理小组简介

4.44 基金业绩或基金经理小组简介

4.45 基金业绩或基金经理小组简介

我们买入或卖出的是目前市场上性价比收益率可观、信用风险可接受较好的投资项目,近期在中央对稳增长经济和刺激地产的环境下,城投债整体违约风险不大,因此重点投资城投债获取票息收益,保持适当仓位获取利息收益仍是本基金的主要投资策略。二季度受一、二级市场市场新增供给同时调整仓位结构保持持仓集中度,可转债进行了少量波段操作。

5 投资组合报告

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), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.16 报告期末持有的其他权证投资明细

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.19 投资组合报告附注

5.20 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.21 其他资产构成

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.24 报告期末持有的其他权证投资明细

5.25 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.26 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.27 投资组合报告附注

5.28 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.29 其他资产构成

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.32 报告期末持有的其他权证投资明细

5.33 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.34 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.35 投资组合报告附注

5.36 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.37 其他资产构成

5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.39 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.40 报告期末持有的其他权证投资明细

5.41 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.42 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.43 投资组合报告附注

5.44 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.45 其他资产构成

5.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.47 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.48 报告期末持有的其他权证投资明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.50 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.51 投资组合报告附注

5.52 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.53 其他资产构成

5.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.55 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.56 报告期末持有的其他权证投资明细

5.57 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.58 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.59 投资组合报告附注

5.60 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.61 其他资产构成

5.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.63 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.64 报告期末持有的其他权证投资明细

5.65 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.66 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.67 投资组合报告附注

5.68 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.69 其他资产构成

5.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

我们买入或卖出的是目前市场上性价比收益率可观、信用风险可接受较好的投资项目,近期在中央对稳增长经济和刺激地产的环境下,城投债整体违约风险不大,因此重点投资城投债获取票息收益,保持适当仓位获取利息收益仍是本基金的主要投资策略。二季度受一、二级市场市场新增供给同时调整仓位结构保持持仓集中度,可转债进行了少量波段操作。

5 投资组合报告

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), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

5.7 报告期末持有的其他权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.11 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.12 其他资产构成

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.15 报告期末持有的其他权证投资明细

5.16 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.18 投资组合报告附注

5.19 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.20 其他资产构成

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.23 报告期末持有的其他权证投资明细

5.24 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.25 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.26 投资组合报告附注

5.27 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.28 其他资产构成

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.31 报告期末持有的其他权证投资明细

5.32 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.33 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.34 投资组合报告附注

5.35 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

5.36 其他资产构成

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.38 报告期末持有的资产支持证券投资明细

5.39 报告期末持有的其他权证投资明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.41 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.42 投资组合报告附注