信诚中证500指数分级证券投资基金

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 重要提示及目录

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2月11日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚中证500指数分级证券投资基金		
基金简称	信诚中证500指数分级		
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	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	506,372,146.58份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的交易所	深圳证券交易所		
上市日期	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	信诚中证500指数分级
下属分级基金的交易代码	150028	150029	165511
报告期末下属分级基金的份额总额	89,524,233.00份	134,286,351.00份	282,561,562.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证500指数的有效跟踪，为投资者提供一个投资中证500指数的有效工具。		
投资策略	本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证500指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。		
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率		
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	信诚中证500指数分级A：低风险、收益相对稳定	信诚中证500指数分级B：高风险、高预期收益	信诚中证500指数分级：本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金

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02月11日至2011年12月31日
本期已实现收益	-40,183,487.57
本期利润	-116,683,398.52
加权平均基金份额本期利润	-0.3203
本期加权平均净值利润率	-35.81%
本期基金份额净值增长率	-30.00%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配利润	-151,837,397.57
期末可供分配基金份额利润	-0.2999
期末基金资产净值	354,534,749.01
期末基金份额净值	0.700
3.1.3 累计期末指标	2011年末
基金份额累计净值增长率	-30.00%

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2011年2月11日起生效，报告期为2011年2月11日至2011年12月31日。

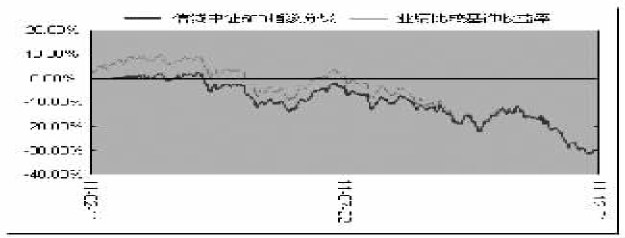
3.2 基金净值表现

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	-14.32%	1.59%	-14.55%	1.62%	0.23%	-0.03%
过去六个月	-23.41%	1.47%	-27.38%	1.52%	3.97%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-30.00%	1.29%	-29.59%	1.41%	-0.41%	-0.12%

注：本基金的业绩比较标准为95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率。

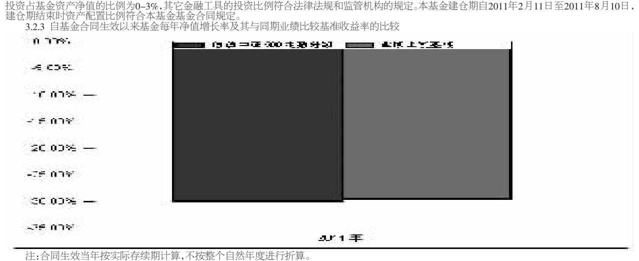
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、基金合同生效起至披露时点不满一年（本基金合同生效日为2011年2月11日）。

2、按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。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。本基金建仓期自2011年2月11日至2011年8月10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

本基金合同自2011年2月11日起生效。截至2011年12月31日，本基金未进行过利润分配。

§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		
吴雅楠	本基金基金经理，信诚基金管理有限公司投资管理部数量分析总监兼信诚沪深300指数分级证券投资基金基金经理	2011年2月11日	-	15	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）。

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年是全球经济和资本市场极为复杂的一年，国内股市以估值泡沫的破裂和“黑天鹅”事件频繁出现，外围以欧洲“享乐主义”的清算和无纪律的财政政策的惩罚而结束。上半年国内政策重点在于抑制上升的通胀态势，央行上半年每月提高一次准备金率并在全年升息三次。下半年欧洲债务危机加深，欧洲“边缘国家”的债务危机已经逐步波及到核心区欧元国家。美国、法国等AAA评级主权债务被接连降级，加剧了市场对发达国家债务偿还和经济复苏的担忧。全球主要央行联合释放流动性，刺激市场信心和经济活力。年末国内工业增加值、CPI和PPI均进入下行通道，PMI在枯荣线附近徘徊。热线外流、公司盈利下滑、新股发行和“黑天鹅”事件促使国内股市下半年大幅震荡。沪深300大盘蓝筹股估值跌入历史底部区域，而估值相对较高的中小盘公司出现了较大的估值修复。中证500指数在年末创下年内最低位，全年指数在第一季度的5232和年末的3128之间宽幅震荡。

信诚中证500指数分级基金于2011年2月11日成立，3月14日封闭期结束，分级基金份额作为第100只乐富上市基金同日在深交所上市交易。本基金作为国内首支应用分层抽样技术复制中证500指数的基金，积极利用信诚数量团队自行开发的量化分层抽样技术应用在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中，有效地管理跟踪误差，并自封闭期结束以来取得了一定的超额收益。

作为首只中证500指数分级基金，本基金为不同风险偏好的投资者提供了三款不同风险收益特征的投资工具，并且分级份额在场内交易。场内交易的活跃度也可以反映投资者的关注与交易特征。由于杠杆工具的稀缺，信诚500B处于连续溢价状态。在市场触底反弹期间，信诚500B的杠杆性也放大了指数反弹的波动性，为投资者提供了波段式投资工具。信诚500A为投资风险偏好较低的投资者提供了每年约定收益的投资工具。在市场的不同阶段，信诚中证500相应地经常出现整体溢价机会，使套利投资者可以利用配对转换机制从中获取套利收益。信诚中证500场内份额全年因此有显著增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年末，本基金自成立以来份额净值增长率为-30.00%，同期比较基准收益率为-29.59%。从封闭期结束至2011年末，本基金日均跟踪偏离0.03%，日跟踪误差为0.17%，年化跟踪误差为2.75%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%及年化跟踪误差在4%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年，市场仍将在不确定环境中寻找确定性趋势和政策方向。欧洲风险仍悬而未决，虽然欧盟达成联合有纪律财政政策协议，但是实际施行效果以及明年一季度到来的欧债到期高峰，仍有可能对欧洲银行及核心区经济实体的债务产生较大影响。国内经济在通货膨胀得到有效控制下，有望透过稳增长的投资拉动和积极财政政策促进消费增长的双重引导，对冲出口的持续下滑，市场将关注经济底部的确立。资金面还期待货币政策在稳健中不断微调，逐步趋于宽松。全球主要政府换届和量化宽松政策推出的时机仍可能成为2012年市场不确定性因素。国内股市有望在估值于2011年得到大幅调整之后，将确立市场底部，在经济回暖和资金面相对宽松的预期中，迎来回暖的春天。本基金经理将继续秉承严谨和有纪律的信诚数量投资策略和执行，管理信诚中证500指数基金，为投资者提供有效的指数回报。

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

根据基金合同的约定，本基金（包括信诚中证500指数分级、信诚中证500指数分级A、信诚中证500指数分级B）不进行收益分配。

本基金于本期间未进行过利润分配，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：信诚中证500指数分级证券投资基金

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
资 产：	
银行存款	121,529.29
结算备付金	1,671,917.18
存出保证金	79,062.22
交易性金融资产	354,159,755.44
其中：股票投资	331,905,280.10
基金投资	-
债券投资	22,254,475.34
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	4,377,995.90
应收利息	379,703.34
应收股利	-
应收申购款	12,850.53
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	360,802,813.90
负债和所有者权益	本期末 2011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	4,819,796.21
应付管理人报酬	315,143.84
应付托管费	69,331.63
应付销售服务费	-
应付交易费用	695,028.19
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	368,765.02
负债合计	6,268,064.89
所有者权益：	
实收基金	506,372,146.58
未分配利润	-151,837,397.57
所有者权益合计	354,534,749.01
负债和所有者权益总计	360,802,813.90

注：1.本基金合同自2011年2月11日起生效，报告期为2011年2月11日至2011年12月31日止。报告截止日2011年12月31日，基金份额总额506,372,146.58份。信诚中证500指数分级的基金份额净值0.700元，基金份额总额282,561,562.58份。下属两级基金：信诚中证500指数分级A的基金份额净值1.055元，基金份额总额89,524,233.00份；信诚中证500指数分级B的基金份额净值0.463元，基金份额总额134,286,351.00份。

2. 无上年度可比期间，下同。

7.2利润表

会计主体：信诚中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2011年2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入	-109,716,941.82
1.利息收入	927,391.01
其中：存款利息收入	125,265.27
债券利息收入	348,805.71
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	453,320.03
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-34,545,098.79
其中：股票投资收益	-36,255,777.78
基金投资收益	-
债券投资收益	143,055.91
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,567,623.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-76,499,910.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	400,676.91
减：二、费用	6,966,456.70
1.管理人报酬	2,877,121.28
2.托管费	632,966.68
3.销售服务费	-
4.交易费用	2,780,235.11
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	676,133.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-116,683,398.52
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-116,683,398.52

注：本基金合同自2011年2月11日起生效，报告期为2011年2月11日至2011年12月31日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2011年2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年2月11日（基金合同生效日）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）	374,254,300.10	-	374,254,300.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-116,683,398.52	-116,683,398.52
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）	132,117,846.48	-35,153,999.05	96,963,847.43
其中：1.基金申购款	465,351,162.13	-54,098,122.88	411,253,039.25
2.基金赎回款	-333,233,315.65	18,944,123.83	-314,289,191.82
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）	506,372,146.58	-151,837,397.57	354,534,749.01

注：本基金合同自2011年2月11日起生效，报告期为2011年2月11日至2011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　　詹明

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

信诚中证500指数分级证券投资基金（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”）《关于核准信诚中证500指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许[2010]1877 号文）和《关于信诚中证500指数分级证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2011]69 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《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2011年2月11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2011年1月6日至2011年1月28日募集，首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币374,118,554.71元，利息人民币135,745.39元，共计人民币374,254,300.10元。上述认购资金折合374,254,300.10份基金份额。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（2011）CR No.0003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、《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证500指数分级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。

本基金的业绩比较标准为95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率

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业务指引》、《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

(a)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i)股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/（损失）。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii)债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

认购新发行的分离交易可转债于配日按支付的全部价款确认为债券投资，于权证实际取得日按附注6.4.4.4（a）(iii)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于卖出交易日确认债券投资收益/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii)权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证（包括配股权证）在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/（损失）。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b)应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

(c)其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

(a)股票投资

(i)对因特殊事项长期停牌的股票，如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii)送股、转增股、配股和公开增发新股等未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

(iii)首次公开发行未上市的股票，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。

(iv)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收盘价估值。

(v)非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同一股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b)债券投资

(i)交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价估值，交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的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。

(ii)首次公开发行未上市的债券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。

(iii)全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(iv)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。

(c)权证投资

(i)首次公开发行未上市的权证，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。

(ii)配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

(iii)因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

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。

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。

实际成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

2011年，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

2011年，本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵消债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵消后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入“未分配利润”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/（损失）于卖出债券交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/（损失）于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》的规定，按前一日基金资产净值1.0%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》的规定，按前一日基金资产净值0.22%的年费率逐日计提。

本基金的标的指数许可使用费根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》的规定，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提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金（包括信诚中证500指数分级、信诚中证500指数分级A、信诚中证500指数分级B）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指数分级A份额与信诚中证500指数分级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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

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》、财税字[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，对受让方不再征税。

(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

本基金在本年度末通过关联方交易单元进行交易。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

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2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,877,121.28
其中：支付销售机构的客户维护费	605,153.37

注：1、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1.0%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×1.0%/当年天数。

2、本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	632,966.68

注：1、支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%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×0.22%/当年天数。

2、本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

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

本基金在本年度末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

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

本基金的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末投资过本基金。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

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

信诚中证500指数分级

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信诚人寿保险有限公司	20,004,600.00	7.08%

1.以上除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的份额均为本基金的基础份额及其所占基础份额的比例。

2.除上表所示外，本基金其它关联方在本年末未持有本基金。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年末可比数。

3.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。

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2月11日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	121,529.29	87,732.51

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1,671,917.18元。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度末在承销期内购入过由关联方承销的证券。本基金合同自2011年2月11日起生效，无上年度可比期间。

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，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600056	中国医药	2011-11-16	重大资产重组事项	20.24	-	-	52,237	1,214,586.53	1,057,276.88	-
600121	郑州煤电	2011-10-10	重大资产重组事项	10.43	2012-01-13	11.47	39,341	379,216.91	410,326.63	-
600820	隧道股份	2011-12-27	重大资产重组事项	7.87	2012-01-04	8.15	258,800	2,284,940.68	2,036,756.00	-
600991	广汽长丰	2011-12-28	换股吸收合并本公司相关事宜	14.72	2012-01-04	15.11	140,869	2,157,631.70	2,073,591.68	-
000005	世纪星源	2011-04-30	债务重组	3.86	-	-	195,253	811,526.30	753,676.58	-
000655	金岭矿业	2011-12-12	重大事项	14.80	2012-02-07	16.28	141,503	2,316,930.37	2,094,244.40	-
000677	ST海龙	2011-08-22	股东解除托管协议	4.82	-	-	90,084	545,309.61	434,204.88	-

注：1、截至本报告批准报出日，“中国医药”、“世纪星源”和“ST海龙”仍未发布复牌公告。

2、根据《关于广汽长丰汽车股份有限公司股票终止上市的决定》（上证公字[2012]13号），广汽长丰汽车股份有限公司（以下简称“广汽长丰”）A股股票自2012年3月20日起终止上市交易。根据广汽长丰与广州汽车集团股份有限公司（以下简称“广汽集团”）签署的《广州汽车集团股份有限公司与广汽长丰汽车股份有限公司换股吸收合并协议》及《关于@广? 汽车集团股份有限公司与广汽长丰汽车股份有限公司换股吸收合并协议@的? 充协议》，广汽集团吸收合并广汽长丰。在相关手续完成之后，广汽长丰股东持有的广汽长丰股票将按照1:1.6的比例自动转换为广汽集团A股股票。

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	331,905,280.10	91.99
	其中：股票	331,905,280.10	91.99
2	固定收益投资	22,254,475.34	6.17
	其中：债券	22,254,475.34	6.17
	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	1,793,446.47	0.50
6	其他各项资产	4,849,611.99	1.34
7	合计	360,802,813.90	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合8.2.1 指数投资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	4,284,473.56	1.21
B	采掘业	8,003,629.27	2.26
C	制造业	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、化学、塑胶、塑料	35,348,926.55	9.97
C5	电子	26,507,439.78	7.48
C6	金属、非金属	24,253,609.58	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、煤气及水的生产和供应业	15,571,025.54	4.39
E	建筑业	12,076,791.41	3.41
F	交通运输、仓储业	13,375,168.36	3.77
G	信息技术业	24,194,025.82	6.82
H	批发和零售贸易	23,688,055.47	6.68
I	金融、保险业	2,937,164.30	0.83
J	房地产业	21,889,433.10	6.17
K	社会服务业	8,397,420.86	2.37
L	传播与文化产业	2,161,933.11	0.61
M	综合类	6,504,095.99	1.83
	合计	331,905,280.10	93.62

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600569	安阳钢铁	946,235	2,526,447.45	0.71
2	000488	晨鸣纸业	526,765	2,465,260.20	0.70
3	600835	上海机电	279,671	2,217,791.03	0.63
4	600570	恒生电子	180,600	2,210,544.00	0.62
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	江中药业	75,136	2,178,944.00	0.61
8	600616	金枫酒业	232,100	2,174,777.00	0.61
9	000917	电广传媒	85,149	2,161,933.11	0.61
10	002342	巨力索具	386,349	2,155,827.42	0.61

注：1、因中国交建换股吸收合并路桥建设，路桥建设于2012年3月1日终止上市交易。

2、因广汽集团换股吸收合并广汽长丰，广汽长丰于2012年3月20日终止上市交易。

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002232	启明信息	9,723,921.03	2.74
2	000712	锦龙股份	8,208,345.59	2.32
3	000503	海虹控股	7,831,769.58	2.21
4	600061	中纺投资	7,769,262.10	2.19
5	000042	深 长 城	7,592,230.78	2.14
6	600263	路桥建设	6,520,318.84	1.84
7	002172	澳洋科技	6,338,330.34	1.79
8	600623	双钱股份	6,325,115.28	1.78
9	600846	同济科技	6,323,058.66	1.78
10	000655	金岭矿业	6,235,680.18	1.76
11	000488	晨鸣纸业	6,195,742.37	1.75
12	600667	太极实业	6,164,271.72	1.74
13	000407	胜利股份	6,045,083.31	1.71
14	600888	新疆众和	6,007,160.96	1.69
15	600139	西部资源	5,923,275.27	1.67
16	600491	龙元建设	5,903,094.24	1.67
17	000837	秦川发展	5,897,452.95	1.66
18	000751	锌业股份	5,748,650.14	1.62
19	600545	新疆城建	5,704,946.97	1.61
20	600991	广汽长丰	5,602,554.89	1.58

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、因中国交建换股吸收合并路桥建设，路桥建设于2012年3月1日终止上市交易。

3、因广汽集团换股吸收合并广汽长丰，广汽长丰于2012年3月20日终止上市交易。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002232	启明信息	8,199,751.43	2.31
2	600846	同济科技	6,479,187.90	1.83
3	000848	承德露露	6,029,444.04	1.70
4	000042	深 长 城	5,948,139.09	1.68
5	002181	粤 传 媒	5,851,222.80	1.65
6	000712	锦龙股份	5,793,420.80	1.63
7	600491	龙元建设	5,792,206.35	1.63
8	000503	海虹控股	5,733,760.86	1.62
9	600825	新华传媒	5,692,001.94	1.61
10	600623	双钱股份	5,648,373.32	1.59
11	600543	莫高股份	5,434,432.83	1.53
12	600059	古越龙山	5,184,391.64	1.46
13	600061	中纺投资	5,104,451.27	1.44
14	000028	国药一致	5,016,264.16	1.41
15	600654	飞乐股份	4,909,801.79	1.38
16	002123	荣信股份	4,833,459.14	1.36
17	600487	亨通光电	4,596,765.84	1.30
18	600138	中青旅	4,523,568.75	1.28
19	600197	伊力特	4,429,221.54	1.25
20	000066	长城电脑	4,366,641.88	1.23

注：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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,203,370,906.15
卖出股票收入（成交）总额	758,635,503.54

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,801,155.00	5.87
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	中期票据	-	-
7	可转债	1,453,320.34	0.41
8	其他	-	-
9	合计	22,254,475.34	6.28

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010203	02国债(3)	207,700	20,801,155.00	5.87
2	110015	石化转债	9,750	979,972.50	0.28
3	125887	中鼎转债	4,480	473,347.84	0.13
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出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	79,062.22
2	应收证券清算款	4,377,995.90
3	应收股利	-
4	应收利息	379,703.34
5	应收申购款	12,850.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,849,611.99

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	979,972.50	0.28
2	125887	中鼎转债	473,347.84	0.13

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资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情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

份额级别	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
信诚中证500指数分级A	928	96,470.08	12,614,353.00	14.09%	76,909,880.00	85.91%
信诚中证500指数分级B	2,274	59,052.92	33,574,038.00	25.00%	100,712,313.00	75.00%
信诚中证500指数分级	5,131	55,069.49	118,064,339.14	41.78%	164,497,223.44	58.22%
合计	8,333	60,767.09	164,252,730.14	32.44%	342,119,416.44	67.56%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证500指数分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘辉	6,836,512.00	7.64%
2	中国银河证券股份有限公司	6,681,092.00	7.46%
3	杜月兰	6,031,792.00	6.74%
4	张宝华	4,596,188.00	5.13%
5	孙建明	2,530,000.00	2.83%
6	王磊	2,465,167.00	2.75%
7	太平人寿保险有限公司	2,256,840.00	2.52%
8	夏雪	1,981,515.00	2.21%
9	董长珠	1,638,571.00	1.83%
10	全华	1,463,866.00	1.64%

信诚中证500指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	太平人寿保险有限公司	12,002,760.00	8.94%
2	太平人寿保险有限公司-投连-银保	11,199,897.00	8.34%
3	丁碧霞	5,635,629.00	4.20%
4	华泰财产保险股份有限公司	3,914,000.00	2.91%
5	廉国华	3,258,200.00	2.43%
6	万和证券有限责任公司	2,470,000.00	1.84%
7	中融国际信托有限公司-中融-以太资金信托合同	1,400,000.00	1.04%
8	董言	1,166,100.00	0.87%
9	叶海龙	1,024,206.00	0.76%
10	傅伟	1,010,621.00	0.75%

注：持有人为场内持有人；对于同一机构不同股东账号下的份额未做合并。

9.3 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	份额级别	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	信诚中证500指数分级A	-	-
	信诚中证500指数分级B	-	-
	信诚中证500指数分级	339,025.07	0.12%
	合计	339,025.07	0.07%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚中证500指数分级A	信诚中证500指数分级B	信诚中证500指数分级
基金合同生效日（2011年2月11日）基金份额总额	10,134,545.00	15,201,819.00	348,917,936.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	465,351,162.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	333,233,315.65
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	79,389,688.00	119,084,532.00	-198,474,220.00
本报告期期末基金份额总额	89,524,233.00	134,286,351.00	282,561,562.58

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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100,000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	
高华证券	1	518,700,948.28	26.44%	421,449.82	25.81%	本期新增
信达证券	1	265,678,281.31	13.54%	215,865.96	13.22%	本期新增
民生证券	1	255,825,496.70	13.04%	217,450.55	13.32%	本期新增
齐鲁证券	1	238,809,676.73	12.17%	202,987.95	12.43%	本期新增
中航证券	1	236,814,794.53	12.07%	201,293.49	12.33%	本期新增
中信建投	2	161,512,674.67	8.23%	137,286.85	8.41%	本期新增
联合证券	1	138,336,484.48	7.05%	112,400.15	6.88%	本期新增
中投证券	1	74,296,378.75	3.79%	63,151.27	3.87%	本期新增
英大证券	1	56,354,322.48	2.87%	47,901.33	2.93%	本期新增
安信证券	2	15,677,351.76	0.80%	13,325.45	0.82%	本期新增
渤海证券	1	-	-	-	-	本期新增
长江证券	1	-	-	-	-	本期新增
东兴证券	1	-	-	-	-	本期新增
广发证券	1	-	-	-	-	本期新增
国金证券	1	-	-	-	-	本期新增
国联证券	1	-	-	-	-	本期新增
国泰君安	1	-	-	-	-	本期新增
国信证券	1	-	-	-	-	本期新增
海通证券	1	-	-	-	-	本期新增
宏源证券	1	-	-	-	-	本期新增
华宝证券	1	-	-	-	-	本期新增
华融证券	1	-	-	-	-	本期新增
招商证券	1	-	-	-	-	本期新增
兴业证券	1	-	-	-	-	本期新增
中金公司	1	-	-	-	-	本期新增
山西证券	1	-	-	-	-	本期新增
申银万国	1	-	-	-	-	本期新增
中银国际	1	-	-	-	-	本期新增

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
高华证券	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-
民生证券	5,917,560.00	8.52%	-	-
齐鲁证券	19,843,921.80	28.58%	-	-
中航证券	-	-	-	-
中信建投	29,449,119.40	42.42%	2,949,100,000.00	100.00%
联合证券	261,200.08	0.38%	-	-
中投证券	-	-	-	-
英大证券	12,902,470.00	18.59%	-	-
安信证券	1,046,787.00	1.51%	-	-
渤海证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-

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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于信诚中证500指数分级证券投资基金增加华夏银行和交通银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.citicprufunds.com.cn）	2011-01-06
2	信诚中证500指数分级证券投资基金上网发售提示性公告	同上	2011-01-06
3	关于信诚中证500基金增加银河证券、中国银行及招商银行为代销机构的公告	同上	2011-01-07
4	关于信诚中证500指数分级证券投资基金增加中信万通及中信金通为代销机构的公告	同上	2011-01-10
5	关于信诚中证500指数分级证券投资基金增加天相投资顾问有限公司及宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	同上	2011-01-11
6	关于信诚中证500指数分级证券投资基金增加中信证券、农业银行及申银万国证券为代销机构的公告	同上	2011-01-13
7	信诚中证500指数分级基金合同生效公告	同上	2011-02-12
8	关于信诚中证500指数基金投资者办理跨系统转登记和份额配对转换业务的公告	同上	2011-03-05
9	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	同上	2011-03-09
10	信诚中证500基金关于参加部分代销机构网上银行、电话银行、基金定期定额申购费率优惠活动的公告	同上	2011-03-11
11	信诚中证500指数分级证券投资基金之A份额与B份额上市交易提示性公告	同上	2011-03-14
12	关于旗下信诚中证500指数基金开通部分代销机构定期定额投资业务的公告	同上	2011-03-14
13	关于旗下信诚中证500指数分级基金在农业银行开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-03-16
14	关于信诚中证500指数分级证券投资基金参加部分代销机构申购费率优惠活动的公告	同上	2011-03-16
15	信诚中证500指数分级证券投资基金增加国泰君安证券为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-03-21
16	信诚基金管理有限公司关于旗下基金增加信达证券为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-03-25
17	开通汇付天下网上直销支付业务的公告	同上	2011-03-29
18	关于信诚中证500指数分级证券投资基金增加份额配对转换办理机构的公告	同上	2011-04-23
19	关于增加旗下基金在中信证券开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-05-20
20	信诚基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	同上	2011-05-25
21	旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	同上	2011-06-28
22	关于旗下部分基金参加中信银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	同上	2011-06-29
23	关于旗下部分基金增加平安证券为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-07-13
24	信诚基金管理有限公司关于旗下基金增加华泰证券为代销机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	同上	2011-10-20
25	信诚基金管理有限公司关于增加旗下部分基金在中信万通开通定期定额投资及转换业务的公告	同上	2011-11-30
26	信诚基金管理有限公司关于旗下基金继续参加华夏银行网银和定投申购费率优惠活动的公告	同上	2011-12-31

§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