

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有董事声明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。

基金托管人对本基金根据本合同定期报告，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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚深度价值股票(LOF)(场内简称:信诚深度)
基金主代码	165508
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月8日
报告期末基金份额总额	81254613.61份

投资目标 通过对公司基本面的研究,深入剖析股价被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以为争取获取超额的回报。

本基金为权益类基金,其战略定位以价值为主,并侧重于对公司的基本面进行深度化分析,通过深入研究,精选出具有持续增长潜力的个股,并择机买入,在不同的市况条件下,本基金将在一定的范围内操作买卖头寸,以规避风险。

业绩比较基准 80%×上证综合指数+20%×中信标全债指数收益率。

风险收益特征 本基金为主动管理的股票型基金,属于较高风险、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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期实现收益	10,400,712.04
2.本期利润	-4,980,324.32
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	1.149

注:1.上述基金业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示的水平。

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.基金净值表现

3.2.1 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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
2013年第4季度	-4.88%	1.40%	-2.84%	0.92%	-2.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

序号	报告期	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
2013年第4季度	82.753,226.93	82.753,226.93	80.64%			0.48%

注:1.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 管理人报告

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
谢鹏飞	本基金基金经理,信诚基金管理有限公司基金经理,信诚深蓝基金基金经理,信诚深蓝价值基金经理,信诚深蓝基金经理	2011年9月8日	-	6 本基金基金经理,谢鹏飞先生,上海交通大学金融学硕士,现担任信诚新兴产业股票型基金、信诚深度价值股票型基金、信诚深蓝股票型基金基金经理。

注:1.上述基金经理,任职日期在报告期内根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券分析师的含义参见行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定,本基金管理人勤勉尽责的履行管理运用基金财产,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,规范基金管理,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人为行为。

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V1.2》,公司采取了一系列的行动实施公平交易管理制度,确保各基金共享有公平的投资决策权,建立公平交易的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其的流程控制,确保不同基金在一二级市场对同一证券交易时的公平,公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后严格以偏离度为标准,分析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,未发现不公平交易和利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

5.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有受到监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.3 其他资产构成

5.4 报告期内未按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末未持有股票品种的股票投资组合

5.6 报告期内未持有权证品种的权证投资组合

5.7 报告期内未持有股指期货投资组合

5.8 报告期内未持有国债期货投资组合

5.9 报告期内未持有股票期权投资组合

5.10 报告期内未持有商品期货投资组合

5.11 报告期内未持有货币市场基金投资组合

5.12 报告期内未持有资产支持证券投资组合

5.13 报告期内未持有贵金属投资组合

5.14 报告期内未持有其他投资品种投资组合

5.15 报告期内未持有股票型证券投资基金投资组合

5.16 报告期内未持有混合型证券投资基金投资组合

5.17 报告期内未持有债券型证券投资基金投资组合

5.18 报告期内未持有货币型证券投资基金投资组合

5.19 报告期内未持有定期开放型证券投资基金投资组合

5.20 报告期内未持有商品型证券投资基金投资组合

5.21 报告期内未持有商品期货投资基金投资组合

5.22 报告期内未持有金融衍生品投资基金投资组合

5.23 报告期内未持有商品期权投资基金投资组合

5.24 报告期内未持有商品期货期权投资基金投资组合

5.25 报告期内未持有金融衍生品期货投资基金投资组合

5.26 报告期内未持有金融衍生品期权投资基金投资组合

5.27 报告期内未持有商品期权期货投资基金投资组合

5.28 报告期内未持有金融衍生品期货期权投资基金投资组合

5.29 报告期内未持有商品期货期权投资基金投资组合

5.30 报告期内未持有金融衍生品期货期权投资基金投资组合

5.31 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.32 报告期内未持有金融衍生品期货期权投资基金投资组合

5.33 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.34 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.35 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.36 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.37 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.38 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.39 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.40 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.41 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.42 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.43 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.44 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.45 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.46 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.47 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.48 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.49 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.50 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.51 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.52 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.53 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.54 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.55 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.56 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.57 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.58 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.59 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.60 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.61 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.62 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.63 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.64 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.65 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.66 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.67 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.68 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.69 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合

5.70 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.71 报告期内未持有商品期权期货期权投资基金投资组合

5.72 报告期内未持有金融衍生品期货期权期货投资基金投资组合

5.73 报告期内未持有商品期货期权期货投资基金投资组合