信诚添金分级债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
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	信诚添金分级债券	
基金主代码	550017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月12日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,306,066,843.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚季季添金	信诚岁岁添金
下属分级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,378,851,789.18份	927,215,054.39份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过主动管理，力争追求超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	季季添金份额为低风险、收益相对稳定的基金份额	岁岁添金份额为中高风险、中高收益的基金份额

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	唐州徽
	联系电话	021-68649788	95566
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	95566
传真		021-50120888	010-66594942

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

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	84,393,964.39
本期利润	118,187,638.39
加权平均基金份额本期利润	0.0393
本期基金份额净值增长率	3.57%
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	0.0309
期末基金资产净值	2,376,997,269.29
期末基金份额净值	1.031

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。

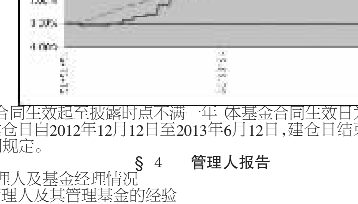
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-0.91%	0.24%	-0.27%	0.06%	-0.64%	0.18%
过去三个月	1.03%	0.17%	0.88%	0.05%	0.15%	0.12%
过去六个月	3.57%	0.15%	2.37%	0.04%	1.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	3.46%	0.14%	2.63%	0.04%	0.83%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2012年12月12日）。

2、本基金建仓日自2012年12月12日至2013年6月12日，建仓日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		
王国强	本基金基金经理，信诚三得益债券基金及信诚理财7日盈债券基金基金经理	2012年12月12日	-	13	管理学硕士，13年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司，现任信诚三得益债券基金、信诚理财7日盈债券基金以及信诚添金分级债券基金的基金经理。
王旭巍	本基金基金经理、信诚增强收益债券封闭基金和信诚新双盈分级债券基金基金经理，信诚基金管理有限公司固定收益总监	2013年1月15日	-	19	经济学硕士，19年金融、证券、基金行业从业经验。曾先后任职于中国（深圳）物资工贸集团有限公司大连期货部、宏达期货经纪有限公司、中信证券资产管理部和华宝兴业基金管理有限公司。2010年加盟信诚基金管理有限公司，现任公司固定收益总监。

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《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚添金分级债券型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

上半年宏观基本面对债券市场较为有利。经济增长仍然较弱，投资、出口回落，消费增长平稳偏弱。物价维持低位，预计未来通胀压力不大。一季度，在央行实施的稳健的货币政策下，债市资金面总体上保持宽松，债市延续了牛市行情，信用债涨幅较大。二季度债券市场跌宕起伏，经历了两波调整，一是4月份中旬债券市场监管加强，导致债市调整；二是6月份资金面异常紧张，货币市场利率大幅上行，其原因是美联储量化宽松退出预期影响外汇流入增长放缓、债市和汇市监管加强、大量银行理财产品集中到期、企业所得税集中清缴以及补缴法定准备金等多因素叠加影响。上半年债市总体上保持上涨态势，标普全债指数上涨2.62%，信用债券投资收益较为突出，中信标普企业债指数上涨3.79%。

二季度，本基金着重投资企业债、公司债、短期融资券等信用债，采取低久期、高杠杆策略。鉴于当前债市收益率已处于较低水平，将组合控制在低于基准的水平，有利于降低组合波动风险，获得稳定的投资收益。本基金通过严格内部信用评级体系，甄别信用风险，遴选信用风险低且利率较高的信用债进行投资。本基金没有参与可转债投资。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

上半年本基金比较基准收益率为 2.37 %，本基金份额净值增长率为3.57 %，超越基准1.20 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年仍将延续经济增长弱复苏态势，通胀压力不大，预计央行依旧会维持中性偏宽松的货币政策，货币供应仍将维持稳中有升态势，债市资金面状况不会出现逆转，债券投资收益仍然看好。

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

本基金（包括季季添金和岁岁添金份额）不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对信诚添金分级债券型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：信诚添金分级债券型证券投资基金

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		21,329,928.52	79,663,769.89
结算备付金		63,947,169.64	-
存出保证金		1,106,122.71	-
交易性金融资产		4,726,938,144.95	3,106,702,296.45
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,726,938,144.95	3,106,702,296.45
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	379,301,328.95
应收证券清算款		128,857,943.26	7,936,698.66
应收利息		114,262,745.89	67,316,071.12
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,056,442,054.97	3,640,920,165.07
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		2,574,199,713.80	519,999,961.20
应付证券清算款		100,307,852.62	28,889,146.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,351,627.39	962,672.92
应付托管费		405,488.22	288,801.89
应付销售服务费		497,482.57	393,910.09
应付交易费用		5,354.33	9,818.20
应交税费		414,397.02	394,396.00
应付利息		2,044,677.85	157,955.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		218,191.88	-
负债合计		2,679,444,785.68	551,096,661.61
所有者权益：			
实收基金		2,278,291,252.39	3,092,807,521.16
未分配利润		98,706,016.90	-2,984,017.70
所有者权益合计		2,376,997,269.29	3,089,823,503.46
负债和所有者权益总计		5,056,442,054.97	3,640,920,165.07

注：1. 本基金合同自2012年12月12日起生效，报告期为2013年1月1日至2013年6月30日止。

2.报告截止日2013年6月30日，基金份额总额2,306,066,843.57份。下属两级基金："信诚季季添金"的基金份额净值1.003元，基金份额总额1,378,851,789.18份；"信诚岁岁添金"的基金份额净值1.072元，基金份额总额927,215,054.39份。

6.2利润表

会计主体：信诚添金分级债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		170,318,563.81
1.利息收入		116,536,583.82
其中：存款利息收入		996,466.56
债券利息收入		114,346,662.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,193,454.36
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以"-"填列）		19,988,305.99
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		19,988,305.99
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		33,793,674.00
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		-
二、费用		52,130,925.42
1.管理人报酬		9,149,031.27
2.托管费		2,744,709.36
3.销售服务费		3,648,608.70
4.交易费用		33,668.51
5.利息支出		36,292,495.20
其中：卖出回购金融资产支出		36,292,495.20
6.其他费用		262,412.38
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		118,187,638.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		118,187,638.39

注：本基金合同自2012年12月12日起生效，报告期为2013年1月1日至2013年6月30日止。无上年度可比期间。

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚添金分级债券型证券投资基金

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）	3,092,807,521.16	-2,984,017.70	3,089,823,503.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,187,638.39	118,187,638.39
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）	-814,516,268.77	-16,497,603.79	-831,013,872.56
其中：1.基金申购款	1,986,659,025.31	26,308,413.28	2,012,967,438.59
2.基金赎回款	-2,801,175,294.08	-42,806,017.07	-2,843,981,311.15
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）	2,278,291,252.39	98,706,016.90	2,376,997,269.29

注：本基金合同自2012年12月12日起生效，报告期为2013年1月1日至2013年6月30日止。无上年度可比期间。

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

信诚添金分级债券型证券投资基金（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"）《关于核准信诚添金分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可［2012］1523号文）和《关于信诚添金分级债券型证券投资基金备案确认的函》（基金部函［2012］1124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《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2012年12月12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，基金托管人中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2012年11月28日至2012年12月3日以及2012年12月5日至2012年12月10日，通过销售机构公开发售，其中岁岁添金的发售时间为2012年11月28日至2012年12月3日，季季添金的发售时间为2012年12月5日至2012年12月10日。

募集的净认购金额3,092,526,956.94元（其中信诚季季添金2,165,472,931.81元，信诚岁岁添金927,054,025.13元），募集期间产生的利息转份额280,564.22元（其中信诚季季添金119,534.96元，信诚岁岁添金161,029.26元），募集规模为3,092,807,521.16份（其中信诚季季添金2,165,592,466.77份，信诚岁岁添金927,215,054.39份）。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了毕马威华振验字第1200022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、《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》和《信诚添金分级债券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，主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、回购、银行定期存款、中期票据等固定收益类金融工具以及法律规法或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其它权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%；权益类资产的比例不高于基金资产的20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。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适当调整。本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数收益率。

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》、《信诚添金分级债券型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重要会计政策和会计估计

6.4.4.1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。

6.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3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。

6.4.4.4 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获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）（ii）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。

6.4.4.5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）。

本报告期，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。

本报告期，本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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"。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）于卖出股票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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬根据《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，按前一日基金资产净值0.6%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费根据《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，按前一日基金资产净值0.18%的年费率逐日计提。

本基金的销售服务费根据《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，季季添金的销售服务费按按前一日季季添金资产净值的0.35% 年费率计提，岁岁添金不收取销售服务费。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

期末可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本基金（包括季季添金和岁岁添金份额）不进行收益分配。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无差错事项。

6.4.6 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］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。

6.4.7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
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	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
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行过交易。本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	9,149,031.27
其中：支付销售机构的客户维护费	3,774,637.56

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0.6%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×0.6%/当年天数。

2、本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,744,709.36

注：1、支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.18%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×0.18%/当年天数。

2、本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国银行	3,193,053.68
信诚基金管理有限公司	72,892.10
合计	3,265,945.78

注：1、季季添金的年销售服务费率为0.35%，岁岁添金不收取销售服务费。

在通常情况下，季季添金的销售服务费按前一日季季添金资产净值的0.35% 年费率计提。计算公式为：季季添金日销售服务费=季季添金前一日资产净值×0.35%/当年天数。

2、本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内未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2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1、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间未投资过本基金。

2、本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.8.4.2 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

信诚岁岁添金

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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	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	40,004,000.00	4.31%	40,004,000.00	4.31%

注：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"信诚岁岁添金"份额及其所占"信诚岁岁添金"份额的比例。

2、除上表所示外，本基金其它关联方在本报告期末未持有本基金。本基金合同自2012年12月12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。

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	21,329,928.52	571,990.82

注：本基金通过"中国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63,947,169.64元。（本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。）

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。本基金合同自2012年12月12日起生效，无上年度可比期间。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,574,199,713.80元，于2013年7月1日、4日和5日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	4,726,938,144.95	93.48
	其中：债券	4,726,938,144.95	93.48
	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	85,277,098.16	1.69
6	其他各项资产	244,226,811.86	4.83
7	合计	5,056,442,054.97	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未发生股票买卖交易。

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

本基金本报告期内未发生股票买卖交易。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未发生股票买卖交易。

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	139,875,000.00	5.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,767,130,144.95	158.48
5	企业短期融资券	759,913,000.00	31.97
6	中期票据	60,020,000.00	2.53
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,726,938,144.95	198.86

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	111050	09华菱债	3,000,000	299,700,000.00	12.61
2	041359003	13杉杉CP001	2,000,000	199,740,000.00	8.40
3	122621	12赣城债	760,620	77,294,204.40	3.25
4	041358003	13广汇汽车CP001	700,000	70,021,000.00	2.95
5	122707	12泰兴债	614,520	65,839,672.80	2.77

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。

7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

7.9投资组合报告附注

7.9.1 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

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,106,122.71
2	应收证券清算款	128,857,943.26
3	应收股利	-
4	应收利息	114,262,745.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,226,811.86

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.9.6 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。

§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
信诚季季添金	6,536	210,962.64	281,547,811.68	20.42%	1,097,303,977.50	79.58%
信诚岁岁添金	949	977,044.31	716,087,071.94	77.23%	211,127,982.45	22.77%
合计	7,485	308,091.76	997,634,883.62	43.26%	1,308,431,959.95	56.74%

8.2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	信诚季季添金	21,553.61	-
	信诚岁岁添金	805,326.79	0.09%
	合计	826,880.40	0.04%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为：100万份以上。

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	信诚季季添金	信诚岁岁添金
基金合同生效日（2012年12月12日）基金份额总额	2,165,592,466.77	927,215,054.39
本报告期期初基金份额总额	2,165,592,466.77	927,215,054.39
本报告期基金总申购份额	2,012,967,438.59	-
减：本报告期基金总赎回份额	2,843,981,311.15	-
本报告期基金拆分变动份额	44,273,194.97	-
本报告期期末基金份额总额	1,378,851,789.18	927,215,054.39

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

1、报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、关于基金托管人的重大人事变动：

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

2013年6月1日，中国银行股份有限公司发布公告，自2013年5月31日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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	
东方证券	1	-	-	-	-	本期新增
浙商证券	1	-	-	-	-	本期新增
中信证券	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。

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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-
浙商证券	689,680,850.46	13.00%	3,521,125,000.00	5.77%
中信证券	4,614,030,522.88	87.00%	57,545,200,000.00	94.23%

信诚基金管理有限公司
2013年8月28日