

信诚优质纯债债券型证券投资基金

2014第四季度报告

2014年12月31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:2015年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监察部门对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。

基金托管人和银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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。

基金管理人的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金概况		
基金全称	信诚优质纯债债券型证券投资基金	
基金简称	信诚优质纯债	
基金代码	550018	
基金合同生效日	2013年2月5日	
报告期末基金份额总额	363,413,024.91份	
投资目标	严控风险的基础上，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。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、行业配置比例、个券选择、久期调整、杠杆运用等策略，以降低系统性风险对基金收益的影响。	
1. 资产配置策略	本基金将综合考虑宏观经济、政策变化、资金面变化、信用利差、利率期限结构、流动性、信用评级、久期、杠杆等因素，通过分析不同类型的债券品种的预期收益率，结合对宏观经济、政策变化、资金面变化、信用利差、利率期限结构、流动性、信用评级、久期、杠杆等因素的判断，适时调整资产配置比例，以降低系统性风险对基金收益的影响。	
投资策略	在具体的投资操作上，本基金将通过识别不同类型的投资品种，通过不同的投资方式，实现基金资产的长期稳定增值。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、行业配置比例、个券选择、久期调整、杠杆运用等策略，以降低系统性风险对基金收益的影响。	
4.1 期间内基金的投资策略和运作分析	报告期末，本基金重仓持有信用等级较高的企业债，信用利差较低，久期适中，信用风险较低，信用利差也相对较小，因此本基金增加信用利差较大，但房地产及相关行业，可能对行业的企业经营仍然较为困难，仍不应忽视信用风险。	
4.2 报告期内基金的业绩表现	报告期内，本基金重仓持有信用等级较高的企业债，信用利差较低，久期适中，信用风险较低，信用利差也相对较小，因此本基金增加信用利差较大，但房地产及相关行业，可能对行业的企业经营仍然较为困难，仍不应忽视信用风险。	
4.3 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.4 报告期末基金资产净值	报告期末，本基金资产净值为363,413,024.91元。	
4.5 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.6 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.7 报告期末基金份额净值和份额累计净值	报告期末，本基金份额净值和份额累计净值均为1.00元。	
4.8 报告期末基金份额总额与期末净资产孰低值	报告期末，本基金份额总额与期末净资产孰低值为363,413,024.91元。	
4.9 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.10 报告期末基金份额净值和份额累计净值	报告期末，本基金份额净值和份额累计净值均为1.00元。	
4.11 报告期末基金份额总额与期末净资产孰低值	报告期末，本基金份额总额与期末净资产孰低值为363,413,024.91元。	
4.12 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.13 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.14 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.15 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.16 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.17 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.18 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.19 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.20 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.21 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.22 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.23 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.24 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.25 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.26 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.27 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.28 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.29 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.30 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.31 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.32 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.33 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.34 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.35 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.36 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.37 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.38 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.39 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.40 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.41 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.42 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.43 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.44 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.45 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.46 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.47 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.48 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.49 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.50 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.51 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.52 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.53 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.54 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.55 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.56 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.57 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.58 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.59 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.60 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.61 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.62 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.63 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.64 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.65 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.66 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.67 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.68 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.69 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.70 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.71 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.72 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.73 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.74 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.75 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.76 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.77 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.78 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.79 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.80 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.81 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.82 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.83 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.84 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.85 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.86 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.87 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.88 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.89 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.90 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.91 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.92 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.93 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.94 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.95 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.96 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.97 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.98 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.99 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.100 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.101 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.102 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.103 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.104 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.105 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.106 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.107 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.108 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.109 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.110 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.111 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.112 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.113 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.114 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.115 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.116 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.117 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.118 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.119 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.120 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.121 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.122 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.123 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.124 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.125 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.126 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.127 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.128 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.129 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.130 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	
4.131 报告期内基金的已实现收益	报告期内，本基金未实现收益为0元。	
4.132 报告期内基金的可供分配利润	报告期内，本基金可供分配利润为0元。	
4.133 报告期末可供分配利润	报告期末，本基金可供分配利润为0元。	
4.134 报告期末基金份额净值	报告期末，本基金份额净值为1.00元。	
4.135 报告期末基金份额总额	报告期末，本基金份额总额为363,413,024.91份。	
4.136 报告期末基金份额净值与份额累计净值的差额	报告期末，本基金份额净值与份额累计净值的差额为0元。	
4.137 报告期内基金的利润分配情况	本基金在符合有关法律法规和基金合同的前提下，将定期向基金份额持有人分配收益。	