

信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书(摘要)

(2012年第1次更新)

【重要提示】
 本基金于2011年2月11日基金合同正式生效,投资者有风险,投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。
 本基金的基金管理人信诚基金管理有限公司,由基金合同当事人共同签署,基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人、基金份额持有人。基金合同当事人按照基金合同的约定享有权利承担义务,基金份额持有人持有的基金份额,由基金托管人保管,基金份额持有人依法转让基金份额的行为,并不视为基金份额持有人对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的委托,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不承担由此产生的法律责任。
 本基金的基金管理人信诚基金管理有限公司,由基金合同当事人共同签署,基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人、基金份额持有人。基金合同当事人按照基金合同的约定享有权利承担义务,基金份额持有人持有的基金份额,由基金托管人保管,基金份额持有人依法转让基金份额的行为,并不视为基金份额持有人对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的委托,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不承担由此产生的法律责任。

基金管理人	基金托管人	基金销售机构
信诚基金管理有限公司 住所: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 办公地址: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 法定代表人:张烁 成立时间:2005年9月30日 电话:021-68654978 传真:021-68654978 联系人:陈琳琳 网址:www.citicfund.com	中国工商银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街26号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号 法定代表人:姜建清 成立时间:1985年10月1日 电话:010-66105811 传真:010-66105811 联系人:李秀林 网址:www.icbc.com.cn	中信银行股份有限公司 住所:北京市东城区信报街33号 办公地址:北京市东城区信报街33号 法定代表人:魏庆华 成立时间:2005年8月26日 电话:010-65557888 传真:010-65557888 联系人:李秀林 网址:www.citicbank.com

基金管理人	基金托管人	基金销售机构
信诚基金管理有限公司 住所: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 办公地址: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 法定代表人:张烁 成立时间:2005年9月30日 电话:021-68654978 传真:021-68654978 联系人:陈琳琳 网址:www.citicfund.com	中国工商银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街26号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号 法定代表人:姜建清 成立时间:1985年10月1日 电话:010-66105811 传真:010-66105811 联系人:李秀林 网址:www.icbc.com.cn	中信银行股份有限公司 住所:北京市东城区信报街33号 办公地址:北京市东城区信报街33号 法定代表人:魏庆华 成立时间:2005年8月26日 电话:010-65557888 传真:010-65557888 联系人:李秀林 网址:www.citicbank.com

一、基金管理人概况
 1. 基金管理人:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

二、基金托管人概况
 1. 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
 住所:北京市西城区复兴门内大街26号
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号
 法定代表人:姜建清
 成立时间:1985年10月1日
 电话:010-66105811
 传真:010-66105811
 联系人:李秀林
 网址:www.icbc.com.cn

三、基金销售机构
 1. 直销机构:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

四、基金募集
 1. 基金募集:信诚中证500指数分级证券投资基金
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

五、基金合同
 1. 基金合同:信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

六、基金费用
 1. 基金费用:信诚中证500指数分级证券投资基金基金费用
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

七、基金的投资
 1. 基金投资:信诚中证500指数分级证券投资基金基金投资
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

八、基金的业绩
 1. 基金业绩:信诚中证500指数分级证券投资基金基金业绩
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

九、基金的风险
 1. 基金风险:信诚中证500指数分级证券投资基金基金风险
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十、基金的信息披露
 1. 基金信息披露:信诚中证500指数分级证券投资基金基金信息披露
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十一、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

基金管理人:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

一、基金管理人概况
 1. 基金管理人:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

二、基金托管人概况
 1. 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
 住所:北京市西城区复兴门内大街26号
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号
 法定代表人:姜建清
 成立时间:1985年10月1日
 电话:010-66105811
 传真:010-66105811
 联系人:李秀林
 网址:www.icbc.com.cn

三、基金销售机构
 1. 直销机构:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

四、基金募集
 1. 基金募集:信诚中证500指数分级证券投资基金
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

五、基金合同
 1. 基金合同:信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

六、基金费用
 1. 基金费用:信诚中证500指数分级证券投资基金基金费用
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

七、基金的投资
 1. 基金投资:信诚中证500指数分级证券投资基金基金投资
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

八、基金的业绩
 1. 基金业绩:信诚中证500指数分级证券投资基金基金业绩
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

九、基金的风险
 1. 基金风险:信诚中证500指数分级证券投资基金基金风险
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十、基金的信息披露
 1. 基金信息披露:信诚中证500指数分级证券投资基金基金信息披露
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十一、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十二、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十三、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

基金管理人:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

一、基金管理人概况
 1. 基金管理人:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

二、基金托管人概况
 1. 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
 住所:北京市西城区复兴门内大街26号
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号
 法定代表人:姜建清
 成立时间:1985年10月1日
 电话:010-66105811
 传真:010-66105811
 联系人:李秀林
 网址:www.icbc.com.cn

三、基金销售机构
 1. 直销机构:信诚基金管理有限公司
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

四、基金募集
 1. 基金募集:信诚中证500指数分级证券投资基金
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

五、基金合同
 1. 基金合同:信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

六、基金费用
 1. 基金费用:信诚中证500指数分级证券投资基金基金费用
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

七、基金的投资
 1. 基金投资:信诚中证500指数分级证券投资基金基金投资
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

八、基金的业绩
 1. 基金业绩:信诚中证500指数分级证券投资基金基金业绩
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

九、基金的风险
 1. 基金风险:信诚中证500指数分级证券投资基金基金风险
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十、基金的信息披露
 1. 基金信息披露:信诚中证500指数分级证券投资基金基金信息披露
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十一、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十二、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

十三、基金的其他事项
 1. 基金其他事项:信诚中证500指数分级证券投资基金基金其他事项
 住所: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
 办公地址: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
 法定代表人:张烁
 成立时间:2005年9月30日
 电话:021-68654978
 传真:021-68654978
 联系人:陈琳琳
 网址:www.citicfund.com

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	4,284,473.56	1.26
B	制造业	8,003,629.27	2.21
C	采矿业	188,822,063.31	53.26
C0	食品、饮料	18,965,528.41	5.35
C1	纺织服装、皮毛	7,466,959.18	2.11
C2	木材、家具	1,398,600.00	0.39
C3	造纸、印刷	6,662,859.62	1.88
C4	石油、石化、塑胶	35,348,926.55	9.97
C5	电子	26,507,439.78	7.48
C6	医药、生物制品	24,255,609.58	6.84
C7	机械、设备、仪表	42,082,239.65	11.87
C8	医药、生物制品	22,052,590.43	6.22
C99	其他制造业	4,083,310.11	1.15
D	电力、煤气及水生产和供应业	15,571,025.54	4.39
E	建筑业	12,076,791.41	3.41
F	交通运输、仓储业	23,173,168.36	3.77
G	信息技术业	14,194,023.82	6.82
H	批发和零售贸易	23,688,057.47	6.68
I	金融、保险业	2,937,164.30	0.83
J	房地产业	21,880,433.10	6.17
K	社会服务业	8,397,423.86	2.37
L	传播与文化产业	2,161,931.11	0.61
M	其他类	6,504,099.99	1.83
合计		331,905,201.10	93.62

2. 股指期货投资情况
 本基金本报告期末未持有股指期货。
 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
 3.1 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	600569	宝钢股份	946,225	5,226,447.45	0.71
2	200888	鲁商置业	526,765	2,465,260.20	0.70
3	600835	上海机场	279,671	2,127,791.03	0.63
4	600570	恒生电子	180,600	2,210,344.00	0.60
5	002140	东华科技	94,997	2,184,931.00	0.62
6	600263	路桥建设	145,535	2,180,114.30	0.61
7	600750	中航工业	75,136	2,178,944.00	0.61
8	600616	美利纸业	232,100	2,174,777.00	0.61
9	00917	广电传媒	85,149	2,161,931.11	0.61
10	002342	华力创通	386,349	2,158,827.42	0.61

3.2 股指期货投资情况
 本基金本报告期末未持有股指期货。
 3.3 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权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	120905	中信转债	20,801,155.00	5.87	
2	110115	石化转债	9,750	979,972.50	0.28
3	125887	中航转债	4,480	473,347.84	0.13
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五名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 5. 报告期末前十名股票公允价值变动情况
 本基金本报告期末前十名股票公允价值变动情况如下:

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	010203	02国债(3)	207,700	20,801,155.00	5.87
2	110115	石化转债	9,750	979,972.50	0.28
3	125887	中航转债	4,480	473,347.84	0.13
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6. 报告期末前十名股票公允价值变动情况
 本基金本报告期末前十名股票公允价值变动情况如下:

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	010203	02国债(3)	207,700	20,801,155.00	5.87
2	110115	石化转债	9,750	979,972.50	0.28
3	125887	中航转债	4,480	473,347.84	0.13
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7. 报告期末前十名股票公允价值变动情况
 本基金本报告期末前十名股票公允价值变动情况如下: