

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

信诚货币市场证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

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法律责任。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金主要指标. Includes details like 基金名称, 基金代码, 基金管理人, etc.

2.2 基金产品说明
本基金在严格控制风险和维持资产流动性的基础上,力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

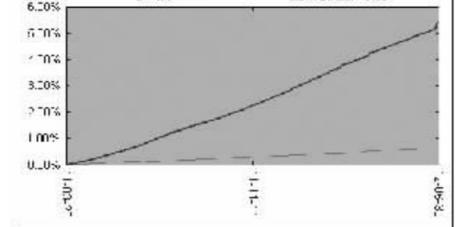
Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists names and contact information for the fund manager and custodian.

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 基金名称, 基金业绩. Shows performance metrics for 信诚货币A and 信诚货币B.

3.2 基金净值表现

Table with 4 columns: 阶段, 信诚货币A, 信诚货币B, 业绩比较基准. Shows performance comparison over various periods.



注:本基金建仓期自2011年3月23日至2011年9月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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情况
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2亿元人民币。

4.2 基金经理

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 在本基金上的任职期限, 证券从业年限. Lists the fund manager and their background.

4.3 公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》,以及公司制定的《信诚基金公平交易管理制度》。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况

2012年上半年,我国经济运行呈现稳中求进态势,通胀下行,投资、出口、消费、用电量、工业增加值等各项经济指标呈现国内经济下行的态势在加大,1-5月城镇固定资产投资累计同比增长20.1%,新订单和购进价格同时下降。

4.5 投资组合报告

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows portfolio details like 债券投资, 资产支持证券, etc.

4.6 投资组合报告附注

4.6.1 本基金投资的前十名证券名称
4.6.2 基金投资的前十名股票名称
4.6.3 基金投资的前十名权证名称

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.0016号验资报告。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规,《信诚货币市场证券投资基金基金合同》和《信诚货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的托管人为依法设立并持有托管资格的金融机构,具体如下:

1. 基金估值程序
为了公平估值,基金管理人提供较好的证券投资基金管理服务,基金管理人估值定价过程进行了最严格的控制。

2. 基金管理人估值人员的从业资格和相关专业工作经历
本基金管理人的估值人员均拥有相关专业学历,具有会计上岗证和基金从业人员资格。

3. 基金管理人估值人员的估值方法
本基金管理人的估值方法符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值方法符合公允价值原则。

4. 基金管理人估值人员的估值程序
本基金管理人的估值程序符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值程序符合公允价值原则。

5. 基金管理人估值人员的估值风险控制
本基金管理人的估值风险控制措施符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值风险控制措施符合公允价值原则。

6. 基金管理人估值人员的估值信息披露
本基金管理人的估值信息披露符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值信息披露符合公允价值原则。

7. 基金管理人估值人员的估值审计
本基金管理人的估值审计符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值审计符合公允价值原则。

8. 基金管理人估值人员的估值复核
本基金管理人的估值复核符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值复核符合公允价值原则。

9. 基金管理人估值人员的估值争议解决
本基金管理人的估值争议解决符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值争议解决符合公允价值原则。

10. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

11. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

12. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

13. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

14. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

15. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

16. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

17. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

18. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

19. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

20. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

21. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

22. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

23. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

24. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

25. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

26. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

27. 基金管理人估值人员的估值其他事项
本基金管理人的估值其他事项符合中国证监会和基金业协会的相关规定,估值其他事项符合公允价值原则。

期限债券的利率风险

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例, 各期限负债占基金资产净值比例. Shows interest rate risk exposure.

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值比例. Shows bond portfolio breakdown.

7.5 期末按行业分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 摊余成本, 占基金资产净值比例. Shows industry portfolio breakdown.

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值偏离度

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况. Shows deviation metrics.

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 摊余成本, 占基金资产净值比例. Shows asset-backed securities portfolio.

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金计价方法说明
7.8.2 本基金估值方法说明

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券名称
7.9.2 基金投资的前十名股票名称

8.1 期末基金持有人户数及持有结构

Table with 4 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者. Shows holder structure.

8.2 本基金基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 4 columns: 项目, 信诚货币A, 信诚货币B, 合计. Shows manager holdings.

8.3 期末基金持有人户数及持有结构

Table with 4 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者. Shows holder structure.

8.4 基金管理人及基金经理情况

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 在本基金上的任职期限, 证券从业年限. Lists the fund manager and their background.

8.5 公平交易制度的执行情况

8.5.1 公平交易制度的执行情况
8.5.2 公平交易制度的执行情况

8.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况

2012年上半年,我国经济运行呈现稳中求进态势,通胀下行,投资、出口、消费、用电量、工业增加值等各项经济指标呈现国内经济下行的态势在加大,1-5月城镇固定资产投资累计同比增长20.1%,新订单和购进价格同时下降。

8.7 投资组合报告

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows portfolio details like 债券投资, 资产支持证券, etc.

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金投资的前十名证券名称
8.8.2 基金投资的前十名股票名称
8.8.3 基金投资的前十名权证名称