

信诚沪深300指数分级证券投资基金管理

2013第四季度报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告存放处不存在虚假记载、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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月15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数据,复核结果不存在虚假记载、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。
本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)
基金代码	165515
上市交易所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
报告期末基金资产总额	692,117,972.47元
投资目标	本基金紧密跟踪沪深300指数,为投资者提供一个投资沪深300指数的工具。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。本基金在投资中将严格遵守指数化投资原则,并保持基金净值与沪深300指数的跟踪误差不超过1%。
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
下属分级基金的基金简称	信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A) 信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)
下属分级基金的交易代码	165511 165515
报告期末基金份额总额	325,044,454.00份
报告期末基金资产净值总额	325,044,454.00元
报告期末基金份额净值	1.000元
下属分级基金的风险收益特征	信诚沪深300指数分级A具有较低风险,收益相对稳定的特征;信诚沪深300指数分级B具有较高风险,高预期收益的特征。

风险收益特征	本基金为股票型指数基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。本基金在投资中将严格遵守指数化投资原则,并保持基金净值与沪深300指数的跟踪误差不超过1%。
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
下属分级基金的基金简称	信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A) 信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)
下属分级基金的交易代码	165511 165515
报告期末基金份额总额	325,044,454.00份
报告期末基金资产净值总额	325,044,454.00元
报告期末基金份额净值	1.000元
下属分级基金的风险收益特征	信诚沪深300指数分级A具有较低风险,收益相对稳定的特征;信诚沪深300指数分级B具有较高风险,高预期收益的特征。

95%的资产投资于股票,并持有不低于5%的现金类资产。

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	000138	中国平安	506,857	21,151,142.61	3.55
2	600036	招商银行	1,899,318	19,703,473.02	3.31
3	600016	兴业银行	2,392,529	18,470,323.88	3.10
4	601166	民生银行	1,713,455	11,898,833.70	2.00
5	600000	浦发银行	1,250,426	11,791,517.18	1.98
6	600837	海通证券	925,149	10,472,686.68	1.76
7	600030	中信证券	692,578	8,830,369.50	1.48
8	600002	万科A	7,260	7,823,307.80	1.31
9	000651	格力电器	226,463	7,396,281.80	1.24
10	601398	工商银行	1,969,987	7,053,553.46	1.18

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)

-7,948,873.66

-23,446,908.00

-0.389

995,601,901.69

0.861

3.4 本期基金份额持有人账户数增长率及其与同行业对比

3.5 期末基金资产净值

3.6 期末基金份额净值

3.7 期末可供分配基金份额利润

3.8 期末基金资产净值与同期业绩比较基准收益率的差额

3.9 期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差额

3.10 期末基金份额净值增长率标准差

3.11 期末基金份额净值增长率变异系数

3.12 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.13 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.14 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.15 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.16 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.17 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.18 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.19 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.20 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.21 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.22 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.23 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.24 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.25 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.26 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.27 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.28 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.29 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.30 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.31 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.32 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.33 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.34 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.35 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.36 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.37 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.38 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.39 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.40 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.41 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.42 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.43 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.44 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.45 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.46 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.47 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.48 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.49 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.50 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.51 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.52 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.53 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.54 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.55 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.56 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.57 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.58 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.59 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.60 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.61 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.62 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.63 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.64 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.65 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.66 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.67 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.68 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.69 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.70 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.71 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.72 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.73 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.74 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.75 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.76 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.77 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.78 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.79 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.80 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.81 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.82 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.83 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.84 期末基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

3.85