# 信诚中小盘股票型证券投资基金

# 2011 年度报告摘要

2011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**
**送出日期:2012年3月27日**

## §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2012年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 信诚中小盘股票 |
| 基金主代码 | 550009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年2月10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 |
| 报告期末基金份额总额 | 239,350,693.61份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过重点投资于具有较高成长性或具有价值优势的中小盘股票,追求高于业绩比较基准的超额收益,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略:本基金的资产配置策略基于MVSR分析框架来制定。MVSR分析框架包括四个部分:M-宏观经济情况,V-估值水平,S-市场情况,R-风险状况。对上述四个部分,本基金会进行最近三个月和未来12个月的分析和预测,从而得出乐观、中性、谨慎和悲观的看法,在这些分析的基础上,得出对市场、行业的整体判断和指数运行空间的判断,并根据这些判断来决定本基金的大类资产配置比例和行业配置策略。<br>2、股票投资策略:本基金通过重点投资中小盘股票,以期把握中小企业两类投资机会:高速成长预期所带来的上升动量以及由于低关注度所带来的价格回归。本基金的股票投资将以"自下而上"的精选策略为主,同时结合"自上而下"的分析对公司成长性进行逻辑性判断,以甄别具有较高成长性抑或具有价值优势的中小盘股票。通过广泛深入的实地调研和细致严谨的案头分析,本基金将根据对中小盘股票的成长性及其可持续性、行业前景及行业地位,结合估值水平,进行股票组合的构建。 |
| 业绩比较基准 | 40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 信诚基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 唐世春 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-68649788 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | shichun.tang@citicpru.com.cn | yindong.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-666-0066/021-51085168 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-50120888 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.citicprufunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2011年 | 2010年02月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -64,790,608.90 | 47,062,865.58 |
| 本期利润 | -78,557,154.09 | 49,612,697.36 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2848 | 0.1107 |
| 本期基金份额净值增长率 | -30.23% | 10.62% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3188 | -0.0237 |
| 期末基金资产净值 | 163,051,898.79 | 280,862,698.49 |
| 期末基金份额净值 | 0.681 | 0.976 |

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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同自2010年2月10日起生效,因此本表2010年度可比期间为2010年2月10日至2010年12月31日。本报告期为2011年1月1日至2011年12月31日。

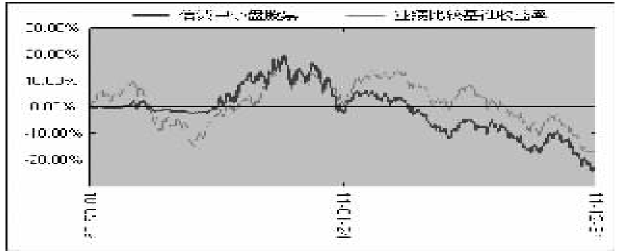
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -7.85% | 1.33% | -10.11% | 1.25% | 2.26% | 0.08% |
| 过去六个月 | -15.93% | 1.18% | -21.11% | 1.18% | 5.18% | 0.00% |
| 过去一年 | -30.23% | 1.10% | -24.14% | 1.13% | -6.09% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -22.81% | 1.15% | -17.75% | 1.24% | -5.06% | -0.09% |

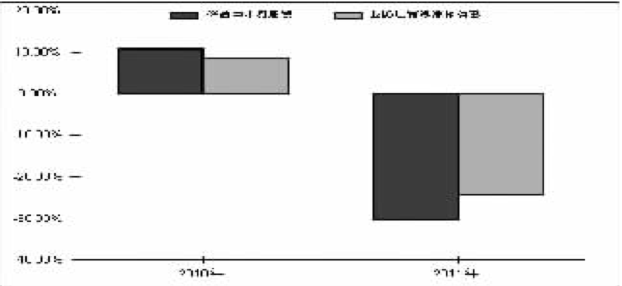
注:本基金业绩比较基准为40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2月10日至2010年8月9日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2011 | - | - | - | - | 本基金本期未分红。 |
| 2010 | 1.300 | 31,862,207.51 | 2,213,083.92 | 34,075,291.43 | 本基金本期分红两次。 |
| 合计 | 1.300 | 31,862,207.51 | 2,213,083.92 | 34,075,291.43 | 本基金最近两年共利润分配两次 |

注:本基金合同自2010年2月10日起生效,本基金于本报告期内未进行过利润分配。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2005年9月30日正式成立,注册资本2亿元,注册地为上海。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%。截至2011年底,本基金管理人共管理14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(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)和信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 闫志刚 | 本基金基金经理、信诚四季红混合的基金经理 | 2010年2月10日 | - | 10 | 清华大学MBA,历任世纪证券有限责任公司投行部高级经理、平安证券有限责任公司投行事业部项目经理、平安资产管理有限责任公司股票投资部投资经理。于2008年7月加盟信诚基金投资管理部,2009年7月14日起至12月31日担任保诚韩国中国龙A股基金(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),2010年2月10日起至今担任信诚中小盘股票型证券投资基金和信诚四季红混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 程竞 | 本基金基金经理 | 2011年7月19日 | - | 2 | 金融学硕士。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司、华泰联合证券研究所。2009年6月加入信诚基金管理有限公司。 |

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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基金合同和招募说明书的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。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,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任,在日常交易中,严格按照《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,在恒生交易系统中执行公平交易程序,确保不同基金在买卖同一证券时,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,通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年,经济经历过热向衰退的快速变迁。通胀压力下,政府动用价格、数量型货币政策,加大调控力度。调控成效在下半年得以显现。而紧缩的货币政策通过流动性传导也影响到实体经济增速和证券市场估值水平。同时,外部环境的不确定性也在加大。经济增长模式问题和欧元区财政、货币政策的错配致使欧债问题集中爆发,影响到经济增速预期和风险溢价。

一系列问题使A股市场承受了较大的压力。创业板、中小板股票在流动性趋紧、业绩不达预期、供给及减持压力下,估值泡沫破灭。而大盘蓝筹股在经济减速预期下,估值进一步下调。报告期内,基于经济转型背景,基金未对成长型股票做出及时调整。而部分公司亦受经济增速下行影响,出现业绩和估值的"戴维斯双杀",拖累了净值表现。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

截至2011年12月31日,本基金年度份额净值增长率为-30.23%,同期业绩比较基准增长率为-24.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年,通胀和经济下行趋势较为确定。同时,通胀压力的缓解为货币政策和财政政策的调整提供了空间。通胀下行有利于无风险利率修正,外汇占款和信贷综合影响的流动性改善以及欧债危机的缓解有利于风险溢价修正。整体估值水平提升和盈利波动构成了影响市场的核心驱动因素。不同阶段预期影响下市场波动将加大,但整体环境好于去年。低估值大盘蓝筹股和增长确定性高的成长股都将受益于估值水平的提升。

本基金将采取积极的心态和稳健的操作,重点关注不同行业利润周期驱动下的投资机会,并重点关注具备核心驱动力、受益于转型背景的公司。组合管理上重视下行风险、波动度和跟踪误差,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定和回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011年度内,公司依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,在督察长的指导和监察稽核部的努力下,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1、针对上海证监局现场检查的反馈意见进行整改

公司于2011年2月15日收到上海证监局下发的《关于信诚基金管理有限公司现场检查的反馈意见函》。公司对《反馈意见函》中提出的问题及工作要求高度重视,迅速按照相关要求制定整改计划并开展整改工作。为保证整改工作的持续性,公司已将检查发现问题作为关注点列入《监察稽核项目表》,在每季度的常规检查中均会重点关注落实情况或执行情况。截至2011年二季度末各项检查发现问题都已整改完毕。

2、对公司管理制度体系不断修订和完善

监察稽核部负责对公司制定的规章制度进行审核和修订。2011年度,公司修订和发布的主要制度包括《总经理办公会议事规则》、《投资咨询业务管理制度》、《银行间债券市场交易对手管理办法》、《固有资金投资基金操作手册》、《营销活动管理制度》、《员工报销制度》、《反洗钱内部控制制度》、《基金备选库管理制度》、《直销业务流程手册》、《估值决策委员会议事规则》、《债券投资管理制度》、《债券分销工作流程》、《新股IPO询价申购业务流程》、《境外基金投资备选库管理制度》、《离任审计和离任审查管理制度》、《估值决策委员会议事规则》、《新股IPO询价申购工作流程》等,并对公司的所有基本管理制度进行了一轮梳理。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

3、开展日常的投资合规监控工作

在投资合规监控方面,公司严格遵照法律法规和公司制度对公司和基金运作的合规情况进行监控。在基金日常投资运作过程中,监察稽核部和风险管理部对基金投资进行了事前、事中和事后的全方位监控,发现问题及时与相关部门沟通。开展的主要工作包括:

(1)基金投资的各项阀值设置和修改都必须通过监察稽核部的事先审核。

(2)风险管理部对基金的投资进行日常监控,每日填写监控日志,对违反法律法规或内部制度规定的行为予以记录并督促整改。定期监测在各个交易席位上的交易量,防止过于集中。

(3)监察稽核部定期检查基金经理在出差时的书面授权、新股申购流程等,定期抽查投资决策是否有研究报告的支持以及股票库的建立和维护是否符合公司有关制度。

(4)对新上岗的投资交易人员在上岗前进行一对一的合规培训,强化投资交易人员对合规要求的理解,提高投资交易人员的合规意识。

4、对各类法律文件和基金营销材料进行合规审核

材料审核包括各类法定信息披露文件、新产品申报材料、基金宣传推介材料、各类新闻通稿、媒体采访稿、各类合同协议等,确保各项材料的合法合规性。对于基金募集和持续营销的宣传推介材料,均经公司督察长检查,出具合规意见书,经副总经理复核并出具复核意见,按要求向监管部门报备。

5、积极开展各类合规培训

监察稽核部及时将新颁布的法律法规传递给各相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。各类合规培训主要包括:

(1)全部新进公司员工在到岗内一定时间内进行合规培训;

(2)对投资管理人员(基金经理、咨询业务投资经理、交易总监等)进行上岗前的专项合规培训;

(3)对公司全体员工进行年度的合规培训。

6、对员工个人证券投资行为进行合规监控

监察稽核部按照《员工个人证券投资及股权投资管理办法》严格要求公司员工对每季度个人证券投资情况进行申报,并定期对相关申报情况进行统计、管理和检查。

7、开展各类内部审计工作

(1)常规审计工作

监察稽核部严格按照证监会对基金公司季度监察稽核工作的要求进行了4次季度常规审计,完成监察稽核季度报告并及时报送监管部门;内容涵盖了公司治理、投资管理、营销与销售、后台营运管理、人力资源和反洗钱等方面,涉及170余个业务风险点。每次常规审计均对上季度发现问题的整改情况进行追踪,确保问题整改的及时性。

(2)专项审计工作

监察稽核部在2011年度共计开展专项审计9项,包括4次新基金募集审计工作、1次针对基金经理离任进行的离任审查、4次针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作。

其中,4次新基金募集审计工作具体包括信诚中证500指数分级证券投资基金募集审计、信诚货币市场证券投资基金募集审计、信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)募集审计以及信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)募集审计;1次基金经理离任审查为信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金和信诚深度价值股票型证券投资基金基金经理张锋离任审查;4次针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作具体包括采购业务开展情况专项审计、境外证券市场基金业务开展情况专项审计、营销费用专项审计、反洗钱年度专项审计。

在上述9项专项审计工作中,共发现23项审计问题并提出了相应的整改建议;截至本报告日,其中16项审计问题已整改完毕,其他7项按照审计报告的要求正在整改过程中。

8、信息披露与文件报备

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,的要求进行信息披露和公告,包括基金发行时的法律文件、基金季度报告、半年度报告、年度报告、分红公告以及在深圳证券交易所进行LOF基金生效、开放申赎、上市交易及定期报告等内容的公告,并报监管机关备案。2011年,我们认真按照证监会部署进行XBRL文档的测试和报送,同时做好其他文件的书面报备和网上报备。

9、牵头开展反洗钱的各项工作

(1)按时进行反洗钱工作,并按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心。在本年度触发可疑交易报警的165笔交易中,109笔是因为长期持有后的赎回,我们判断为正常交易不予上报;1笔遗产继承导致的非交易过户,资料齐全,排除洗钱嫌疑不予上报;6笔是直销机构客户,经向直销人员了解,排除洗钱嫌疑不予上报;全年累计上报可疑交易49笔,其中机构可疑交易报告3笔,个人可疑交易报告46笔;

(2)主动提醒身份信息缺失或已过有效期的客户,进行身份信息的填补、更新;

(3)通过各种形式进行了反洗钱宣传活动,开展多种形式的反洗钱培训。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:首席运营官(会议主席)、副首席运营官、风险控制总监/专员、数量研究员、交易总监、运营总监、基金会计主管。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中"基金资产净值计算和会计核算"确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2.基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

基金份额净值公告需经处理估值的操作人员、复核估值的复核人员和基金运营总监三人确认后,方可对外发布。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验

4.基金经理参与或决定估值的程度本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额(具体日期以本基金分红公告为准);

3.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%(收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

5.本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准);若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

6.基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

7.基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金于本报告期内未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## §6 审计报告

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:信诚中小盘股票型证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2011年12月31日 | 上年度末 2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 9,320,703.92 | 46,829,589.38 |
| 结算备付金 | 2,161,857.37 | 1,807,916.33 |
| 存出保证金 | 75,328.30 | 506,021.64 |
| 交易性金融资产 | 133,227,755.28 | 232,874,991.42 |
| 其中:股票投资 | 133,227,755.28 | 232,874,991.42 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 19,951,820.05 | - |
| 应收利息 | 3,683.04 | 8,224.88 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,439.34 | 378,252.12 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 164,745,587.30 | 282,404,995.77 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2011年12月31日 | 上年度末 2010年12月31日 |
| 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 | 119,976.03 | 115,006.66 |
| 应付管理人报酬 | 208,822.63 | 338,584.16 |
| 应付托管费 | 34,803.76 | 56,430.68 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 859,837.64 | 726,842.40 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 470,248.45 | 305,433.38 |
| 负债合计 | 1,693,688.51 | 1,542,297.28 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 239,350,693.61 | 287,694,881.76 |
| 未分配利润 | -76,298,794.82 | -6,832,183.27 |
| 所有者权益合计 | 163,051,898.79 | 280,862,698.49 |
| 负债和所有者权益总计 | 164,745,587.30 | 282,404,995.77 |

注:1、报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.681元,基金份额总额239,350,693.61份。

2、本基金合同自2010年2月10日起生效,可比期间为2010年2月10日至2010年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:信诚中小盘股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -69,123,772.16 | 62,911,094.57 |
| 1.利息收入 | 318,450.46 | 1,898,312.80 |
| 其中:存款利息收入 | 318,450.46 | 1,898,312.80 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -55,761,887.02 | 57,709,068.00 |
| 其中:股票投资收益 | -57,297,623.95 | 56,855,099.27 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,535,736.93 | 853,968.73 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -13,766,545.19 | 2,549,831.78 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 86,209.59 | 753,881.99 |
| 减:二、费用 | 9,433,381.93 | 13,298,397.21 |
| 1.管理人报酬 | 3,460,680.66 | 6,023,983.15 |
| 2.托管费 | 576,780.05 | 1,003,997.08 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 5,037,218.18 | 5,841,771.78 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 358,703.04 | 428,645.20 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -78,557,154.09 | 49,612,697.36 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -78,557,154.09 | 49,612,697.36 |

注:本基金合同自2010年2月10日起生效,可比期间为2010年2月10日至2010年12月31日止。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚中小盘股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 287,694,881.76 | -6,832,183.27 | 280,862,698.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -78,557,154.09 | -78,557,154.09 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -48,344,188.15 | 9,090,542.54 | -39,253,645.61 |
| 其中:1.基金申购款 | 70,168,718.26 | -12,616,593.87 | 57,552,124.39 |
| 2.基金赎回款 | -118,512,906.41 | 21,707,136.41 | -96,805,770.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 239,350,693.61 | -76,298,794.82 | 163,051,898.79 |
| 项目 | 上年度可比期间 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 603,918,903.05 | - | 603,918,903.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 49,612,697.36 | 49,612,697.36 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -316,224,021.29 | -22,369,589.20 | -338,593,610.49 |
| 其中:1.基金申购款 | 242,104,010.67 | 12,736,731.75 | 254,840,742.42 |
| 2.基金赎回款 | -558,328,031.96 | -35,106,320.95 | -593,434,352.91 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | -34,075,291.43 | -34,075,291.43 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 287,694,881.76 | -6,832,183.27 | 280,862,698.49 |

注:本基金合同自2010年2月10日起生效,可比期间为2010年2月10日至2010年12月31日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4财务报表由下列负责人签署:

| 王俊锋 | 桂思毅 | 詹朋 |
|---|---|---|
| 基金管理公司负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚中小盘股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准信诚中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]1357 号文)和《关于信诚中小盘股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2010]71号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010 年2月10 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金于2010年1 月8日至2010 年2 月5 日募集,募集资金总额603,918,903.05元,募集期间认购手续费5,237,187.75元, 利息转份额130,795.78元,募集规模为603,918,903.05 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了KPMG-B(2010)CR No.0005号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《信诚中小盘股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 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。 本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的0%-40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证不超过基金资产净值的3%。 本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。

中小盘股票包括:1)中国A股主板市场(不含中小板)的中小盘股票;2)深圳证券交易所中小板市场的所有股票;3)创业板市场的所有股票。主板市场(不含中小板)的中小盘股票的界定如下:基金管理人每半年末对A股主板市场(不含中小板)中的股票按流通市值从小到大排序并相加, 累计流通市值达到A股主板市场(不含中小板)总流通市值三分之二的这部分股票纳入中小盘股票。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票(如新股上市等),如果其流通市值可满足以上标准,也称为中小盘股票。

一般情况下,上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因需要对流通市值进行修正的,本基金将根据市场情况,取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行调整。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于2007年颁布的《证券投资基金会计核算指引》、《信诚中小盘股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于2006 年2 月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正事项。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,自2005年6月13日起,对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

(5)自2005年1月24日起,基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自2007年5月30日起,该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。

(6)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 信诚基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司("建设银行") | 基金托管人 |
| 中信信托有限责任公司 | 基金管理人的中方股东 |
| 英国保诚集团股份有限公司 | 基金管理人的外方股东 |
| 中新苏州工业园区创业投资有限公司 | 基金管理人的中方股东 |
| 信诚人寿保险有限公司 | 基金管理人主要股东控制的机构 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,460,680.66 | 6,023,983.15 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 639,563.76 | 1,540,160.97 |

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 576,780.05 | 1,003,997.08 |

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在本年度及上年度可比期间未投资过本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行,本基金的其它关联方在本年末及上年度末未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 | | 上年度可比期间 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 建设银行 | 9,320,703.92 | 296,559.65 | 46,829,589.38 | 1,877,097.63 |

注:本基金通过"中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2011年12月31日的相关余额为人民币2,161,857.37元。(2010 年12月31日:人民币1,807,916.33元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间,在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2011年12月31日,本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2011年12月31日,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于2011年12月31日,本基金未持有银行间市场因正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于2011年12月31日,本基金未持有交易所市场因正回购交易而作为抵押的债券。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 133,227,755.28 | 80.87 |
| | 其中:股票 | 133,227,755.28 | 80.87 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 11,482,561.29 | 6.97 |
| 6 | 其他各项资产 | 20,035,270.73 | 12.16 |
| 7 | 合计 | 164,745,587.30 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 50,106,690.68 | 30.73 |
| C0 | 食品、饮料 | 5,608,096.50 | 3.44 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 3,273,800.00 | 2.01 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 902,779.74 | 0.55 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,209,250.00 | 1.35 |
| C5 | 电子 | 4,547,713.40 | 2.79 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,681.00 | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 18,208,777.09 | 11.17 |
| C8 | 医药、生物制品 | 15,354,592.95 | 9.42 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 5,022,000.00 | 3.08 |
| E | 建筑业 | 4,927,322.40 | 3.02 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 39,233,099.56 | 24.06 |
| H | 批发和零售贸易 | 5,033,600.00 | 3.09 |
| I | 金融、保险业 | 21,222,792.64 | 13.02 |
| J | 房地产业 | 4,817,950.00 | 2.95 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | 775,000.00 | 0.48 |
| M | 综合类 | 2,089,300.00 | 1.28 |
| | 合计 | 133,227,755.28 | 81.71 |

8.3 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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002065 | 东华软件 | 615,154 | 13,570,297.24 | 8.32 |
| 2 | 002073 | 软控股份 | 630,000 | 9,531,900.00 | 5.85 |
| 3 | 000423 | 东阿阿胶 | 190,000 | 8,160,500.00 | 5.00 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 950,000 | 8,065,500.00 | 4.95 |
| 5 | 600778 | 友好集团 | 520,000 | 5,033,600.00 | 3.09 |
| 6 | 600795 | 国电电力 | 1,800,000 | 5,022,000.00 | 3.08 |
| 7 | 600068 | 葛洲坝 | 639,912 | 4,927,322.40 | 3.02 |
| 8 | 002063 | 远光软件 | 288,227 | 4,888,329.92 | 3.00 |
| 9 | 002115 | 三维通信 | 400,187 | 4,882,281.40 | 2.99 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 410,000 | 4,866,700.00 | 2.98 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 49,046,890.38 | 17.46 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 45,114,631.86 | 16.06 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 44,905,243.75 | 15.99 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 28,876,940.18 | 10.28 |
| 5 | 600015 | 华夏银行 | 26,511,818.83 | 9.44 |
| 6 | 002106 | 莱宝高科 | 25,669,518.80 | 9.14 |
| 7 | 600050 | 中国联通 | 24,567,114.00 | 8.75 |
| 8 | 000001 | 深发展A | 21,455,180.20 | 7.64 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 21,024,847.84 | 7.49 |
| 10 | 600068 | 葛洲坝 | 20,967,181.09 | 7.47 |
| 11 | 600362 | 江西铜业 | 20,948,297.84 | 7.46 |
| 12 | 000423 | 东阿阿胶 | 19,003,782.45 | 6.77 |
| 13 | 600519 | 贵州茅台 | 18,553,144.75 | 6.61 |
| 14 | 002129 | 中环股份 | 17,812,493.29 | 6.34 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 17,714,419.67 | 6.31 |
| 16 | 600970 | 中材国际 | 17,620,811.84 | 6.27 |
| 17 | 600261 | 阳光照明 | 17,421,689.41 | 6.20 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 17,131,557.71 | 6.10 |
| 19 | 600016 | 民生银行 | 16,693,933.95 | 5.94 |
| 20 | 000401 | 冀东水泥 | 16,561,159.13 | 5.90 |
| 21 | 600271 | 航天信息 | 15,946,596.65 | 5.68 |
| 22 | 002073 | 软控股份 | 15,766,484.05 | 5.61 |
| 23 | 002056 | 横店东磁 | 15,342,787.43 | 5.46 |
| 24 | 000002 | 万 科A | 15,340,613.29 | 5.46 |
| 25 | 601169 | 北京银行 | 15,205,908.06 | 5.41 |
| 26 | 000063 | 中兴通讯 | 14,901,485.07 | 5.31 |
| 27 | 600636 | 三爱富 | 14,780,041.40 | 5.26 |
| 28 | 000538 | 云南白药 | 14,560,372.51 | 5.18 |
| 29 | 601168 | 西部矿业 | 14,165,405.07 | 5.04 |
| 30 | 002230 | 科大讯飞 | 13,925,713.49 | 4.96 |
| 31 | 002152 | 广电运通 | 13,921,917.22 | 4.96 |
| 32 | 600089 | 特变电工 | 13,597,726.88 | 4.84 |
| 33 | 601009 | 南京银行 | 13,087,097.37 | 4.66 |
| 34 | 002065 | 东华软件 | 12,940,532.75 | 4.61 |
| 35 | 002038 | 双鹭药业 | 12,804,190.54 | 4.56 |
| 36 | 600570 | 恒生电子 | 12,672,645.41 | 4.51 |
| 37 | 600395 | 盘江股份 | 12,661,770.50 | 4.51 |
| 38 | 600778 | 友好集团 | 12,555,481.75 | 4.47 |
| 39 | 300080 | 新大新材 | 12,017,872.83 | 4.28 |
| 40 | 000877 | 天山股份 | 11,824,843.50 | 4.21 |
| 41 | 601678 | 滨化股份 | 11,595,585.43 | 4.13 |
| 42 | 600309 | 烟台万华 | 11,558,931.80 | 4.12 |
| 43 | 600581 | 八一钢铁 | 11,498,371.74 | 4.09 |
| 44 | 000024 | 招商地产 | 11,424,677.00 | 4.07 |
| 45 | 601006 | 大秦铁路 | 11,421,224.92 | 4.07 |
| 46 | 300022 | 吉峰农机 | 11,418,398.22 | 4.07 |
| 47 | 600880 | 博瑞传播 | 11,285,714.11 | 4.02 |
| 48 | 600498 | 烽火通信 | 11,206,860.65 | 3.99 |
| 49 | 600188 | 兖州煤业 | 11,000,350.57 | 3.92 |
| 50 | 002161 | 远 望 谷 | 10,811,968.60 | 3.85 |
| 51 | 600518 | 康美药业 | 10,767,577.44 | 3.83 |
| 52 | 600079 | 人福医药 | 10,713,476.10 | 3.81 |
| 53 | 000858 | 五 粮 液 | 10,610,381.18 | 3.78 |
| 54 | 002564 | 张化机 | 10,593,563.84 | 3.77 |
| 55 | 600588 | 用友软件 | 10,519,898.15 | 3.75 |
| 56 | 002142 | 宁波银行 | 10,400,963.00 | 3.70 |
| 57 | 600256 | 广汇股份 | 10,358,183.72 | 3.69 |
| 58 | 002081 | 金 螳 螂 | 9,958,913.45 | 3.55 |
| 59 | 600425 | 青松建化 | 9,854,192.16 | 3.51 |
| 60 | 000157 | 中联重科 | 9,647,097.08 | 3.43 |
| 61 | 600123 | 兰花科创 | 9,508,010.05 | 3.39 |
| 62 | 600467 | 好当家 | 9,437,127.44 | 3.36 |
| 63 | 600795 | 国电电力 | 9,262,685.17 | 3.30 |
| 64 | 600143 | 金发科技 | 9,214,848.21 | 3.28 |
| 65 | 000650 | 仁和药业 | 9,191,475.84 | 3.27 |
| 66 | 600536 | 中国软件 | 9,152,428.70 | 3.26 |
| 67 | 600383 | 金地集团 | 9,125,748.00 | 3.25 |
| 68 | 600348 | 阳泉煤业 | 8,878,309.00 | 3.16 |
| 69 | 600718 | 东软集团 | 8,688,631.26 | 3.09 |
| 70 | 600582 | 天地科技 | 8,374,197.18 | 2.98 |
| 71 | 600267 | 海正药业 | 8,186,874.79 | 2.91 |
| 72 | 002565 | 上海绿新 | 8,129,465.60 | 2.89 |
| 73 | 000630 | 铜陵有色 | 8,093,188.86 | 2.88 |
| 74 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,931,656.25 | 2.82 |
| 75 | 002063 | 远光软件 | 7,923,474.28 | 2.82 |
| 76 | 000402 | 金 融 街 | 7,817,756.02 | 2.78 |
| 77 | 002055 | 得润电子 | 7,815,102.06 | 2.78 |
| 78 | 600571 | 信雅达 | 7,800,903.50 | 2.78 |
| 79 | 600808 | 马钢股份 | 7,753,851.35 | 2.76 |
| 80 | 600339 | 天利高新 | 7,631,062.40 | 2.72 |
| 81 | 000578 | 盐湖集团 | 7,534,121.71 | 2.68 |
| 82 | 002091 | 江苏国泰 | 7,515,730.31 | 2.68 |
| 83 | 002236 | 大华股份 | 7,439,426.98 | 2.65 |
| 84 | 300209 | 天泽信息 | 7,421,405.15 | 2.64 |
| 85 | 600416 | 湘电股份 | 7,301,345.20 | 2.60 |
| 86 | 002010 | 传化股份 | 7,271,863.82 | 2.59 |
| 87 | 002414 | 高德红外 | 7,168,806.89 | 2.55 |
| 88 | 002385 | 大北农 | 7,012,889.15 | 2.50 |
| 89 | 600805 | 悦达投资 | 6,947,174.10 | 2.47 |
| 90 | 002007 | 华兰生物 | 6,702,329.45 | 2.39 |
| 91 | 600104 | 上汽集团 | 6,606,195.22 | 2.35 |
| 92 | 600527 | 江南高纤 | 6,543,197.88 | 2.33 |
| 93 | 000969 | 安泰科技 | 6,431,193.62 | 2.29 |
| 94 | 600804 | 鹏博士 | 6,394,863.15 | 2.28 |
| 95 | 600226 | 升华拜克 | 6,264,013.52 | 2.23 |
| 96 | 600376 | 首开股份 | 6,178,123.58 | 2.20 |
| 97 | 601998 | 中信银行 | 6,092,976.47 | 2.17 |
| 98 | 601766 | 中国南车 | 5,969,364.00 | 2.13 |
| 99 | 601299 | 中国北车 | 5,915,515.50 | 2.11 |
| 100 | 600729 | 重庆百货 | 5,863,271.50 | 2.09 |
| 101 | 000792 | 盐湖股份 | 5,756,153.95 | 2.05 |
| 102 | 300025 | 华星创业 | 5,711,409.16 | 2.03 |
| 103 | 002115 | 三维通信 | 5,706,620.78 | 2.03 |
| 104 | 600160 | 巨化股份 | 5,677,971.42 | 2.02 |
| 105 | 000027 | 深圳能源 | 5,640,773.14 | 2.01 |

注:1、买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

2、盐湖集团于2011年3月22日起终止上市。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 44,875,175.19 | 15.98 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 40,287,788.72 | 14.34 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 36,159,313.39 | 12.87 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 33,637,633.92 | 11.98 |
| 5 | 002106 | 莱宝高科 | 29,645,760.12 | 10.56 |
| 6 | 600015 | 华夏银行 | 25,831,604.23 | 9.20 |
| 7 | 600261 | 阳光照明 | 25,263,325.13 | 8.99 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 23,901,308.40 | 8.51 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 23,071,239.25 | 8.21 |
| 10 | 002129 | 中环股份 | 22,070,054.82 | 7.86 |
| 11 | 000001 | 深发展A | 21,151,284.61 | 7.53 |
| 12 | 600256 | 广汇股份 | 20,087,249.12 | 7.15 |
| 13 | 600362 | 江西铜业 | 19,176,856.58 | 6.83 |
| 14 | 600089 | 特变电工 | 18,091,904.89 | 6.44 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 17,603,102.88 | 6.27 |
| 16 | 600636 | 三爱富 | 17,267,392.85 | 6.15 |
| 17 | 600498 | 烽火通信 | 16,537,574.70 | 5.89 |
| 18 | 600016 | 民生银行 | 16,522,839.33 | 5.88 |
| 19 | 000401 | 冀东水泥 | 16,336,892.34 | 5.82 |
| 20 | 600880 | 博瑞传播 | 15,424,523.05 | 5.49 |
| 21 | 600970 | 中材国际 | 15,145,476.97 | 5.39 |
| 22 | 600068 | 葛洲坝 | 15,097,298.83 | 5.38 |
| 23 | 002056 | 横店东磁 | 15,026,750.45 | 5.35 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 14,904,555.18 | 5.31 |
| 25 | 000651 | 格力电器 | 14,764,142.14 | 5.26 |
| 26 | 000002 | 万 科A | 14,631,612.30 | 5.21 |
| 27 | 600519 | 贵州茅台 | 14,292,963.11 | 5.09 |
| 28 | 600271 | 航天信息 | 14,254,823.83 | 5.08 |
| 29 | 000538 | 云南白药 | 14,213,920.35 | 5.06 |
| 30 | 601169 | 北京银行 | 13,801,958.71 | 4.91 |
| 31 | 601168 | 西部矿业 | 13,450,993.75 | 4.79 |
| 32 | 600123 | 兰花科创 | 13,450,657.71 | 4.79 |
| 33 | 002038 | 双鹭药业 | 12,781,185.75 | 4.55 |
| 34 | 600570 | 恒生电子 | 12,494,945.91 | 4.45 |
| 35 | 002152 | 广电运通 | 12,121,742.20 | 4.32 |
| 36 | 600276 | 恒瑞医药 | 12,043,274.61 | 4.29 |
| 37 | 600887 | 伊利股份 | 12,034,648.02 | 4.28 |
| 38 | 600525 | 长园集团 | 11,775,654.06 | 4.19 |
| 39 | 002230 | 科大讯飞 | 11,761,040.22 | 4.19 |
| 40 | 601006 | 大秦铁路 | 11,660,931.36 | 4.15 |
| 41 | 000792 | 盐湖股份 | 11,489,155.25 | 4.09 |
| 42 | 600395 | 盘江股份 | 11,486,365.85 | 4.09 |
| 43 | 600309 | 烟台万华 | 11,376,249.04 | 4.05 |
| 44 | 601678 | 滨化股份 | 11,324,885.76 | 4.03 |
| 45 | 600581 | 八一钢铁 | 11,230,034.98 | 4.00 |
| 46 | 300080 | 新大新材 | 11,171,027.87 | 3.98 |
| 47 | 000024 | 招商地产 | 11,138,982.30 | 3.97 |
| 48 | 002161 | 远 望 谷 | 11,100,389.21 | 3.95 |
| 49 | 600188 | 兖州煤业 | 11,003,121.61 | 3.92 |
| 50 | 600628 | 新世界 | 10,786,545.17 | 3.84 |
| 51 | 600406 | 国电南瑞 | 10,754,605.31 | 3.83 |
| 52 | 601009 | 南京银行 | 10,741,759.24 | 3.82 |
| 53 | 000423 | 东阿阿胶 | 10,208,147.41 | 3.63 |
| 54 | 000858 | 五 粮 液 | 10,081,298.62 | 3.59 |
| 55 | 600079 | 人福医药 | 10,061,058.99 | 3.58 |
| 56 | 000877 | 天山股份 | 9,743,472.22 | 3.47 |
| 57 | 600536 | 中国软件 | 9,692,109.08 | 3.45 |
| 58 | 000157 | 中联重科 | 9,674,489.67 | 3.44 |
| 59 | 600467 | 好当家 | 9,654,425.19 | 3.44 |
| 60 | 002081 | 金 螳 螂 | 8,992,781.21 | 3.20 |
| 61 | 002564 | 张化机 | 8,891,358.15 | 3.17 |
| 62 | 600383 | 金地集团 | 8,877,756.73 | 3.16 |
| 63 | 300022 | 吉峰农机 | 8,826,528.59 | 3.14 |
| 64 | 600718 | 东软集团 | 8,687,764.44 | 3.09 |
| 65 | 002236 | 大华股份 | 8,682,056.32 | 3.09 |
| 66 | 002142 | 宁波银行 | 8,537,383.22 | 3.04 |
| 67 | 600588 | 用友软件 | 8,474,270.60 | 3.02 |
| 68 | 600425 | 青松建化 | 8,393,624.20 | 2.99 |
| 69 | 000009 | 中国宝安 | 8,252,489.83 | 2.94 |
| 70 | 600518 | 康美药业 | 8,088,738.48 | 2.88 |
| 71 | 600348 | 阳泉煤业 | 8,066,857.99 | 2.87 |
| 72 | 600143 | 金发科技 | 8,036,395.22 | 2.86 |
| 73 | 600339 | 天利高新 | 7,992,793.98 | 2.85 |
| 74 | 600571 | 信雅达 | 7,900,365.27 | 2.81 |
| 75 | 002091 | 江苏国泰 | 7,841,140.68 | 2.79 |
| 76 | 002055 | 得润电子 | 7,812,139.86 | 2.78 |
| 77 | 000578 | 盐湖集团 | 7,719,398.91 | 2.75 |
| 78 | 600761 | 安徽合力 | 7,565,805.79 | 2.69 |
| 79 | 002010 | 传化股份 | 7,501,528.26 | 2.67 |
| 80 | 600580 | 卧龙电气 | 7,500,581.35 | 2.67 |
| 81 | 600808 | 马钢股份 | 7,357,966.70 | 2.62 |
| 82 | 002414 | 高德红外 | 7,097,241.03 | 2.53 |
| 83 | 002385 | 大北农 | 7,092,288.03 | 2.53 |
| 84 | 000402 | 金 融 街 | 7,056,396.37 | 2.51 |
| 85 | 002123 | 荣信股份 | 6,967,628.26 | 2.48 |
| 86 | 600582 | 天地科技 | 6,957,488.01 | 2.48 |
| 87 | 002007 | 华兰生物 | 6,927,692.62 | 2.47 |
| 88 | 300209 | 天泽信息 | 6,887,208.90 | 2.45 |
| 89 | 000630 | 铜陵有色 | 6,856,985.42 | 2.44 |
| 90 | 002565 | 上海绿新 | 6,718,783.63 | 2.39 |
| 91 | 600804 | 鹏博士 | 6,650,089.41 | 2.37 |
| 92 | 600226 | 升华拜克 | 6,576,868.68 | 2.34 |
| 93 | 600410 | 华胜天成 | 6,567,322.28 | 2.34 |
| 94 | 002025 | 航天电器 | 6,533,919.96 | 2.33 |
| 95 | 002273 | 水晶光电 | 6,520,888.83 | 2.32 |
| 96 | 000969 | 安泰科技 | 6,340,936.36 | 2.26 |
| 97 | 600267 | 海正药业 | 6,295,880.95 | 2.24 |
| 98 | 600376 | 首开股份 | 6,270,483.66 | 2.23 |
| 99 | 600416 | 湘电股份 | 6,259,013.52 | 2.23 |
| 100 | 600729 | 重庆百货 | 6,196,808.35 | 2.21 |
| 101 | 601766 | 中国南车 | 5,937,177.40 | 2.11 |
| 102 | 000027 | 深圳能源 | 5,936,536.19 | 2.11 |
| 103 | 601299 | 中国北车 | 5,856,605.08 | 2.09 |
| 104 | 000650 | 仁和药业 | 5,745,883.72 | 2.05 |
| 105 | 600741 | 华域汽车 | 5,721,949.66 | 2.04 |
| 106 | 600527 | 江南高纤 | 5,710,570.83 | 2.03 |
| 107 | 600160 | 巨化股份 | 5,689,272.50 | 2.03 |

注:1、卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。2、盐湖集团于2011年3月22日起终止上市。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 1,635,417,085.03 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 1,664,000,152.03 |

注:买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中,没有被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.9.2 本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 75,328.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 19,951,820.05 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,683.04 |
| 5 | 应收申购款 | 4,439.34 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,035,270.73 |

8.9.4 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。

8.9.5 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。

8.9.6 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可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 7,410 | 32,301.04 | 81,163,966.05 | 33.91% | 158,186,727.56 | 66.09% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 239,028.70 | 0.10% |

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2010年2月10日)基金份额总额 | 603,918,903.05 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 287,694,881.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 70,168,718.26 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 118,512,906.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 239,350,693.61 |

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动:

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第十五次会议审议通过,聘任桂思毅先生担任公司副总经理。

本基金管理人已于2011年5月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》。

上述变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2011]115号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知,聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为人民币70,000元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 银河证券 | 1 | 483,876,027.76 | 14.67% | 411,292.82 | 14.94% | - |
| 兴业证券 | 1 | 473,186,823.58 | 14.34% | 384,466.44 | 13.97% | - |
| 广发证券 | 1 | 415,802,976.42 | 12.61% | 353,431.21 | 12.84% | - |
| 山西证券 | 1 | 396,991,063.09 | 12.03% | 337,440.48 | 12.26% | - |
| 中信建投 | 2 | 376,188,272.36 | 11.40% | 305,655.29 | 11.10% | - |
| 信达证券 | 1 | 285,780,905.35 | 8.66% | 232,198.80 | 8.44% | 本期新增 |
| 中金国际 | 1 | 282,315,746.66 | 8.56% | 239,966.30 | 8.72% | - |
| 中投证券 | 2 | 209,850,213.67 | 6.36% | 178,372.48 | 6.48% | - |
| 英大证券 | 1 | 89,137,457.76 | 2.70% | 75,766.99 | 2.75% | - |
| 国联证券 | 1 | 58,251,364.00 | 1.77% | 47,329.64 | 1.72% | 本期新增 |
| 东兴证券 | 1 | 53,837,316.15 | 1.63% | 43,743.06 | 1.59% | 本期新增 |
| 高华证券 | 1 | 53,228,926.99 | 1.61% | 43,248.67 | 1.57% | - |
| 国金证券 | 1 | 39,977,610.11 | 1.21% | 32,481.78 | 1.18% | - |
| 申银万国 | 1 | 37,973,972.08 | 1.15% | 32,277.39 | 1.17% | - |
| 联合证券 | 1 | 28,745,018.67 | 0.87% | 23,355.51 | 0.85% | - |
| 安信证券 | 2 | 13,549,399.07 | 0.41% | 11,516.93 | 0.42% | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 齐鲁证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注:本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估,并综合考虑候选券商的综合实力,由研究总监和投资总监审核批准。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2011年10月28日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告,根据国家金融工作的需要,郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司("本行")董事会("董事会")提出辞呈,请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定,郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012 年1 月16 日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

**信诚基金管理有限公司**
**2012年3月27日**