信诚中证500指数分级证券投资基金之A份额与B份额上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市日期:2011年3月14日
公告日期:2011年3月9日

一、重要声明与提示

信诚中证500指数分级证券投资基金之信诚500A与信诚500B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"基金法"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对信诚中证500指数分级证券投资基金之信诚500A与信诚500B上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2010年12月31日《证券时报》、2011年1月4日《中国证券报》和1月6日《上海证券报》上的《信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:信诚中证500指数分级证券投资基金
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）的基金份额包括信诚中证500指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称"信诚500"）、信诚中证500指数分级证券投资基金A份额（场内简称"信诚500A"）与信诚中证500指数分级证券投资基金B份额（场内简称"信诚500B"）。其中，信诚500A、信诚500B的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、信诚500的申购与赎回:本基金合同生效后，信诚500接受场外与场内申购和赎回；信诚500A、信诚500B只上市交易，不接受申购和赎回。
7、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的信诚500与信诚500A、信诚500B之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。
1）分拆。基金份额持有人将其持有的每十份信诚500的场内份额申请转换成四份信诚500A与六份信诚500B的行为。
2）合并。基金份额持有人将其持有的每四份信诚500A与六份信诚500B进行配对申请转换成十份信诚500的场内份额的行为。份额配对转换自基金合同生效后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人将在开始办理份额配对转换前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。
8、基金份额折算:本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及信诚500A份额与信诚500B份额配比不变。
9、信诚500A与信诚500B的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过，信诚500A与信诚500B可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚500、信诚500A与信诚500B各自的基金份额持有人或其代理人所持信诚500、信诚500A与信诚500B各自表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。
10、基金份额总额：截至2011年3月7日，本基金的基金份额总额为374,254,300.10份，其中，信诚500为348,917,936.10份，信诚500A为10,134,545.00份，信诚500B为15,201,819.00份。
11、基金份额净值:截至2011年3月7日，信诚500的基金份额净值为1.008元，信诚500A的基金份额净值为1.004元，信诚500B的基金份额净值为1.011元。
12、基金管理人:信诚基金管理有限公司
13、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
14、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况，包括:
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会，证监许可［2010］1877号文
2、基金运作方式:契约型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、发售日期:2011年1月6日至2011年1月28日
5、发售价格:1.00元人民币
6、发售期限:2011年1月6日至2011年1月28日
7、发售方式:交易所（场内）发售和柜台（场外）发售
8、发售机构:
（1）深圳证券交易所（场内）发售机构
1）已具有基金代销业务资格的深交所会员

国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、信达证券等（排名不分先后）。

2）本基金募集期期间获得基金代销资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

3）尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的买卖。

（2）柜台（场外）发售机构
1）直销机构:信诚基金管理有限公司直销中心。
2）场外代销机构:中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司等30家代销机构.

9、验资机构名称:毕马威华振会计师事务所。
10、募集资金总额及入账情况:本次募集的净认购金额为374,118,554.71元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计135,745.39元人民币。上述资金已于2011年2月10日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况:2011年2月10日聘请毕马威华振会计师事务所验资，随后向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，2011年2月11日中国证监会予以书面确认，本基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2011年2月11日
13、基金合同生效日的基金份额总额:374,254,300.10份
（二）本基金上市交易的主要内容，包括:
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上［2011］76号
2、上市交易日期:2011年3月14日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、本次上市交易的基金份额简称:信诚中证500指数分级A、信诚中证500指数分级B
5、本次上市交易的基金份额场内简称:信诚500A、信诚500B
6、本次上市交易的基金份额交易代码:信诚500A为150028;信诚500B为150029
7、本次上市交易的基金份额总额:信诚500A为10,134,545.00份;信诚500B为15,201,819.00份
8、基金资产净值的披露:基金管理人每个开放日（T日）对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人在T日内将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，由深交所于T+1日通过行情系统揭示T日基金份额净值。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。
9、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外，持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

一、截至2011年3月7日的信诚500A（基金代码:150028）场内基金份额持有情况:
场内基金份额持有人户数:809户
平均每户持有的场内基金份额:12,527.2497份
场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有2,440,268份，占24.0787%
场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有7,694,277份，占75.9213%
场内基金前十名持有人情况:

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额的比例
1	东吴证券—工行—东吴财富2号集合资产管理计划	2,000,202	19.74%
2	中融国际信托有限公司—中融安苏1号证券投资	396,052	3.91%
3	张光燕	240,050	2.37%
4	谭振宇	198,026	1.95%
5	毕淑芹	198,020	1.95%
6	孙中玲	159,616	1.57%
7	姚兵	138,018	1.36%
8	汤英友	120,021	1.18%
9	萧玉梅	112,011	1.11%
10	黄安安	98,010	0.97%
11	谭爱萍	98,010	0.97%
合计		3,758,036	37.08%

二、截至2011年3月7日的信诚500B（基金代码:150029）场内基金份额持有情况:
场内基金份额持有人户数:809户
平均每户持有的场内基金份额:18,790.8764份
场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有3,660,402份，占24.0787%
场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有11,541,417份，占75.9213%
场内基金前十名持有人情况:

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额的比例
1	东吴证券—工行—东吴财富2号集合资产管理计划	3,000,303	19.74%
2	中融国际信托有限公司—中融安苏1号证券投资	594,077	3.91%
3	张光燕	360,076	2.37%
4	谭振宇	297,038	1.95%
5	毕淑芹	297,030	1.95%
6	孙中玲	239,424	1.57%
7	姚兵	207,027	1.36%
8	汤英友	180,030	1.18%
9	萧玉梅	168,017	1.11%
10	黄安安	147,014	0.97%
11	谭爱萍	147,014	0.97%
合计		5,637,050	37.08%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称:信诚基金管理有限公司
2、法定代表人：张翔燕
3、总经理:王俊锋
4、注册资本:2亿元人民币
5、注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
6、设立批准文号:证监基字［2005］142号
7、法人营业执照文号:310000400441678
8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务
9、股东及持股比例:公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为49%、49%、2%。
10、内部组织结构及职能:公司下设投资管理部、交易部、市场策划部、渠道销售部、直销部、产品部、客户服务部、基金清算部、信息技术部、电子商务部、监察稽核部、财务部、行政部共13个职能部门。其中，投资管理部负责基金资产的投资运作及宏观经济、行业、上市公司等方面的研究;交易部负责交易执行。
11、人员情况:截止2011年3月7日，公司共有员工106名，大学本科及以上学历103名，占员工总数97%。
12、信息披露负责人及咨询电话:唐世春，021-68649788。
13、基金管理业务情况简介:截至目前，本基金管理人共管理11只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金、信诚金砖四国积极配置证券投资基金和信诚中证500指数分级证券投资基金。管理资产规模约167.56亿元人民币（截止至2011年3月7日）。
14、本基金基金经理:吴雅楠先生，统计物理学博士，CFA，14年证券、基金从业经验，拥有丰富的量化投资和指数基金管理经验。曾任职于加拿大Greydanus, Boeckh & Associates公司和加拿大道明资产管理公司（TD Asset Management）。现任公司投资管理部数量分析总监兼信诚中证500指数分级基金的基金经理。
（二）基金托管人
1、名称:中国建设银行股份有限公司
2、法定代表人:郭树清
3、注册资本:贰仟叁佰叁拾伍亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
4、注册地址：北京市西城区金融大街25号
5、专门基金托管部门负责人及人员情况:中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了"业内最干净的无保留意见的报告"，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。
6、信息披露负责人及咨询电话：尹东，010-67595003。
7、托管业务情况简介:作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2010年12月31日，中国建设银行已托管178只证券投资基金，其中封闭式基金6只，开放式基金172只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。
（三）基金验资机构
1、名称:毕马威华振会计师事务所
2、法定代表人:萧伟强
3、注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
4、经办注册会计师:王国蓓、黄小熠
5、电话:（8621）2212 2888

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

信诚中证500指数分级证券投资基金2011年3月7日资产负债表如下:

单位:人民币元

项目	2011年3月7日
资产	
银行存款	18,145,559.85
结算备付金	7,352,505.27
存出保证金	–
交易性金融资产	118,003,955.80
其中:股票投资	115,251,117.14
债券投资	2,752,838.66
资产支持证券投资	–
基金投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	222,000,000.00
应收证券清算款	12,005,745.56
应收利息	89,669.81
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	–
资产合计	377,597,436.29
负债	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	72,101.21
应付托管费	15,862.27
应付指数使用费	13,750.00
应付交易费用	93,569.62
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	30,864.00
负债合计	226,147.10
所有者权益	
实收基金	374,254,300.10
未分配利润	3,116,989.09
所有者权益合计	377,371,289.19
负债与持有人权益总计	377,597,436.29

八、基金投资组合

截止到2011年3月7日，本基金的投资组合如下:
（一）基金资产组合情况

项目	金额（元）	金额占基金总资产比例（%）
股票	115,251,117.14	30.52
债券	2,752,838.66	0.73
权证	–	–
银行存款及结算备付金	25,498,065.12	6.75
其他资产	234,095,415.37	62.00
合计	377,597,436.29	100.00

（二）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	2,167,259.50	0.57
B	采掘业	1,752,731.82	0.46
C	制造业	67,691,733.10	17.94
C0	食品、饮料	3,988,625.30	1.06
C1	纺织、服装、皮毛	3,291,825.84	0.87
C2	木材、家具	1,011,264.21	0.27
C3	造纸、印刷	2,566,564.49	0.68
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,959,554.12	3.43
C5	电子	9,155,984.61	2.43
C6	金属、非金属	9,954,613.17	2.64
C7	机械、设备、仪表	14,219,161.88	3.77
C8	医药、生物制品	9,372,511.48	2.48
C99	其他制造业	1,171,628.00	0.31
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,229,628.95	1.39
E	建筑业	3,114,008.51	0.83
F	交通运输、仓储业	5,272,309.13	1.40
G	信息技术业	8,019,325.91	2.13
H	批发和零售贸易	8,230,365.08	2.18
I	金融、保险业	855,843.00	0.23
J	房地产业	6,218,113.02	1.65
K	社会服务业	2,453,218.60	0.65
L	传播与文化产业	2,031,931.48	0.54
M	综合类	2,214,649.04	0.59
	合计	115,251,117.14	30.54

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600252	中恒集团	39,000	1,301,820.00	0.35
2	002123	荣信股份	21,762	888,977.70	0.24
3	000636	风华高科	70,640	852,624.80	0.23
4	600499	科达机电	38,700	793,350.00	0.21
5	600880	博瑞传播	42,300	760,977.00	0.20
6	000877	天山股份	18,857	751,828.59	0.20
7	600570	恒生电子	41,965	738,164.35	0.20
8	002038	双鹭药业	13,700	736,512.00	0.20
9	600971	恒源煤电	15,010	735,490.00	0.19
10	000400	许继电气	21,600	733,320.00	0.19

（四）按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	2,752,838.66	0.73
7	其他	–	–
8	合计	2,752,838.66	0.73

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	17,750	1,920,372.50	0.51
2	125887	中鼎转债	6,480	832,466.16	0.22
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

（六）投资组合报告附注
1、本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、期末其他资产构成

项目	金额（元）
存出保证金	–
应收利息	89,669.81
应收申购款	–
合计	89,669.81

4、本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、本报告期末本基金无权证投资。
6、本报告期末本基金无资产支持证券投资。
7、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可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易之后履行托管人职责做出如下承诺:
（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。
（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录
1、中国证监会批准信诚中证500指数分级证券投资基金募集的文件
2、《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》
3、《信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书》
4、《信诚中证500指数分级证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、基金托管人业务资格批件、营业执照
（二）存放地点:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
（三）查阅方式:
1、书面查询:投资者可在我公司营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
2、网站查询:www.citicprufunds.com.cn

信诚基金管理有限公司
2011年3月9日

附件:信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，投资人自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为:
1.分享基金财产收益;
2.参与分配清算后的剩余基金财产;
3.依法转让其持有的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额，依法申请赎回其持有的信诚中证500份额;
4.按照规定要求召开基金份额持有人大会;
5.出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
6.查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
7.监督基金管理人的投资运作;
8.对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
9.法律法规和基金合同规定的其他权利。
（二）基金份额持有人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为:
1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
2.提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性;
3.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
4.在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
5.不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
6.执行生效的基金份额持有人大会决议;
7.返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
8.法律法规和基金合同规定的其他义务。
（三）基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为:
1.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3.发售基金份额;
4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理信诚中证500份额的申购和赎回申请;
8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
9.自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
10.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查;
11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人;
13.依法召集基金份额持有人大会;
14.法律法规和基金合同规定的其他权利。
（四）基金管理人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为:
1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2.办理基金备案手续;
3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资;
6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产;
7.依法接受基金托管人的监督;
8.计算并公告基金资产净值、信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证500份额的申购、赎回价格;
9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
10.按规定受理信诚中证500份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项;
11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
12.编制中期和年度基金报告;
13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务;
14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露;
15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益;
16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
17.依据《基金法》等的规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
18.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
19.组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除;
21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人;
24.执行生效的基金份额持有人大会决议;
25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理;
27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（五）基金托管人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为:
1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
2.监督基金管理人对本基金的投资运作;
3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产;
4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人;
5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
6.依法召集基金份额持有人大会;
7.按规定取得基金份额持有人名册资料;
8.法律法规和基金合同规定的其他权利。
（六）基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为:
1.安全保管基金财产;
2.设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜;
3.对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立;
4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产;
5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
7.保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露;
8.对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
10.按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜;
11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证500份额的申购、赎回价格;
13.按照规定监督基金管理人的投资运作;
14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
15.依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
17.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除;
18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿;
19.参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人;
21.执行生效的基金份额持有人大会决议;
22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
23.建立并保存基金份额持有人名册;
24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（七）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称变更而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

（二）召开事由
1.当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人、单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会:
（1）终止基金合同;
（2）转换基金运作方式;
（3）变更基金类别;
（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）;
（5）变更基金份额持有人大会程序;
（6）更换基金管理人、基金托管人;
（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;
（8）本基金与其他基金的合并;
（9）终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作;
（10）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
（11）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同或其他相关法律文件，不需召开基金份额持有人大会:
（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整信诚中证500份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率;
（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
（三）召集人和召集方式
1.除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。
2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。
3.单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集，单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。
4.单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。
5.基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。
（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
1.基金份额持有人大会的召集人（以下简称"召集人"）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:
（1）会议召开的时间、地点和出席方式;
（2）会议拟审议的主要事项;
（3）会议形式;
（4）议事程序;
（5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
（6）代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点;
（7）表决方式;
（8）会务常设联系人姓名、电话;
（9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
（10）召集人需要通知的其他事项。
2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。在法律法规和监管机关允许的情况下，表决方式亦可采用网上表决、电话表决等其他表决方式。
3.如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人经有效通知而拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
（五）基金份额持有人出席会议的方式
1.会议方式
（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
（3）通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯方式开会应按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决。
（4）会议的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。
2.召开基金份额持有人大会的条件
（1）现场开会方式
在同时符合以下条件时，现场会议方可举行:
1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额应占权益登记日各自基金份额的50%以上（含50%，下同）;
2）到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。
（2）通讯开会方式
在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行:
1）召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告;
2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或和基金管理人（分别或共同称为"监督人"）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;
3）召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经有效通知拒不到场监督的，不影响表决效力;
4）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额占权益登记日各自基金份额的50%以上;
5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。
（六）议事内容与程序
1.议事内容及提案权
（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。
（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。
（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:
关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议;对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。
（4）单独或合并持有权益登记日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。
（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。
2.议事程序
（1）现场开会
在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。
大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。
召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。
（2）通讯方式开会
在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。
3.基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
（七）决议形成的条件、表决方式、程序
1.信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的表决权。
2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
（1）一般决议
一般决议须经出席会议的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的50%以上通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;
（2）特别决议
特别决议须经出席会议的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。
3.基金份额持有人大会决定的事项，应当在五日内依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。
4.采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
6.基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
（八）计票
1.现场开会
（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。
（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。
（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
2.通讯方式开会
在通讯方式开会的情况下，计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。
（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式
1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。
2.生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。
3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金财产拨划支付的银行费用;
4.基金合同生效后的基金信息披露费用;
5.基金份额持有人大会费用;
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7.基金的证券交易费用;
8.基金上市初费和上市月费;
9.账户开户费和账户维护费;
10.基金合同生效后的标的指数许可使用费;
11.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。
3.基金合同生效后的标的指数许可使用费
标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算;标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。
在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计算。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。
计算方法如下:
收取下限的日均摊销数额=5万/季度＊4季度/年÷当年天数（365天或366天）≈550元/天
H=Max（E×0.02%/当年天数，550）
H为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值
标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。
4.除管理费、托管费、标的指数许可使用费和前述十九（一）所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。
（四）不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
（六）基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
（二）投资限制
1.组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
（1）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%;
（2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%;
（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
（4）本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%;
（5）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%;
（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%;
（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%;
（8）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
（9）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
（10）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
（11）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
（12）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
（13）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%;
（14）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%;其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等;
（15）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;
（16）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%，且不得超过基金资产净值的95%;
（17）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;
（18）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;
如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的资产配置比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动:
（1）承销证券;
（2）向他人贷款或者提供担保;
（3）从事承担无限责任的投资;
（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外;
（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动;
（9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）估值日
本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。
（二）估值方法
1.证券交易所上市的有价证券的估值
（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定估值价;
（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定估值价;
（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定估值价;
（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:
（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;在证券交易所挂牌的同一股票在估值日无交易的，以根据1.（1）确定的同一股票的估值价估值;
（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值;
（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值价估值;非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
3.全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。
4.同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。
5.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
6.相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。
如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。
根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。
（三）估值对象
基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。
（四）基金份额净值的计算
本基金分别计算并公告信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值。
1.信诚中证500份额的基金份额净值计算
T日信诚中证500份额的基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额）的基金份额余额总数
2.信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算
假设T日为基金份额净值计算日，t=min（自基金合同生效日至T日，自最近一个份额折算日次日至T日），$NAV500_t$为T日信诚中证500份额的基金份额净值，$NAVA_t$为T日信诚中证500 A份额的基金份额净值，$NAVB_t$为T日信诚中证500 B份额的基金份额净值，R年为信诚中证500 A份额的约定年收益率。

$$NAVB_t=(NAV500_t-0.4\times NAVA_t)/0.6$$

例：假设t=99，运作周年实际天数为365天，R年=5.70%，$NAVA_0=1.000$，$NAV500_{99}=1.400$：

$$NAVA_{99}=1.000+5.70\%\times 99/365=1.015$$

$$NAVB_{99}=(1.400-0.4\times 1.015)/0.6=1.657$$

信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。
T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。
（五）估值程序
1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后，按照十八（四）所述的计算方式确定，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。
每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。
2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。
（六）估值错误的处理
基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。
本基金合同的当事人应按照以下约定处理:
1.差错类型
本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（"受损方"）的直接损失按下述"差错处理原则"给予赔偿，承担赔偿责任。
上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。
由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。
2.差错处理原则
（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。
（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。
（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（"受损方"），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。
（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。
（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。
（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。
（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。
3.差错处理程序
差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下:
（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方;
（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;
（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;
（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。
4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:
（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
（2）错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。
（3）因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。
（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。
（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。
（七）暂停估值的情形
1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2.因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值;
4.中国证监会和基金合同认定的其它情形。
（八）基金净值的确认
用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。
（九）特殊情况的处理
1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算

（一）基金合同的变更
1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。
（1）转换基金运作方式;
（2）变更基金类别;
（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）;
（4）变更基金份额持有人大会程序;
（5）更换基金管理人、基金托管人;
（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;
（7）本基金与其他基金的合并;
（8）终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作;
（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
（10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案:
（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整信诚中证500份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率;
（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。
（二）本基金合同的终止
有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止:
1.基金份额持有人大会决定终止的;
2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
4.中国证监会规定的其他情况。
（三）基金财产的清算
1.基金财产清算组
（1）基金合同终止之日起30个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
2.基金财产清算程序
基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:
（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告;
（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产;
（3）对基金财产进行清理和确认;
（4）对基金财产进行估价和变现;
（5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
（6）聘请律师事务所出具法律意见书;
（7）将基金财产清算结果报告中国证监会;
（8）参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁;
（9）公布基金财产清算结果;
（10）对基金剩余财产进行分配。
3.清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。
4.基金财产按下列顺序清偿:
（1）支付清算费用;
（2）交纳所欠税款;
（3）清偿基金债务;
（4）根据基金合同终止日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额净值分别计算信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。
基金财产未按前款（1）-（3）项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。
经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
5.基金财产清算的公告
基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。
6.基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

信诚基金管理有限公司关于信诚货币市场证券投资基金增加兴业银行为代销机构的公告

根据信诚基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与兴业银行股份有限公司签署的基金销售代理协议，自2011年3月10日起，本公司旗下的信诚货币市场证券投资基金（基金代码:A类550010、B类550011）增加兴业银行股份有限公司为代销机构。

自2011年3月10日起，投资者可在兴业银行股份有限公司的各指定营业网点办理信诚货币市场证券投资基金的开户、认购及其他相关业务，具体办理程序请遵循代销机构的规定。

投资者欲了解信诚货币市场证券投资基金的详细情况，请详细阅读刊登在2011年2月19日《证券时报》和本公司网站、2011年2月21日《中国证券报》和2011年2月22日《上海证券报》的《信诚货币市场证券投资基金招募说明书》。

一、投资者可以通过以下途径咨询有关情况:
1、兴业银行股份有限公司
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn
2、投资者也可致电信诚基金管理公司客户服务电话400-666-0066、021-51085168，或登录本公司网站www.citicprufunds.com.cn查询。

二、风险提示

本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，也不保证最低收益。投资者投资基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

信诚基金管理有限公司
2011年3月9日

信诚中证500指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告

公告送出日期:2011年3月9日

1 公告基本信息

基金名称	信诚中证500指数分级证券投资基金	
基金简称 场内基金简称	信诚中证500指数分级 信诚500	
基金主代码	165511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年2月11日	
基金管理人名称	信诚基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限公司	
公告依据	《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2011年3月14日	
赎回起始日	2011年3月14日	
定期定额投资起始日	2011年3月14日	
下属分级基金的基金简称	信诚中证500指数分级A	信诚中证500指数分级B
下属分级基金的交易代码	150028	150029
该分级基金是否开放申购、赎回、定期定额投资	否	否

2 日常申购、赎回、定期定额投资业务的办理时间

本基金申购、赎回和定期定额投资业务的开放日为投资人或信诚中证500指数分级份额持有人办理信诚中证500指数分级份额申购、赎回等业务的上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日（基金管理人根据相关法律法规及基金合同的规定公告暂停信诚中证500指数分级份额申购、赎回时除外）。各销售机构的具体业务办理时间参见基金销售机构的相关公告。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理信诚中证500指数分级份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请并被受理的，其信诚中证500指数分级份额申购、赎回价格为下一开放日信诚中证500指数分级份额申购、赎回的价格。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资人在办理信诚中证500指数分级份额场内申购时，单笔申购的最低金额为1,000元人民币。投资人办理信诚中证500指数分级份额场外申购时，单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购的最低金额为50万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。通过本公司网上交易系统办理信诚中证500指数分级份额申购业务的不受直销网点单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔1,000元。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

3.2 申购费率
1.根据基金合同的规定，信诚中证500指数分级份额的申购费率不超过5%。
2.信诚中证500指数分级份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。
3.信诚中证500指数分级份额的场外申购费率如下:
3.2.1 前端收费

单笔申购金额	场外申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<200万	0.8%
200万≤M<500万	0.4%
M≥500万	1000元/笔

（注:M:申购金额;单位:元）

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

信诚中证500指数分级份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于1000份信诚中证500指数分级份额，且通过场内单笔申请赎回的信诚中证500指数分级份额必须是整数份;信诚中证500指数分级份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的信诚中证500指数分级份额余额不足1000份的，需一并全部赎回。

4.2 赎回费率
1.根据基金合同的规定，信诚中证500指数分级份额的赎回费率不超过5%。
2.信诚中证500指数分级份额的场内赎回费率为固定值0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。
3.信诚中证500指数分级份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下:

持有时间	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注:从场内转托管至场外的信诚中证500指数分级份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

5 定期定额投资业务

本基金同时开通本基金定期定额投资业务的代销机构包括:中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、安信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司。

网上直销平台开通本基金定期定额投资业务的银行卡和相关优惠费率情况如下:

中国农业银行金穗卡定期定额投资业务:实行4折的优惠费率，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金相关公告中规定的相应申购费率等于或低于0.6%及适用固定费率的，执行相应公告的申购费率。

招商银行一卡通定期定额投资业务:实行8折的优惠费率，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金相关公告中规定的相应申购费率等于或低于0.6%及适用固定费率的，执行相应公告的申购费率。

有关定期定额投资的具体业务规则请查询2008年10月6日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站的《信诚基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务规则的公告》。

6 基金销售机构
6.1 场外销售机构
6.1.1 直销机构
信诚基金管理有限公司
（1）直销柜台:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层，邮编200120，直销传真:021-50120895
（2）网上直销平台:交易网址www.citicprufunds.com.cn

目前，网上直销平台可以使用的银行卡和相关优惠费率情况如下:

中国农业银行金穗卡:实行7折的优惠费率，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金相关公告中规定的相应申购费率等于或低于0.6%及适用固定费率的，执行相应公告的申购费率。

中国建设银行龙卡:实行8折的优惠费率，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金相关公告中规定的相应申购费率等于或低于0.6%及适用固定费率的，执行相应公告的申购费率。

招商银行一卡通:实行8折的优惠费率，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金相关公告中规定的相应申购费率等于或低于0.6%及适用固定费率的，执行相应公告的申购费率。

客服热线:400-666-0066、021-51085168。

6.1.2 场外非直销机构

中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、长江证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司等基金代销机构的营业网点（具体申购赎回安排和网点名单请查阅本基金招募说明书和发售公告以及其他相关的业务公告）。

6.2 场内销售机构
深圳证券交易所（场内）发售机构

7 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

1.在信诚中证500指数分级A份额、信诚中证500指数分级B份额上市交易或开始办理信诚中证500指数分级份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日信诚中证500指数分级份额、信诚中证500指数分级A份额与信诚中证500指数分级B份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值;

2.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和信诚中证500指数分级份额、信诚中证500指数分级A份额与信诚中证500指数分级B份额的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、以及信诚中证500指数分级份额、信诚中证500指数分级A份额与信诚中证500指数分级B份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

8 其他需要提示的事项

1、本基金为契约型开放式证券投资基金，基金管理人为信诚基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

2、对未开设销售网点地区的投资人，请拨打本公司的客户服务电话（400-666-0066、021-51085168）咨询基金交易等事宜。投资人亦可通过本公司网站（www.citicprufunds.com.cn）下载基金业务表单和了解基金交易等事宜。

3、为确保投资人能够及时收到对账单，请投资人注意核对开户信息是否准确、完整。如需补充或更改，请及时到原开户机构更正相关资料。

4、本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，也不保证最低收益。敬请投资人于投资前认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》。

特此公告。

信诚基金管理有限公司
2011年3月9日