

信诚货币市场证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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:2011年7月21日

重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2011年7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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不表示其未来表现,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。

本报告自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, type, and objectives.

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for two periods.

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

Table with 6 columns: Period, Net Value Growth, Benchmark, etc.

注:本基金合同生效日为2011年3月23日,至2011年6月30日不满一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同生效日为2011年3月23日,至2011年6月30日不满一年。

2.本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件,全面认识本基金的风险收益特征,谨慎做出投资决策,并承担投资风险。

3.根据法律法规及基金合同约定,本基金建仓期为自基金合同生效之日起六个月,至本报告期末尚未处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介

Table with 4 columns: Name, Position, Start Date, Bio.

注:1.上述任职日期、离任日期指公司作出决定的聘任日期。

2.本基金基金经理的聘任日期以中国证监会核准日期为准。

3.本报告期末本基金基金经理的相关信息如下:

4.2 管理人对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》及其他相关法律法规的规定以及《信诚货币市场证券投资基金基金合同》、《信诚货币市场证券投资基金托管协议》和其他基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在符合法律法规及基金合同约定的范围内,按照合同约定的投资范围、投资策略进行投资,未发生任何违法违规行为,也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司采取了一系列行动落实指导意见中的各项要求,明确了各项公平交易制度的具体责任,在日常交易中,严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控,对于交易所公开竞价交易,在恒生交易系统严格执行公平交易程序,确保不同基金在交易同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易,通过业务流程序,实现场内公平交易程序。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易的专项说明

本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现和资产配置

2011年二季度,宏观经济增速放缓,通胀压力依然较大,货币政策保持稳健,市场流动性充裕,债券市场表现较好,股票市场震荡调整,大宗商品市场波动较大,有色金属价格高位运行,农产品价格高位运行,能源价格高位运行,整体来看,二季度市场波动较大,本基金在报告期内较好地把握了市场机会,实现了较好的投资业绩。

4.5 投资组合报告

4.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion, etc.

4.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, Proportion, etc.

4.5.3 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

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.4 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债券投资明细

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.5 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.6 报告期末持有的所有权证的投资明细

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.7 报告期末持有的所有衍生品投资

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.8 报告期末持有的所有贵金属投资

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.9 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.10 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.11 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.12 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.13 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.14 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.15 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.16 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.17 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.18 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.19 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.20 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.21 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.22 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.23 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.24 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.25 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.26 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.27 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.28 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.29 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.30 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.31 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.32 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.33 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.34 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.35 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.36 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.37 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.38 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.39 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.40 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.41 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.42 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.43 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.44 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.45 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.46 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.47 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.48 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.49 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.50 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.51 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.52 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.53 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.54 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.55 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.56 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.57 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.58 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.59 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.60 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.61 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.62 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.63 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.64 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.65 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.66 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.67 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.68 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.69 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.70 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.71 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.72 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.73 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.74 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.75 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.76 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.77 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.78 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.79 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.80 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.81 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.82 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.83 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.84 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.85 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.86 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.87 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.88 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.89 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.90 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.91 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.92 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.93 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.94 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.95 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.96 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.97 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.98 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.99 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.100 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.101 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.102 报告期末持有的所有其他资产

Table with 5 columns: Code, Name, Amount, Value, Proportion.

4.5.103 报告期末持有的所有其他资产