信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

基金管理人:信诚基金管理有限公司

了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记 裁、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。

內。 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。 本报告中财务资料未经审计

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

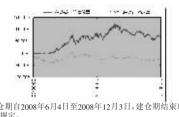
§ 2 基金产品概况					
基金简称	信诚盛世蓝筹股票				
基金主代码	550003				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2008年6月4日				
报告期末基金份额总额	1,102,007,264.19份				
投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司,追求基金财产的长期程 定增值。				
投资策略	本基金投资组合中股票 佛券,现金各自的失期均衡比重,依照本基金的转值和风险偏纤而确定。本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中规期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金分许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。				
业绩比较基准	80%×中信标普50指数收益率+20%×中信全债指数收益率				
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。				
基金管理人	信诚基金管理有限公司				
其 全兵等人	由国建设银行职份有限公司				

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

3.1 = 3.0 % 3.11 %	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年1月1日至2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-89,533,958.99
2.本期利润	35,000,413.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0292
4.期末基金资产净值	1,784,299,079.78
5.期末基金份额净值	1.619
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。	

以此小丁安區丁別判數子。 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。 3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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

争值增长率标 业绩比较基准 收益率标准差 收益率3 1)-(3) 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 变动的比较



注:本基金建仓期自2008年6月4日至2008年12月3日,建仓期结束时资产配置比例符 合本基金基金合同规定。

台本基金	基金合同	规定。	§ 4 質	理人报告	E
4.1	基金经理	成基金经理/	小组)简介	连入取品	=
姓名	职务	任本基金的表 任职日期	基金经理期限 离任日期	证券从业 年限	说明
张光成	本基金基金 经理	2011年10月28	-	7	CFA。曾任欧洲货币(上海)有限公司研究总 监 类业全球基金管理有限公司基金经理。 2011年7月加入信诚基金管理有限公司,担 任投资经理。现任信诚盛世蓝筹股票型基 金基金经理。
注:1	1.上述任职		期根据本基		对外披露的任免日期填写。
					3. 26: 46: 65: 7H + 5+ % 66.4H - 24: 4H c2:

注:1.上还任职口期,為住日期根据本基金管理人对外级路的柱鬼日期現与。 2.证券从业的含义遵从行业协会 征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 征券投资基金法》和其他相关法律法规的规 定以及 信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基 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公平交易与项说明

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易制度的执行情况
4.3.1公平交易制度的执行情况
根据中国证胎会颁布的 证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司
规定的 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。确保各段级组合享有公平的投资办策机会,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
制、确保不同基金在一、二级市场对国一证券交易时的公平,公司同时不断完善和改进公
中交易分析系统。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报告期内基金的投资策略和运作分析

(8证5年日 成文里5%的父列。 4.4报告期内基金的投资策略和运作分析 一季度以来,市场触底回升,展开一波反弹。上证指数最高反弹到2500点附近,然而由 于宏观经济的因素,上涨指数在季度末又回落到2200多点。 从数据看,地产行业虽然仍然受到较严厉的调控,但比之前已经略有放松。国家对刚

性需求逐渐采取鼓励政策,因此各地房地产成交量有一定的回暖。本基金也增持了部分房 成宗。 目前宏观经济缺乏动力,因此经济数据不佳。但需要关注的是政府的政策,财政政策 T政策都有微调的可能性。但制约股市发展的其他因素也较多,例如新股发行制度的

改革。 从本季度的操作来看,在上涨中本基金表现较好,但在下跌中表现较差,没有保住胜利果实,这点值得在今后的操作中反思,要做到攻守更平衡。 4.5报告期内基金的业绩表现 本报告期基金份额净值增长率为0.62%,同期业绩比较基准收益率为3.41%,基金份额

本报告期基金份额(中間2000年) 净值增长率表现落后基准2.79个百分点。 § 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,386,830,831.51	74.84
	其中:股票	1,386,830,831.51	74.84
2	固定收益投资	97,653,000.00	5.27
	其中:债券	97,653,000.00	5.27
	资产支持证券	_	
3	金融衍生品投资	_	
4	买人返售金融资产	_	I
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	_	
5	银行存款和结算备付金合计	266,003,824.33	14.36
6	其他资产	102,467,303.74	5.53
7	合计	1,852,954,959.58	100.00

占基金资产净值比例(%) 林、牧、渔业

172,993,406.0 890.623.669.24 49.9 316,060,476.0 品、饮料 织、服装、皮 38,830,076.3 2.1 C4 石油、化学、塑胶 72,011,000.19 58,250,065.10 C6 金属、非金属 128,615,277.3 82,754,005.50 108,513,694.91 C99 其他制造业 85,589,073.75 4.80 力、煤气及水的生产和供应 1,143,956.18 F 交通运输、仓储业 G 信息技术业 H 批发和零售贸易 54,273,863.42 224,744,530.7 12.6 4.998.770.43

1,386,830,831.51 金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 .3 报告期末按公允价值占基 股票名称 85,589,073.7 83,718,739.1 81,658,728.9 64,992,709.9 64,632,218.6 63,945,141.9 63,695,199.9 4,645,150 61,641,140.50 53,705,674.00 52,901,423.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 其中:政策性金融信 4 企业债券 5 企业短期融资券 6 中期票据 9 合计 97,653,000.00 5.5 报告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 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 48,370,000. 4行票据86 48,345,000.00 938,000.00

注, 木基全木报告期末仅挂有上述三旦债券 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7 报告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。 5.8 投资组合报告附注。

5.8.1 宜宾五粮淀股份有限公司于2011年5月28日发布 "笑于收到中国证监会 行政处罚决定书》的公告",监管机构认定公司在信息披露方面存在违法事实,并对公司和相关高

管人员处以警告和罚款。 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,认为该公司 2011年5月收到的中国证监会 行政党 晋通中书》是对其人民则联码的几点成本,必为该公司 2011年5月收到的中国证监会 行政党 晋通和书》是对其几年以前违法行法,必为该公司 告,该公司已经对有关事项进行了整改并取得明显实效,该公司近年来生产、销售同步大 幅增长,利润大幅增加,未来发展步步,良好,处罚事项未对表财务状况和投资价值产生重 大实质性影响。该证券投资已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

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,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚。 5.8.2 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。 5.8.2 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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	530,053.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,256,128.90
5	应收申购款	100,681,120.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,467,303.74
5.8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换价	

本基金本报告期末末持有处于转股期的可转换债券。 5.8.5 报告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情况。 5.8.6 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

8.6 开放式基金份额变动

		平区: 0
Ě	报告期期初基金份额总额	1,296,948,795.50
J	报告期期间基金总申购份额	78,576,963.92
ŧ	减:报告期期间基金总赎回份额	273,518,495.23
	报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	_
Į.	报告期期末基金份额总额	1,102,007,264.19
	§ 7 备查文件目录	

7.1 m 量 又 r r o x 1、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金相关批准文件

1、市城盛也显寿取宗垒业分及政建业和大轨准。 2. 信诚基金管理公司管理执照、公司管程 3. 信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同 4. 信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金招募说明+ 5. 本报告期内按照规定披露的各项公告

7.2存放地点 信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银

行大楼9层

报资看可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。 亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司

信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF)

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 报告送出日期:2012年4月24日

基金管理人的董事会及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责任。

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4月17日复核 了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、 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-

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。 本报告中财务资料未经审计

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止 82 基金产品概况 设告期末基金 233,979,456.8 b资目标 ⊕ 密 し险收益特征

3.1 主要财务指标

	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年1月1日至2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-4,582,605.65
2.本期利润	4,339,772.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0184
4.期末基金资产净值	186,744,587.40
5.期末基金份額净值	0.798
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

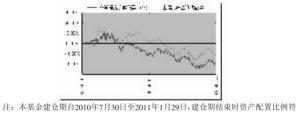
83 主要财务指标和基金净值表现

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。

3.2.1本报告期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

争值增长率① 净值增长率标 业绩比较基准 收益率3 收益率系准差

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



合本基金基金合同规定。 § 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组)简介 姓名

2011年9月8日 曾任华宝信托有限责任公司高级分析师。 2 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 征券投资基金法》和其他相关法律法规的规定

以及 信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF 基金合同》、信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF)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。 本报告期內,本基金误买入基金托管人中国建设银行发行的股票。本基金管理人于购入该股后的首个交易日对上述股票进行了清仓处理,未对基金份额持有人利益造成损失。对此 失误本基金管理人深表歉意,并对相关责任人进行了严肃的纪律处理,并已采取多项措施 加强内部控制,坚决杜绝类似事件再度发生。

4.3公平交易专项说明 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报告期内基金的投资策略和运作分析 本报告期内本基金严格坚持基金合同的要求,积极寻找具有深度价值特征的行业和个

股,坚持寻找具有较高成长性的行业和公司作为配置的重点。一季度增持了地产、白酒,减 持了一些业绩发生不利变化的个股。 短期看,中国经济还处在周期性的下行通道中,通胀压力依然较大,货币政策大规模放

松的空间不大。从中长期看,要素价格的不断上升使中国原有的经济增长模式受到挑战,但 转型和制度改革红利将为中国提供新的增长动力。 不至此的成果也们对为下间实际新的增长的力。 二季度,影响市场的不确定性因素依然较多。流动性和企业盈利状况不支持市场反转, 股票供给的持续增加,发行制度的改革将压制估值的上升空间,市场箱体震荡的概率较大。

业和个股之间的盈利能力将出现显著差异,那些具有持续竞争能力的公司其市场地位将 得到讲一步巩固. 本基金将深入挖掘行业和个股的投资价值,在不确定中精选成长确定的行业和个股,

同时适度参与强周期性板块的阶段性行情,争取为基金持有人获得长期稳定的回报。

截止本报告期末,本基金份额净值为0.798元,本报告期份额净值增长率为2.31%,同期

业绩比较基准收益率为4.3%,落后业绩比较基准1.99%。

5.1报告期末基金资产组合情况 占基金总资产的比例(%) 152,314,428.90 152,314,428.90 80.0

37,078,123.6

190.319.543.34

19.48

0.40

100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行存款和结算备付金合

A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	3,998,700.00	2.14
C	制造业	71,657,690.45	38.37
C0	食品、饮料	38,428,866.64	20.58
C1	纺织、服装、皮毛	4,359,058.48	2.33
C2	木材、家具		
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,712,350.00	1.45
C5	电子	6,506,728.00	3.48
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	13,726,187.33	7.35
C8	医药、生物制品	5,924,500.00	3.17
C99	其他制造业		
D	电力、煤气及水的生产和供应业		
E	建筑业	5,753,716.80	3.08
F	交通运输、仓储业		
G	信息技术业	14,837,900.00	7.95
Н	批发和零售贸易	6,643,300.00	3.56
I	金融、保险业	9,433,694.91	5.05
J	房地产业	39,989,426.74	21.41
K	社会服务业	-	_
L	传播与文化产业	-	
M	综合类		
	合计	152,314,428.90	81.56

净值比例大小排序的前十名股票投资明细 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 14,837,900.0 002304 5.4 报告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。 5.5 报告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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券 5.7 报告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。 5.8 投资组合报告附注 5.8.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告

编制目前一年内受到公开谴责、处罚。 5.8.2 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。 5.8.3 其他资产构成

6,704.7 584 报告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。

5.8.5 报告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情况。

5.8.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动 单位: 6 237,733,356.33

4,653,246.9 233,979,456.87 § 7 备查文件目录 71备查文件目录

1、信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF)相关批准文件 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程 3、信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF)基金合同

4、信诚深度价值股票型证券投资基金 LOF)招募说明书 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

信诚基金管理有限公司办公地---上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。 亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.en

信诚基金管理有限公司

2012年4月24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 报告送出日期:2012年4月24日 §1 重要提示 基金管理人的董事会及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,准确性和完整性水担个别及连带责任。 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4月17日复核 了本报告中的财务指标,净值表现和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。

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。 本年年七时最终或对主经审计

本报告期自2012年1月1	日起至3月31日止。 § 2 基金产品概况	
基金简称	信诚三得益债券	
基金主代码	550004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年9月27日	
报告期末基金份额总额	69,894,558.88份	
投资目标	本基金在保证基金资产的 风险,同时通过主动管理	的较高流动性和稳定性基础上,严格控制 ,追求超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	按顺的好资米用公司对 2.新股申助贿赂 本基金将结合市场 发新股的申助收益率, 判断新股申购收益率, 3.二级市场股票投资 本基金股票投资将 平较低,具有中长期投资 建组合。以避免单一股票 4. 标生金融工具投资	「下、积极投资和控制风险的债券投资的运动对收益率的均期,进行或协会集份的人期等。 通过对收益率的均期,进行资油、在放弃机 收益率 其一位成本位置上采取附市场查和 收益率 等风险的基础上,获取超额收益。对于可 "定其中的值分析"。 约察全行的均在价值以及上市溢价可能 定审购策略和卖出策略。 策略 计量的一个股进行投资。同时分散个股土 的特定风险。 策略 工具的投资主要以对户投资网险或无污 验将在有效进行风险管理的前提下,通过 经有生工具定价值
业绩比较基准	收益率	收益率+20%×一年期银行定期存款税后
风险收益特征	本基金为债券型基金, 原 期风险与收益高于货币 金。	于证券投资基金中的低风险品种,其系市场基金,低于混合型基金和股票型基
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	2司
下属两级基金的基金简称	信诚三得益债券A	信诚三得益债券B
下属两级基金的交易代码	550004	550005

报告期末下属两级基金的份額总额 38,527,600.20份 31,366,958.68 § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标		
		单位:人民币元
主要财务指标	信诚三得益债券A报告期(2012年1 月1日至2012年3月31日)	信诚三得益债券B报告期(2012年1 月1日至2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-594,707.80	-488,699.94
2.本期利润	-99,099.09	-134,216.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0025	-0.0046
4.期末基金资产净值	37,074,917.95	29,940,439.65
5.期末基金份额净值	0.962	0.955
注.1 上录其交业结构	- 不句 托技有 1 计 酌 武	>的女位费用 计 A 费用巨灾层

注:1、上还基金业领指标不包括符有人认购或交易基金的各项效用, 计入效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。 3.2 基金净值表现。 3.2.1 本报告期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

5.4 恋证伊旺农块。 3.2.1 本核片期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 信诚三得益债券A

阶段 (2)-(4) 争值增长率① (1)-(3) -1.19% 0.30% 0.88% 信诚三得益债券R 净值增长率标 准差② | 0.35% | 0.35% | 0.03% | 0.15% | 0.30% | 0.03% | 0.15% | 0.30% | 0.30% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.0

信诚三得益债券型证券投资基金

. ... 信诚三得益债券B

注: 本基金建仓期自2008年9月27日至2009年3月26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	6经理	或基金经理/	小组)简介		
ſ	姓名	职务	任本基金的基		证券从业	说明
	XIA	H7 (95	任职日期	离任日期	年限	19690
	王国强	本基金 基金经 理	2008年9月27日	-	12	管理学硕士,12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 司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现 任信诚三得益债券型基金的基金经理。
	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。

注:1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外政商的任日期境空。
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管理人对根长期内本基金定作遵规户信情况的说明
在本报告期内、本基金管理人对外政商的任日期境空。
4.2管理人对根长期内本基金定作遵规户信情况的说明
在本报告期内、本基金管理人对格报则 证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及 信诚三得益债券型证券投资基金法企合同》、信诚三得益债券型证券投资基金报募说明书的约定、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设度,可能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。本报金期内,基金运作合规、没有发生损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理》,基金运作合规、没有发生损害基金份额持有人利益的行为。
4.3公平交易与项说明
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 看诚基金公平交易管理制度、1.2》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易有发的各项设理,4.3和行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的 看诚基金公平交易增取制度,1.2。公司采取了一系列的方动实际落实公平交易标查资资流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的人平公司同时不断完善所之许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人平公务相关程序,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的相关程序,及其实的流程控制,确保不可是素的大量,未是全有多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%的交易。

4.318 白刺內亞並和亞亞東亞 一季度本基金比较基准收益率为0.88%,本基金A、B份額净值增长率分別为-0.31%和-0.31%,分別落后基准1.19%和1.19%。 § 5 投资组合报告 5.1报告期末基金资产组合情况 8.651.697.2 63,228,407

靈衍生而12 页 人返售金融资产 中:买断式回购的买人返售金融资

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组代码 石油、化学、塑胶 C6 金属、非金属 C7 机械、设备、(1,778,000.00 1,664,000. 交通运输、仓储》 信息技术业 批发和零售贸易 金融、保险业 942,400.0

5.3 报告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 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 1,778,000. 000895 20.000 1.378.000.0 000853 000651 600256 000869 / 100046/
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资经 公允价值(元)

4,000,400.0

14,259,358.3

63,228,407.02

5.5 报告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 债券代码 债券名称 8 802 000.0 - 1994,500.00 7.45 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 细

本基金本报告期末未持有资产支持证券 5.7 报告期末接交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。 不要选择以口纳不不行日发证。 5.8 投资组合报告附注 5.8.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告

编制目前一年内受到公开谴责、处罚。 3-11m 中下3×33公川堰积、火灯4。 5.8.2 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。 5.8.3 其他资产构成 261,301.2 1,284,604.5

1 545 905 80 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明约
 4
 ||125887
 ||中期转债
 ||338,498.3

 5.8.5
 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	价值(元)	值比例 (%)	流通受限情况识明	
1	000895	双汇发展	1,378,000.00	2.06	因中国证监会并购重组审核委员会审核河南双汇投资发展股份有限公司重大资产重组事项,双汇发展与3月29日开始停牌,于4月6日复牌。	
5.8. 6 尾差。	5 因四舍五入	原因,投资组合	·报告中市值占净值	直比例的	的分项之和与合计可能存在	4

§ 6 开放式基金份额变动 单位:

备查文件目录

设告期期初基金份额总案

7.1备查文件目录 1、信诚三得益债券型证券投资基金相关批准文件 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程 3、信诚三得益债券型证券投资基金基金合同 4、信诚三得益债券型证券投资基金招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告 信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行 大楼9层 7.3查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。 亦可通过公司网站查阅,公司网址为www.citicprufunds.com.cn

> 信诚基金管理有限公司 2012年4月24日