



# 信诚基金信息披露

2014年1月21日 星期二  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B147

## 信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)

### 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:中国建设银行股份有限公司**  
**报告送出日期:2014年1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,基金的过往业绩并不代其未来表现,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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自2013年10月1日起至12月31止。

#### §2 基金产品概况

基金名称	信诚深度价值股票(LOF)(内码简称:信诚深价)
基金代码	165509
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2010年7月30日
报告期末基金份额总额	81,254,661.82份
投资目标	通过对公司基本面研究,深入剖析股票价值被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争实现资产的长期增值。
投资策略	本基金定位为股票型基金,其策略性资产配置以股票为主,并不同市场的中短期变化而改变。本基金的核心理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。本基金的投资策略如下:首先,在行业选择上,本基金将重点投资于具有良好发展前景的行业;其次,在个股选择上,本基金将重点投资于具有良好发展前景的行业;最后,在个股选择上,本基金将重点投资于具有良好发展前景的行业。
业绩比较基准	80%×上证180指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
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

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,400,712.04	
2.本期利润	-4,980,324.33	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0588	
4.期末基金资产净值	93,338,449.26	
5.期末基金份额净值	1.1497	

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。

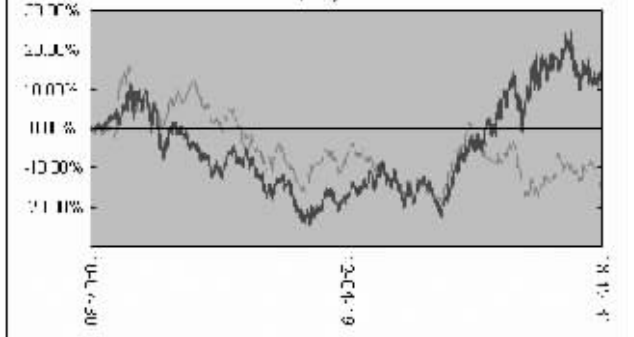
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	净值比较基准差③	①-③	②-④
2013年第四季度	-4.88%	-1.40%	-2.84%	0.92%	-0.48%

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:本基金建仓期自2010年7月30日至2011年1月29日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

#### 4.1 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
王旭辉	本基金基金经理,信诚深度价值股票基金和信诚新兴产业基金基金经理	2010年9月8日	6	经济学博士,曾任招商银行信托理财中心高级经理,2008年7月加入信诚基金管理有限公司,历任信诚新兴产业基金基金经理、信诚价值精选股票基金基金经理、信诚价值精选股票基金的基金经理。

注:1.上述任职日期,系指任期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

3.2 基金经理在报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《信诚深度价值股票型证券投资基金基金合同》、《信诚深度价值股票型证券投资基金基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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,规范基金运作。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》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度(1.2)》,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。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究部门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;建立公平交易制度的执行和内部控制的,利用恒生交易系统公平交易程序,及其其他的流程控制,确保不同基金在一级、二级市场同一证券交易时,公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的后台监控,并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情况良好,未发现有违背公平交易的情况。

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,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金2013年4季度坚持持仓策略的要求,积极寻找具有较高成长性的行业和个股,超配了安防、环保、医药、大众食品、传媒、汽车,从成长的角度去把握投资机会,取得了一定的成效。

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《信诚深度价值股票型证券投资基金基金合同》、《信诚深度价值股票型证券投资基金基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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,规范基金运作。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。

4.5 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-4.88%,同期业绩比较基准收益率为-2.84%,基金表现落后基准2.04个百分点。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	82,753,226.93	86.64
2	固定收益投资	82,753,226.93	86.64
3	货币资金	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	8,893,479.65	9.31
6	其他资产	3,862,798.86	4.04
7	合计	95,509,496.44	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	56,055,246.12	60.05
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,702,400.00	5.04
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	3,912,428.78	4.19
J	金融业	1,039,000.00	1.11
K	房地产业	6,754,000.00	7.24
L	租赁和商业服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、环境和公共设施管理业	8,204,552.80	8.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,435,500.00	1.54
S	合计	82,753,226.93	86.64

#### 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

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	000625	长安汽车	550,000	6,297,500.00	6.75
2	600226	天华超净	150,000	6,152,000.00	6.57
3	000418	江淮汽车	240,000	5,575,200.00	5.97
4	600752	广信股份	440,000	5,002,800.00	5.36
5	300070	雷科防务	122,000	5,000,760.00	5.36
6	300058	蓝色光标	87,000	4,506,600.00	4.83
7	300124	汇川技术	77,000	4,503,720.00	4.83
8	600355	天士力	90,000	3,860,100.00	4.14
9	000516	开元投资	640,000	3,782,400.00	4.05
10	300026	巨日药业	97,000	3,623,920.00	3.88

#### 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名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名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。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

#### 5.8.2 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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

#### 5.9.3 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本报告投资的前十名证券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受到公开谴责、处罚。

5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	72,848.66
2	应收证券清算款	3,761,676.52
3	应收股利	-
4	应收利息	2,312.40
5	应收申购款	25,761.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,862,798.86

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 5.10.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 5.10.8 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人“信诚基金托管”的重大人事变动

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

#### 9.1 备查文件目录

1.信诚深度价值股票型证券投资基金基金合同及相关资料

2.信诚深度价值股票型证券投资基金基金招募说明书

3.信诚深度价值股票型证券投资基金基金托管协议

4.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

5.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

6.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

7.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

8.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

9.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

10.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

11.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

12.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

13.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

14.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

15.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

16.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

17.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

18.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

19.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

20.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

21.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

22.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

23.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

24.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

25.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

26.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

27.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

28.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

29.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

30.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

31.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

32.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

33.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

34.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

35.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

36.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

37.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

38.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

39.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

40.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

41.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

42.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

43.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

44.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

45.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

46.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

47.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

48.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

49.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

50.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

51.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

52.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

53.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

54.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

55.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

56.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

57.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

58.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

59.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

60.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

61.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

62.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

63.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

64.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

65.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

66.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

67.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

68.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

69.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

70.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

71.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

72.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

73.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

74.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

75.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

76.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

77.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

78.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

79.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

80.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

81.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

82.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

83.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

84.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

85.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

86.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

87.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

88.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

89.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

90.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

91.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

92.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

93.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

94.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

95.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

96.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

97.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

98.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

99.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

100.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

101.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

102.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

103.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

104.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

105.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

106.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

107.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

108.信诚深度价值股票型证券投资基金基金销售协议

109.信诚深度价值