

# 信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

## 2012 第二季度报告

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7月19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7月16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。

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4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	信诚盛世蓝筹股票
基金代码	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	1,107,415,279.90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,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、现金各目的长期均衡配置,依照本基金的特性和风险特征而调整。本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不同市场的中短期变化而改变,在不同的市场条件下,本基金允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
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)
1.本期已实现收益	37,949,634.46
2.本期利润	65,835,928.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0615
4.期末基金资产净值	1,856,161,185.32
5.期末基金份额净值	1.676

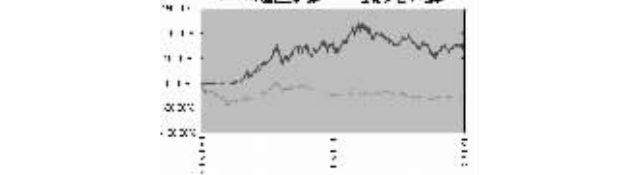
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2 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

阶段	净值增长率①	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
2012年第2季度	3.52%	1.00%	1.18%	0.81%	2.34%	0.19%

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: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。

向约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	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日	-	7	CFA,7年证券、基金从业经验。曾任欧洲货币(上海)有限公司研究总监、兴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证券投资基金基金经理。

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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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(1.23)》,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,确保不同基金在一级、二级市场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的交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析  
2季度以来,市场冲高回落,上证指数一度上涨到2453点,非常接近年内高点,然后回落到2200点附近。国家货币政策继续宽松,报告期内降了一次息和准备金率,然后在7月初又降了一次息,不过整体经济仍然比较疲软,工业数据仍然较差。海外形势尤其是欧洲政治经济形势仍然比较严峻,这也导致了投资者在操作上比较谨慎,股指不能够持续上涨的主要原因。

从数据看,地产行业虽然仍然受到中央政府严厉的调控,但各地政府已经放松了部分调控措施。各地房地产成交量有比较大的回暖,尤其是各龙头公司最近两个月的销售情况非常不错。本基金也持有了较多的房地产股票。同时食品饮料以及医药行业也是本基金长期看好的板块,也将长期持有这些稳定增长的股票。

从本季度的操作来看,值得反思的问题非常多,在前一度表现不错,但当市场开始调整后尤其是煤炭等板块大幅调整的时候来不及不够果断,导致了净亏损受了较大的损失。这点值得在今后的操作中注意,要做到及时止损。

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3.52%,同期业绩比较基准收益率为1.18%,基金份额净值增长率表现领先基准2.34个百分点。

§ 5 投资组合报告	
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7月19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7月16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。	
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4月1日起至6月30日止。	
§ 2 基金产品概况	
基金简称	信诚三得益债券
基金代码	550004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月12日
报告期末基金份额总额	64,177,009.78份
投资目标	本基金在保证基金资产的较高流动性和稳定性基础上,严格控制风险,同时通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.债券类资产的投资策略 本基金采取自上而下、积极管理和控制风险的投资策略,在战略配置上,主要通过对收益率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体配置;在战术配置上采取跨市场套利,收益来源由利率预期和信用利差策略等两个标准进行选择,在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上,获取超额收益。对于可转换的投资采用公司分析法和价值分析。 2.新股申购策略 本基金结合市场的资金状况预期和发行上市的新股(或增发新股)的申购中签率,考察它们的内在价值以及上市溢价可能,判断新股申购收益,制定申购策略和卖出策略。 3.二级市场投资策略 本基金股票投资注重基本面研究,选择流动性好,估值水平较低,具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股,构建组合,以分散单一股票的投资风险。 4.衍生品金融工具投资策略 本基金对衍生金融工具的投资主要用于对冲投资风险或无风险套利为主目的。基金在有效进行风险管理的前提下,通过对对冲的证券研究,结合衍生工具定价模型和衍生工具的价值或风险对冲比例,谨慎投资。
业绩比较基准	80%×中信标普全债指数收益率+20%×一年期银行定期存款税后收益率
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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
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额总额	37,499,117.39份 26,677,892.39份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)
1.本期已实现收益	532,682.39
2.本期利润	906,020.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	36,978,505.26
5.期末基金份额净值	0.986

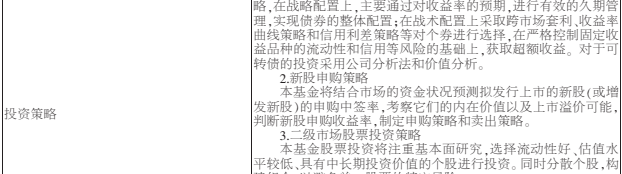
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2 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

阶段	净值增长率①	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
2012年第2季度	2.49%	0.27%	1.76%	0.03%	0.73%	0.24%

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: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。

业绩比较基准	80%×中债综合全价指数收益率+20%×一年期银行定期存款利率	
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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金	
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	
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

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。

# 信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)

## 2012 第二季度报告

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7月19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7月16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。

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4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	信诚深度价值股票(LOF)(场内简称:信诚深度)
基金代码	165808
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2010年7月30日
报告期末基金份额总额	192,654,528.48份
投资目标	通过对公司基本面的研究,深入挖掘股票价值被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争取得资本的长期增值。
投资策略	本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不同市场的中短期变化而改变。本基金的核心理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。本基金的投资选择以“自下而上”为主,但同时也将结合行业研究分析来辅助“自下而上”的行业选择。在不同的市场条件下,本基金允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%×上证180指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型股票基金,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
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)
1.本期已实现收益	1,769,962.27
2.本期利润	15,392,288.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0715
4.期末基金资产净值	166,650,933.48
5.期末基金份额净值	0.865

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《信诚深度价值股票型证券投资基金基金合同》、《信诚深度价值股票型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。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(1.23)》,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,确保不同基金在一级、二级市场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的交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析  
今年以来,经济增长延续放缓趋势,投资、出口回落幅度较大,消费增长略有回落,物价呈下行态势。美国宽松的货币政策刺激就业改善,居民收入和消费信心平稳增长,受此诸多因素推动,消费增长较快,但是核心资本支出增长缓慢,显示美国经济增长后劲不足。欧元区经济不堪债务负担,趋于削减债务和赤字压力而推行的财政紧缩措施必进一步抑制经济增长,欧元区经济增长走在衰退的边缘。投资方面,企业综合盈利预期仍然较高,融资渠道不断,期望投资增长。上半年,物价持续下行,6月份已降到2.2%的低水平。当前货币政策稳健增长的力度大,央行对货币政策进行调整预期,6、7月央行连续两次降息,一年期贷款利率预计降幅50BP,下调法定存款准备金率下调两次至20.0%,但仍居高位。上半年,货币流通速度减慢明显,广义货币增长仍然较高,5月末M2同比增长13.2%,仍低于14%的目标水平。由于经济增速放缓,二季度货币市场呈震荡走势。债市收益率率下行,10年期中长期利率18个基点至3.32%,公司债券信用利差继续扩大,中债标普全债指数上涨1.98%。

二季度,本基金在权益投资方面,重点配置公司业绩,组合久期维持在接近基准的水平,并加入杠杆,增强收益。减持了全部权益投资,规避了权益市场调整的风险。

展望下半年,国内经济受外需下滑和结构调整因素影响,经济增速难以明显回升。物价方面,二季度物价仍将维持下行态势,四季度小幅回升,总体维持低位水平。预计央行仍将继续对货币政策进行调整,降息空间仍然较大。因此,市场利率将维持下行态势,信用债投资收益较为突出。

4.5报告期内基金的投资组合报告  
二季度本基金比较基准收益率为1.76%,本基金A、B份额净值分别增长2.49%和2.30%,分别超越基准0.73%和0.54%。

§ 5 投资组合报告			
5.1 报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	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	140,338,969.84	89.59
其中:债券	140,338,969.84	89.59	
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,896,585.39	7.59
6	其他资产	4,410,214.65	2.82
7	合计	156,645,769.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
5.2.1 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)	占基金资产净值比例(%)
1	002342	科伦药业	1,965,790	91,723,761.40	4.94
2	600519	贵州茅台	372,673	89,124,747.95	4.80
3	600383	金地集团	12,961,666	83,991,595.68	4.53
4	806012	老凤祥	3,231,450	83,209,837.50	4.48
5	002304	沙河股份	604,995	81,402,077.25	4.39
6	600256	广汇能源	4,937,945	66,514,119.15	3.58
7	600048	保利地产	5,805,372	65,832,918.48	3.55
8	000568	泸州老窖	1,531,868	64,813,335.08	3.49
9	600031	三一重工	3,706,866	51,599,574.72	2.78
10	002444	巨星科技	5,382,571	46,011,193.41	2.48

注:本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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,或在报告编制日前一年

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,025,597.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	40,443,984.56
4	其中:政策性金融债	445,778.37
5	应收利息	2,131,996.09
6	应收申购款	441,474.02
7	其他应收款	-
8	其他	-
9	合计	44,488,830.04

5.8.4 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  
本基金本报告期末未持有受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文本描述部分。  
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

项目	信诚三得益债券A	信诚三得益债券B
报告期初基金份额总额	38,527,600.20	31,366,958.68
报告期间基金份额申购份额	72,020.56	131,507.18
减:报告期间基金份额赎回份额	1,100,503.37	4,820,573.47
报告期间基金份额净变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期末基金份额总额	37,499,117.39	26,677,892.39

7.1 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. 信诚基金管理有限公司营业执照、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址——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内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.citicpfunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司  
2012年7月19日

# 信诚三得益债券型证券投资基金

## 2012 第二季度报告

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7月19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7月16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。

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4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	信诚三得益债券
基金代码	550004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月12日
报告期末基金份额总额	64,177,009.78份
投资目标	本基金在保证基金资产的较高流动性和稳定性基础上,严格控制风险,同时通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.债券类资产的投资策略 本基金采取自上而下、积极管理和控制风险的投资策略,在战略配置上,主要通过对收益率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体配置;在战术配置上采取跨市场套利,收益来源由利率预期和信用利差策略等两个标准进行选择,在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上,获取超额收益。对于可转换的投资采用公司分析法和价值分析。 2.新股申购策略 本基金结合市场的资金状况预期和发行上市的新股(或增发新股)的申购中签率,考察它们的内在价值以及上市溢价可能,判断新股申购收益,制定申购策略和卖出策略。 3.二级市场投资策略 本基金股票投资注重基本面研究,选择流动性好,估值水平较低,具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股,构建组合,以分散单一股票的投资风险。 4.衍生品金融工具投资策略 本基金对衍生金融工具的投资主要用于对冲投资风险或无风险套利为主目的。基金在有效进行风险管理的前提下,通过对对冲的证券研究,结合衍生工具定价模型和衍生工具的价值或风险对冲比例,谨慎投资。
业绩比较基准	80%×中信标普全债指数收益率+20%×一年期银行定期存款税后收益率
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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
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额总额	37,499,117.39份 26,677,892.39份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)
1.本期已实现收益	532,682.39
2.本期利润	906,020.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	36,978,505.26
5.期末基金份额净值	0.986

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。

3.2 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

阶段	净值增长率①	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
2012年第2季度	2.49%	0.27%	1.76%	0.03%	0.73%	0.24%

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: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。