信诚沪深300指数分级证券投资基金

2013 半年度报告摘要

2013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
送出日期:2013年8月28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。本半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2013年8月16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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)		
基金主代码	165515		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年2月1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	224,197,769.59份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年2月17日		
下属分级基金的基金简称	信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A)	信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)	信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)
下属分级基金的交易代码	150051	150052	165515
报告期末下属分级基金的份额总额	87,514,218.00份	87,514,219.00份	49,169,332.59份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过对沪深300指数的跟踪复制,为投资人提供一个投资沪深300指数的有效工具。		
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪指数,即按照沪深300指数中成份股组成及在权重构建股票投资组合,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%。 基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。		
业绩比较基准	95%×沪深300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。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚沪深300 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;信诚沪深300 B份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	信诚沪深300指数分级A份额具有低风险、收益相对稳定的特征	信诚沪深300指数分级B份额具有高风险、高预期收益的特征	信诚沪深300指数分级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	田青
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	tianqing1.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

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	20,287,245.91
本期利润	-23,299,875.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1176
本期基金份额净值增长率	-12.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1376
期末基金资产净值	186,378,428.53
期末基金份额净值	0.831

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。

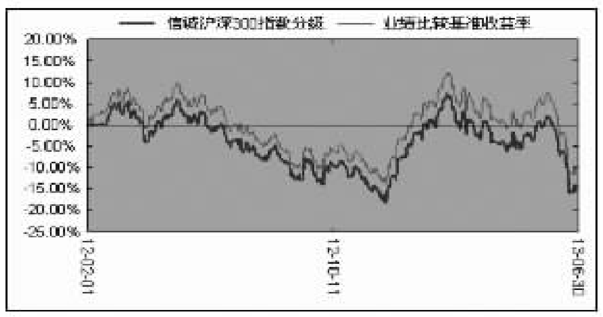
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	-14.59%	1.88%	-14.83%	1.77%	0.24%	0.11%
过去三个月	-10.65%	1.45%	-11.21%	1.38%	0.56%	0.07%
过去六个月	-12.20%	1.45%	-12.11%	1.42%	-0.09%	0.03%
过去一年	-10.92%	1.32%	-9.97%	1.30%	-0.95%	0.02%
自基金合同生效起至今	-14.22%	1.24%	-10.02%	1.24%	-4.20%	0.00%

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2012年2月1日至2012年8月1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 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2013年6月30日,本基金管理人共管理21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)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚双盈分级债券型证券投资基金、信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)、信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金和信诚新双盈分级债券型证券投资基金。

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,信诚中证500指数分级基金基金经理,信诚基金管理有限公司投资管理部数量分析总监	2012年2月1日	-	17	统计物理学博士,CFA,17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)。现任公司投资管理部数量分析总监兼信诚中证500指数分级基金与信诚沪深300指数分级基金的基金经理。

注:1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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

在本报告期内,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《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度v1.2》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

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

2013年上半年,海内外资本市场面临同样主题:流动性收紧和去杠杆。进入新年,国内A股在宏观数据继续回暖和新政府改革预期的带动下,延续了去年末的上扬行情。工业企业利润年初维持较高增长,央行启动SLO来调节市场流动性。然而随后,宏观经济复苏却凸显出持续疲态。进出口出现双双环比下滑,印证内外终端需求仍非常疲软。汇丰PMI连续下行,创9个月新低,连续两月处于荣枯线以下。官方PMI也在荣枯线附近,达多月新低。在QE退出大背景下,新增外汇占款也大幅下降。与此同时,中国央行在二季度末加大了整顿"影子银行"和金融系统去杠杆的力度,在"优化配置、用好增量和盘活存量"的指引下,从一定程度上对金融系统进行了压力测试,造成6月末资金严重紧张,促发Shibor急剧攀升,银行间7天质押回购利率创10年最高水平,超过2008年金融危机时期。流动性紧缩以及即将到期银行理财产品,导致短期"钱荒",甚至出现机构大规模赎回货币基金的"挤兑"现象。被冠以"克强经济学"的新政府经济政策被市场解读为,短期以整顿金融系统和经济结构为主要任务,对过去多年经济中的高杠杆和泡沫现象将严厉整顿,减少资金空转,而对经济增长速度下滑则抱有较大容忍度。

在海外,年初欧洲风险仍不断放大,避险情绪升高,美元指数持续攀升,突破84。另一方面,美国经济则复苏势头强劲,房地产市场持续回暖,就业数据大幅超预期,使QE退出预期不断增加。伯南克表明美联储将在下半年开始逐步减小QE规模,今年底或明年初逐步退出QE,进一步加剧了全球市场资金回流和去杠杆,美国10年债券利率飙升突破2.5%,自去年年中以来上升了近100bps。美国股市则连创历史新高。

二季度末的流动性收紧引发金融系统的"钱荒"导致国内资本市场的股债双熊。上证综指再次进入"1"时代,跌破1900点,日间达1849.65。央行虽然随后在6月25日发表将继续维护流动性的报告,市场开始从恐慌情绪中恢复并反弹。上半年A股出现明显"28分化",大盘蓝筹领跌,创业板一枝独秀,连续上扬,涨幅达41.72%。本期沪深300指数下跌12.78%,中证500指数下跌1.22%。

在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化复制技术,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。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。在本报告期内,基金利用股指期货作为工具进行套保,以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差,及应付大额申购赎回,期末现货与股指期货合约总市值相对基金净值占比符合法规与风控要求。

作为首只应用股指期货的沪深300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对市场走势的交易特征。在本报告期内,分级基金整体在年初市场上扬行情以及在6月末市场恐慌下跌行情期间,杠杆份额溢价率持续攀升,带动分级基金整体溢价。另一方面,在本报告期内,永续型分级基金的稳健份额出现价值重估,在去年经历下拆不定期折算之后,市场对永续型稳健份额在下跌市场中的看跌期权价值和有效久期有了新的认识,从而推动永续型稳健份额的价值重新定价,在经历了年初的分红行情之后,其折价率大幅缩窄,甚至有个别永续型稳健份额出现溢价。在本报告期内,信诚300于3月6日公告,举行持有人大会,提出相关条款修改动议。持有人大会于4月8日投票结束后,在统计投票及报请监管机构审核期间,信诚300场内份额自4月9日起连续停牌,于5月28日复牌。相关动议获持有人大会表决通过。复牌后,受投资者关注较高,场内交易较前有所活跃。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-12.20%,同期比较基准收益率为-12.11%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.3%之内,年化跟踪误差为2.3%。

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2013年下半年,市场还将观察政府对经济增速下滑的容忍度以及相应配套刺激政策是否出台,密切关注"十八届三中全会"前后释放的经济改革政策信号。货币政策将有望在稳增长的前提下维持稳健格局和提供市场流动性。但是需要关注在加大去杠杆力度和金融系统整顿中导致的信用风险。经济能否在转型中避免硬着陆也将考验新政府改革决心和经济政策方向。股市将在震荡寻底的过程中等候实体经济企稳复苏信号,重新积聚上扬动能。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,管理信诚沪深300指数分级基金,为投资者提供有效的指数回报。

4.6 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。

4.7 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(包括信诚沪深300份额、信诚沪深300A份额、信诚沪深300B份额)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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		2,808,701.25	1,799,218.13
结算备付金		1,566,935.83	3,839,933.39
存出保证金		1,137,907.77	403,974.18
交易性金融资产		181,158,346.73	353,764,104.64
其中:股票投资		174,623,317.73	334,746,808.64
基金投资		-	-
债券投资		6,535,029.00	19,017,296.00
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		-	940,771.83
应收利息		144,205.88	247,628.98
应收股利		521,846.26	-
应收申购款		2,582.37	14,835.33
递延所得税资产			
其他资产		-	-
资产总计		187,340,526.09	361,010,466.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		819.27	1,488,790.78
应付赎回款		49,503.85	16,423,067.03
应付管理人报酬		172,737.65	182,581.82
应付托管费		38,002.30	40,167.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		299,104.24	657,283.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		401,930.25	410,408.91
负债合计		962,097.56	19,202,299.94
所有者权益:			
实收基金		217,231,738.08	349,816,970.11
未分配利润		-30,853,309.55	-8,008,803.57
所有者权益合计		186,378,428.53	341,808,166.54
负债和所有者权益总计		187,340,526.09	361,010,466.48

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额224,197,769.59份。信诚沪深300指数分级份额净值0.831元,基金份额总额49,169,332.59份。下属两级基金:信诚300A的基金份额净值1.025元,基金份额总额87,514,218.00份;信诚300B的基金份额净值0.637元,基金份额总额87,514,219.00份。

6.2 利润表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月1日(基金合同生效日)至2012年6月30日
一、收入		-20,044,239.24	-2,906,104.06
1.利息收入		121,912.80	605,301.44
其中:存款利息收入		53,511.75	50,030.05
债券利息收入		68,401.05	90,277.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	464,993.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		22,911,776.66	5,906,042.63
其中:股票投资收益		20,846,103.17	3,848,821.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,984.60	-9,340.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-100,748.57	-51,600.00
股利收益		2,168,406.66	2,118,161.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-43,587,120.91	-9,871,818.59
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		509,192.21	454,370.46
减:二、费用		3,255,635.76	2,788,866.88
1.管理人报酬		955,134.67	981,577.81
2.托管费		210,129.62	215,947.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,707,125.83	1,290,290.04
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		383,245.64	301,051.86
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-23,299,875.00	-5,694,970.94
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-23,299,875.00	-5,694,970.94

注:本基金合同生效日为2012年2月1日,上年度比较期间为2012年2月1日起至6月30日止。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30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)	349,816,970.11	-8,008,803.57	341,808,166.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,299,875.00	-23,299,875.00
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)	-132,585,232.03	455,369.02	-132,129,863.01
其中:1.基金申购款	277,535,535.83	1,358,717.10	278,894,252.93
2.基金赎回款	-410,120,767.86	-903,348.08	-411,024,115.94
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)	217,231,738.08	-30,853,309.55	186,378,428.53
项目	上年度可比期间 2012年2月1日(基金合同生效日)至2012年6月30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)	390,308,688.61	-	390,308,688.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,694,970.94	-5,694,970.94
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)	-193,676,272.06	-1,575,394.68	-195,251,666.74
其中:1.基金申购款	157,744,167.03	3,642,325.07	161,386,492.10
2.基金赎回款	-351,420,439.09	-5,217,719.75	-356,638,158.84
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)	196,632,416.55	-7,270,365.62	189,362,050.93

注:本基金合同生效日为2012年2月1日,上年度比较期间为2012年2月1日起至6月30日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4财务报表由下列负责人签署:

王俊锋	陈逸辛	时慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚沪深300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")《关于核准信诚沪深300指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许[2011]1472 号文)和《关于信诚沪深300指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2012] 42 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《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年2月1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12月21日至2012年1月18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390,145,245.77元,利息人民币163,442.84元,共计人民币390,308,688.61元。上述认购资金折合390,308,688.61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(2012)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、《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,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%×沪深300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。

6.4.2 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》、《信诚沪深300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。

6.4.3 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6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 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

本基金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一致。

6.4.5 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]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) 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。(5) 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。

自2013年1月1日起,根据财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

于本报告期内,本基金管理人信诚基金管理有限公司和中信信托有限责任公司共同出资设立了资产管理子公司--中信信诚资产管理有限公司,其中信诚基金管理有限公司出资比例为55%,为第一大股东。

6.4.6.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.7 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。

6.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

6.4.7.2关联方报酬

6.4.7.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月1日(基金合同生效日)至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	955,134.67	981,577.81
其中:支付销售机构的客户维护费	177,538.17	221,715.73

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2012年2月1日起生效,上年度可比期间为2012年2月1日至2012年6月30日止。

6.4.7.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年2月1日(基金合同生效日)至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	210,129.62	215,947.17

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2012年2月1日起生效,上年度可比期间为2012年2月1日至2012年6月30日止。

6.4.7.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.7.4各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1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报告期内及上年度可比期间未投资过本基金。

6.4.7.4.2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。本基金其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.7.5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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年2月1日(基金合同生效日)至2012年6月30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	2,808,701.25	37,511.66	787,547.44	31,139.33

注:1、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2013年6月30日的相关余额为人民币1,566,935.83元。(2012年6月30日余额为1,065,247.39元)

2、本基金合同自2012年2月1日起生效,上年度可比期间为2012年2月1日至2012年6月30日止。

6.4.7.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于报告期末,本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

6.4.8.2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
600436	片仔癀	2013-06-21	实施配股事项	136.82	2013-07-01	118.73	1,235	148,978.58	168,972.70	-
600547	山东黄金	2013-04-03	重大资产重组	32.13	2013-07-01	28.77	11,620	422,455.47	373,350.60	-
601918	国投新集	2013-05-16	重大资产重组	7.55	2013-08-23	5.05	31,000	264,775.01	234,050.00	-
601989	中国重工	2013-05-17	重大资产重组	4.52	-	-	64,327	293,786.76	290,758.04	-
000999	华润三九	2013-06-03	重大资产重组	26.55	2013-08-19	26.51	21,401	635,916.17	568,196.55	-

注:截至本报告批准报出日,"中国重工"仍未发布复牌公告。

6.4.8.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 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	174,623,317.73	93.21
	其中:股票	174,623,317.73	93.21
2	固定收益投资	6,535,029.00	3.49
	其中:债券	6,535,029.00	3.49
	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	4,375,637.08	2.34
6	其他各项资产	1,806,542.28	0.96
7	合计	187,340,526.09	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	786,293.42	0.42
B	采矿业	12,194,984.79	6.54
C	制造业	61,849,576.13	33.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,618,283.96	2.48
E	建筑业	6,964,504.79	3.74
F	批发和零售业	4,124,910.94	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	3,966,748.30	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,419,227.20	1.83
J	金融业	58,622,142.75	31.45
K	房地产业	10,259,553.45	5.50
L	租赁和商务服务业	1,130,701.74	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,329,070.53	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	76,221.12	0.04
S	综合	1,640,878.52	0.88
	合计	170,983,097.64	91.74

7.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	260,560.00	0.14
C	制造业	1,679,483.64	0.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,009,176.52	0.54
E	建筑业	43,393.59	0.02
F	批发和零售业	322,785.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	324,821.34	0.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,640,220.09	1.95

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	600036	招商银行	445,805	5,171,338.00	2.77
2	600016	民生银行	592,704	5,079,473.28	2.73
3	601318	中国平安	116,924	4,064,278.24	2.18
4	601328	交通银行	963,544	3,921,624.08	2.10
5	601166	兴业银行	229,292	3,386,642.84	1.82
6	600000	浦发银行	344,247	2,850,365.16	1.53
7	000002	万 科A	287,129	2,828,220.65	1.52
8	601169	北京银行	345,240	2,751,562.80	1.48
9	600015	华夏银行	302,117	2,725,095.34	1.46
10	600519	贵州茅台	13,541	2,604,882.17	1.40

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600332	广州药业	26,814	918,647.64	0.49
2	601991	大唐发电	87,968	452,155.52	0.24
3	002450	康得新	14,689	410,998.22	0.22
4	000656	金科股份	28,026	324,821.34	0.17
5	000963	华东医药	8,100	322,785.00	0.17

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000651	格力电器	5,595,853.50	1.64
2	601169	北京银行	5,111,046.80	1.50
3	000776	广发证券	4,852,926.00	1.42
4	600690	青岛海尔	4,356,502.85	1.27
5	600050	中国联通	4,024,683.00	1.18
6	000063	中兴通讯	3,909,952.59	1.14
7	002024	苏宁云商	3,877,160.39	1.13
8	601688	华泰证券	3,817,077.94	1.12
9	600585	海螺水泥	3,767,850.92	1.10
10	000425	徐工机械	3,761,761.57	1.10
11	000157	中联重科	3,648,624.94	1.07
12	600010	包钢股份	3,568,378.00	1.04
13	000728	国元证券	3,513,747.33	1.03
14	600085	同仁堂	3,326,912.10	0.97
15	601601	中国太保	3,324,681.94	0.97
16	000338	潍柴动力	3,249,880.54	0.95
17	600015	华夏银行	3,233,883.00	0.95
18	600600	青岛啤酒	3,227,725.34	0.94
19	002236	大华股份	3,224,582.90	0.94
20	600031	三一重工	3,210,387.00	0.94

注: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。

7.4.2 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	601288	农业银行	8,645,301.92	2.53
2	601169	北京银行	7,145,443.24	2.09
3	600519	贵州茅台	6,293,734.25	1.84
4	000402	金 融 街	6,062,639.08	1.77
5	600089	特变电工	6,053,829.39	1.77
6	601818	光大银行	5,828,564.43	1.71
7	600739	辽宁成大	5,735,196.11	1.68
8	601398	工商银行	5,682,738.41	1.66
9	600887	伊利股份	5,584,084.99	1.63
10	000100	TCL 集团	5,523,456.46	1.62
11	600048	保利地产	5,507,064.67	1.61
12	600518	康美药业	5,388,764.08	1.58
13	601989	中国重工	5,367,037.31	1.57
14	600837	海通证券	5,229,302.08	1.53
15	601328	交通银行	5,227,103.33	1.53
16	600050	中国联通	5,082,530.36	1.49
17	601390	中国中铁	5,026,178.99	1.47
18	601857	中国石油	4,845,744.42	1.42
19	601988	中国银行	4,789,673.08	1.40
20	601377	兴业证券	4,776,570.43	1.40

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。

7.4.3 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	464,517,248.39
卖出股票收入(成交)总额	603,121,145.09

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。

7.5 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	5,994,000.00	3.22
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	541,029.00	0.29
8	其他	-	-
9	合计	6,535,029.00	3.51

7.6 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	010308	03国债(8)	60,000	5,994,000.00	3.22
2	110023	民生转债	5,080	528,066.00	0.28
3	110022	同仁转债	100	12,963.00	0.01

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1307	IF1307	11	7,077,180.00	-1,081,620.00	在本报告期内,基金利用股指期货作为工具进行套保,以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差,及应付大额申购赎回
公允价值变动总额合计(元)			-1,081,620.00		
股指期货投资本期收益(元)			-100,748.57		
股指期货投资本期公允价值变动(元)			-1,215,351.43		

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,"其他衍生工具-股指期货投资"与"证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款",符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将"其他衍生工具-股指期货投资"的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1中国平安保险(集团)股份有限公司(以下简称"平安集团")于2013 年 5 月 21 日发布了"中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告"。披露了平安集团控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")于近日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚和市场禁入事先告知书》的相关情况。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司(以下简称"万福生科")发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元,并处以人民币 5,110 万元的罚款,暂停其保荐机构资格 3 个月。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,此次中国证监会的处罚决定是对平安集团控股子公司平安证券所做出的。2012 年,平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的 0.19%,投行业务利润占平安集团净利润的 0.66%。作为平安证券的控股股东,平安集团已承诺将持续督促平安证券严格按照中国证监会的要求进行专项整改,切实保护投资者利益。我们认为,该处罚事项未对其长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚沪深300是指数型基金,对于平安集团的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

7.10.2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。

7.10.3其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,137,907.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	521,846.26
4	应收利息	144,205.88
5	应收申购款	2,582.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,806,542.28

7.10.4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	110022	同仁转债	12,963.00	0.01

7.10.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.10.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.10.6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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A)	635	137,817.67	22,394,271.00	25.59%	65,119,947.00	94.84%
信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)	1,522	57,499.49	4,514,917.00	5.16%	65,119,947.00	94.84%
信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)	1,164	42,241.69	10,837,004.77	22.04%	38,332,327.82	77.96%
合计	3,321	67,509.11	37,746,192.77	16.84%	186,451,576.82	83.16%

8.2 期末上市基金前十名持有人

信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001	9,930,000.00	11.35%
2	银河证券-光大-银河安心收益2号集合资产管理计划	4,294,255.00	4.91%
3	国信证券股份有限公司	3,217,103.00	3.68%
4	丁为民	2,917,500.00	3.33%
5	刘辉	2,650,000.00	3.03%
6	王隽	2,003,205.00	2.29%
7	徐援	1,776,500.00	2.03%
8	石松鹰	1,449,748.00	1.66%
9	王荣初	1,370,800.00	1.57%
10	刘国强	1,350,000.00	1.54%

信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李洋	3,965,858.00	4.53%
2	徐健	3,680,000.00	4.21%
3	郭方斌	3,318,400.00	3.79%
4	禹宙	2,110,600.00	2.41%
5	郑宇航	1,827,000.00	2.09%
6	王卫东	1,620,000.00	1.85%
7	樊青	1,520,000.00	1.74%
8	崔静	1,414,500.00	1.62%
9	东方证券股份有限公司	1,148,650.00	1.31%
10	张成柏	1,109,914.00	1.27%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A)	-	-
	信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)	-	-
	信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)	61,416.61	0.12%
	合计	61,416.61	0.03%

注:1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚沪深300指数分级A(场内简称:信诚300A)	信诚沪深300指数分级B(场内简称:信诚300B)	信诚沪深300指数分级(场内简称:信诚300)
基金合同生效日(2012年2月1日)基金份额总额	83,336,256.00	83,336,257.00	223,636,175.61
本报告期期初基金份额总额	129,728,276.00	129,728,277.00	90,360,417.11
本报告期基金总申购份额	-	-	286,343,248.15
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	417,802,131.72
本报告期基金拆分变动份额	-42,214,058.00	-42,214,058.00	90,267,799.05
本报告期期末基金份额总额	87,514,218.00	87,514,219.00	49,169,332.59

注:信诚300A、信诚300B拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。信诚300拆分变动份额包括本基金三级份额之间的配对转换份额及基金份额折算的调整份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》的有关约定,信诚基金管理有限公司以通讯方式召开了信诚沪深300指数分级基金基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会于2013年3月8日起至2013年4月8日期间通过投票表决的形式,审议通过了《关于修改信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金管理人已将本次会议决议结果报中国证券监督管理委员会审批,并于2013年5月27日收到中国证券监督管理委员会于2013年5月23日印发的《关于核准信诚沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]686号),核准信诚沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。

10.2 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所。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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1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	
红塔证券	1	174,084,762.87	16.31%	158,486.84	16.45%	本期新增1个交易单元
渤海证券	1	170,350,517.49	15.96%	150,743.84	15.64%	-
山西证券	1	144,833,274.98	13.57%	131,857.11	13.68%	-
长江证券	1	108,256,723.82	10.14%	98,557.01	10.23%	-
中投证券	2	100,744,133.14	9.44%	91,717.94	9.52%	-
兴业证券	1	93,383,816.72	8.75%	82,635.41	8.57%	-
招商证券	2	67,656,226.20	6.34%	61,594.34	6.39%	本期新增1个交易单元
大通证券	1	59,522,050.54	5.58%	54,189.08	5.62%	-
中银国际	1	47,655,745.42	4.46%	42,579.92	4.42%	-
齐鲁证券	1	32,301,243.15	3.03%	29,407.20	3.05%	-
东兴证券	1	23,034,616.00	2.16%	20,897.67	2.17%	-
宏源证券	2	16,796,251.87	1.57%	14,862.94	1.54%	本期新增1个交易单元
申银万国	1	12,203,798.24	1.14%	11,110.44	1.15%	-
民生证券	1	11,939,940.71	1.12%	10,870.16	1.13%	-
长城证券	1	4,754,164.89	0.45%	4,206.89	0.44%	本期新增1个交易单元
安信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	本期退租
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	本期新增1个交易单元
西南证券	1	-	-	-	-	本期新增1个交易单元
信达证券	2	-	-	-	-	本期新增1个交易单元
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	本期退租
浙商证券	1	-	-	-	-	本期新增1个交易单元
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	本期新增1个交易单元
中信浙江	1	-	-	-	-	本期新增1个交易单元

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。

10.7.2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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
红塔证券	6,020,289.70	100.00%
渤海证券	-	-
山西证券	-	-
长江证券	-	-
中投证券	-	-
兴业证券	-	-
招商证券	-	-
大通证券	-	-
中银国际	-	-
齐鲁证券	-	-
东兴证券	-	-
宏源证券	-	-
申银万国	-	-
民生证券	-	-
长城证券	-	-
安信证券	-	-
高华证券	-	-
广发证券	-	-
国金证券	-	-
国联证券	-	-
国泰君安	-	-
国信证券	-	-
海通证券	-	-
华宝证券	-	-
华创证券	-	-
华融证券	-	-
联合证券	-	-
瑞银证券	-	-
西南证券	-	-
信达证券	-	-
银河证券	-	-
英大证券	-	-
浙商证券	-	-
中航证券	-	-
中金公司	-	-
中信建投	-	-
中信金通	-	-
中信浙江	-	-

信诚基金管理有限公司
2013年8月28日