信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书(摘要)

(2012年第2次更新)

重要提示

本基金于2011年2月11日基金合同正式生效。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2012年8月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:信诚基金管理有限公司

住所: 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

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

法定代表人:张翔燕

成立日期: 2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号

注册资本: 2亿元人民币

电话: (021)6864 9788

联系人: 隋晓炜

股权结构:

股 东	出资额(万元人民币)	出资比例(%)
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合 计	20000	100

(二)主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事基本情况

张翔燕女士,董事长,硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理,中信证券股份有限公司副总经济师,中信控股有限责任公司风险管理部总经理。现任中信控股有限责任公司副总裁。

马春光先生,董事,研究生。历任中信公司业务部会计、中信兴业信托投资公司财务经理、总会计师等职。2002年10月起担任中信信托有限责任公司副总经理。

陈一松先生,董事,金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司总经理。

Graham David Mason先生,董事,南非籍,保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非Norwich公司基金经理、英国保诚集团(南非)执行总裁。现任瀚亚投资执行总裁。

叶小琪女士,董事,中国香港籍,高级工商管理硕士。历任汇丰投资管理有限公司副总监、保德信集团亚洲资产管理亚洲区区域总监、法国兴业资产管理(香港)有限公司首席市场总监、法国兴业证券董事总经理。现任瀚亚投资亚洲区零售业务总监。

郑美美女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任新加坡金融管理局金融市场发展规划部处长。现任瀚亚投资(新加坡)有限公司督察长。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国科学研究院财贸所处长、研究员等职。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

夏执东先生,独立董事,经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华中兴会计师事务所首席合伙人。现任北京京都天华会计师事务所有限责任公司副董事长。

杨思群先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员,现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

李莹女士,监事会主席,金融学硕士。历任中国建设银行沧浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州创业投资集团有限公司财务总监。

解晓然女士,监事,双学位,历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

詹朋先生,职工监事,经济学学士。历任上海证券有限责任公司计划财务部主管、万家基金管理有限公司基金会计。现任信诚基金管理有限公司运营总监。

注:原"英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务"自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资,其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.经营管理层人员情况

王俊锋先生,总经理、首席执行官,工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理(香港)有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

隋晓炜先生,副总经理,经济学硕士,注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场总监。现任信诚基金管理公司副总经理。

黄小坚先生,副总经理、首席投资官、股票投资总监,经济学硕士。历任申银万国证券公司研究所行业分析师,银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理、基金经理,华宝兴业基金管理有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官、股票投资总监、信诚优胜精选股票型证券投资基金基金经理。

桂思毅先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员,中乔智威汤逊广告有限公司财务主管,德国德累斯登银行上海分行财务经理,信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席运营官。

3.督察长

唐世春先生,督察长,法学硕士,历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书。现任信诚基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

吴雅楠先生,统计物理学博士,CFA,历任加拿大Greydanus, Boeckh & Associates公司交易员/编程员、加拿大道明资产管理公司(TD Asset Management)副总裁/高级投资经理。现任信诚基金管理有限公司投资管理部数量分析总监。

5.投资决策委员会成员

黄小坚先生,副总经理/首席投资官/股票投资总监;

王旭巍先生,固定收益总监;

董越先生,交易总监;

胡喆女士,研究总监;

刘浩先生,股票投资副总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹 东

联系电话:(010)6759 5003

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日,中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2011年,中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度"中国最佳托管银行";并获和讯网2011年中国"最佳资产托管银行"奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所: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

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

法定代表人:张翔燕

电话: (021)6864 9788

联系人:殷宇飞

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.citicprufunds.com.cn.

2、代销机构

1)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心

法定代表人:王洪章

客服电话:95533

公司网站:www.ccb.com

2)中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

客户服务电话:95599

网址: www.95599.cn

3)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:田国立

客服电话:95558

联系人:丰靖

网址:http://bank.ecitic.com

4)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:傅育宁

电话:0755-83198888

传真:0755-83195049

联系人:邓炯鹏

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

5)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

6)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市江东区中山东路294号

办公地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

客户服务统一咨询电话:96528,上海地区:962528

网址: www.nbcb.com.cn

联系人:胡技勋

联系方式:021-63586210

传真:021-63586215

7)华夏银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:马旭

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

8)东莞银行股份有限公司

注册地址:广东东莞运河东一路193号

办公地址:广东东莞运河东一路193号

法定代表人:廖玉林

联系人:胡昱

电话:0769-22119061

传真:0769-22117730

统一客户服务电话:0769-96228

公司网站:www.dongguanbank.cn

9)中国银行股份有限公司

注册地址:北京西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

客服电话:95566

传真:010-66594946

电话:010-66594977

网址:www.boc.cn

10)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-84863893

传真:010-84865560

网址:www.ecitic.com

11)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

联系人:权唐

联系电话:(010)85130588

开放式基金咨询电话:4008888108

网址:www.csc108.com

12)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人:刘军

开放式基金咨询电话:0571-96598

开放式基金业务传真:0571-85783771

联系人:俞会亮

网址:www.bigsun.com.cn

13)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

联系人:吴忠超

联系电话:0532-85022326

14)中国中投证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层

办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人:杨明辉

统一客户服务电话:400-600-8008

公司网站:www.cjis.cn

15)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林生迎

电话:(0755)82960223

传真:(0755)82943636

网址:www.newone.com.cn

客服电话:95565、4008888111

16)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人:何如

联系电话:0755-82130833

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

全国统一客户服务电话:95536

公司网址: www.guosen.com.cn

17)海通证券股份有限公司

地址:上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人:王开国

客户服务电话:021-95553或4008888001

联系人:李笑鸣

网址:www.htsec.com

18)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

联系人:邓寒冰

联系电话:021-54033888

传真:021-54035333

客服电话:021-962505

网址:www.sywg.com.cn

19)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

办公地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人:顾伟国

联系人:田薇

联系电话:010-66568047

客户服务电话:4008-888-888

网站:www.chinastock.com.cn

20)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:祝幼一

联系人:芮敏祺

电话:021-62580818-213

客户服务热线:4008888666

21)广发证券股份有限公司

法定代表人:孙树明

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

公司网站:广发证券网http://www.gf.com.cn

22)华福证券有限责任公司

注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

联系电话:0591-87383623

业务传真:0591-87383610

统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。

公司网址:www.hfzq.com.cn

23)西藏同信证券股份有限公司

注册地址:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄24号

法定代表人:贾绍君

统一客户服务电话:4008811177

24)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号(200040)

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨、李芳芳

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客户服务电话: 4008888788、10108998

公司网址: www.ebscn.com

25)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82825551

客服电话:4008001001

公司网站:www.essence.com.cn

26)齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经七路86号

办公地址:山东省济南市经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-81283938

传真:0531-81283900

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

27)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务热线:95579或4008-888-999

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

28)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

联系人:吴宇

联系电话:021-63325888

客服电话:95503

公司网站:www.dfzq.com.cn

29)平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)

法定代表人:杨宇翔

全国免费业务咨询电话:4008816168

开放式基金业务传真:0755-82400862

全国统一总机:4008866338

联系人:周璐 (zhoulu002@pingan.com.cn,0755-22626172)

网址: www.pingan.com

30)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客服电话:95597

31)天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

客服电话: 010-66045678

联系人:林爽

联系电话:010-66045608

传真: 010-66045500

天相投顾网址: http://www.txsec.com

天相基金网网址:http://jijin.txsec.com

32)信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

33)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

34)红塔证券股份有限责任公司

注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

传 真:0871-3578827

客服电话:0871-3577930

网址:www.hongtastock.com

35)世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层

法定代表人:卢长才

电话:0755-83199599

传真:0755-83199545

网址:www.csco.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

2.场内发售机构:深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位,具体名单见本基金份额发售公告。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27 号投资广场23 层

法定代表人:金颖

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

联系电话:010-66210988

传真:010-66210938

联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

联系电话: (021)31358666

传真: (021)31358600

联系人:安冬

经办律师:吕红、安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称: 毕马威华振会计师事务所

住所: 北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人:萧伟强

电话:8621 2212 2888

传真:8621 6288 1889

联系人: 王国蓓

经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

四、基金的名称

信诚中证500指数分级证券投资基金

五、基金的类型

契约型、上市开放式

六、基金份额分级

(一)基金份额结构

本基金的基金份额包括"信诚中证500份额"、"信诚中证500 A份额"与"信诚中证500 B份额"。其中,信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。

(二)基金的基本运作概要

1.本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为信诚中证500份额;场内认购的全部份额将按4:6的比例确认为信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额。(具体认购方法参见发售公告)

2.本基金合同生效后,信诚中证500份额接受场外与场内申购和赎回;信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额只上市交易,不接受申购和赎回。

3.本基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理信诚中证500份额与信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额之间的份额配对转换业务。

4.本基金合同生效后,基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额配比不变。

(三)信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额概要

1.存续期限

自基金合同生效之日起存续。

2.基金份额配比

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。

3.信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额具有不同的净值计算规则,即信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的风险和收益特征不同。

在本基金的存续期内,本基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额分别进行基金份额净值计算。

本基金净资产优先分配信诚中证500 A份额的本金及信诚中证500 A份额的约定收益,本基金在优先分配信诚中证500 A份额的本金及信诚中证500 A份额的约定收益后的剩余净资产分配予信诚中证500 B份额。

信诚中证500 A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率(税后)加上3.2%。其中计算信诚中证500 A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率是指基金合同生效日或生效后每个运作周年的最后一个工作日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

信诚中证500 A份额的约定年收益率除以运作周年实际天数得到信诚中证500 A份额的约定日收益率。信诚中证500 A份额的基金份额净值以1.000元为基础,采用信诚中证500 A份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。其中,运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间,运作周年实际天数为该期间内的实际天数。信诚中证500 A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

基金管理人并不承诺或保证信诚中证500 A份额的约定收益,如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下,信诚中证500 A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

(1)信诚中证500份额的基金份额净值计算公式

T日信诚中证500份额的基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金(包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额)的基金份额余额总数

(2)信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算公式

假设T日为基金份额净值计算日,t=min(自基金合同生效日至T日,自最近一个份额折算日次日至T日),NAV500 t为T日信诚中证500份额的基金份额净值,NAVA t为T日信诚中证500 A份额的基金份额净值,NAVB t为T日信诚中证500 B份额的基金份额净值,R年为信诚中证500 A份额的约定年收益率。

NAVA t=1+R年× [illegible]

NAVB t= (NAV500 t−0.4×NAVA t)/0.6

信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。

(3)信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值公告

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的基金份额净值在当天收市后计算,并在下一日内与信诚中证500份额的基金份额净值一同公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

4.信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过,信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的2/3以上(含2/3)通过方为有效。

七、份额配对转换

本基金合同生效后,基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

(一)份额配对转换是指本基金的信诚中证500份额与信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

1.分拆。基金份额持有人将其持有的每十份信诚中证500份额的场内份额申请转换成四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额的行为。

2.合并。基金份额持有人将其持有的每四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额进行配对申请转换成十份信诚中证500份额的场内份额的行为。

(二)份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构,并予以公告。

(三)份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自基金合同生效后不超过6个月的时间内开始办理,基金管理人将在开始办理份额配对转换前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日(基金管理人公告暂停份额配对转换时除外),具体业务办理时间见招募说明书,在招募说明书规定的上述时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间、交易规则或注册登记机构规则更改或实际情况需要,基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

(四)份额配对转换的原则

1.份额配对转换以份额申请。

2.申请进行"分拆"的信诚中证500份额的场内份额必须是10的整数倍。

3.申请进行"合并"的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额必须同时配对申请,且基金份额数必须同为整数且两者的比例为4:6。

4.信诚中证500份额的场外份额如需申请进行"分拆",须跨系统转登记为信诚中证500份额的场内份额后方可进行。

5.份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整,并在正式实施前2日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

(五)份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则,具体见相关业务公告。

(六)暂停份额配对转换的情形

1. 基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益时决定暂停份额配对转换的情形。

2. 其他基金管理人出于保护投资人利益的角度,决定暂停份额配对转换的情形。

3.深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务的情形。

4.法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的,基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时,基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理,并依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

(七)份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时,份额配对转换业务办理机构可按照不高于0.3%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用,具体见相关业务公告。

八、基金份额折算

(一)定期份额折算

1.定期份额折算的折算日

每个基金运作周年的最后一个工作日。

运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间。若该运作期间的最后一日为工作日,则定期份额折算日为该日;若该运作期间的最后一日为非工作日,则定期份额折算日为该日之前的最后一个工作日。

2.定期份额折算的折算对象

基金份额定期折算日登记在册的信诚中证500份额和信诚中证500 A份额,信诚中证500 B份额不参与定期折算,除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

3.定期份额折算的折算频率

每年折算一次。

4.定期份额折算的折算方式

定期份额折算后信诚中证500 A份额的基金份额净值调整为1.000元,基金份额折算日折算前信诚中证500 A份额的基金份额净值超出1.000元的部分将折算为信诚中证500份额的场内份额分配给信诚中证500 A份额持有人。信诚中证500份额持有人持有的每十份信诚中证500份额将按四份信诚中证500 A份额获得新增信诚中证500份额的分配,经过上述份额折算后,信诚中证500份额的基金份额净值将相应调整。

1)信诚中证500份额折算

NAV后500=NAV前500−0.4× (NAV前 A−1.000)

信诚中证500份额持有人新增的信诚中证500份额数=0.4×NUM前500× (NAV前 A−1.000)/NAV后500

其中:

NAV前500:定期份额折算前信诚中证500份额的基金份额净值,下同

NAV后500:定期份额折算后信诚中证500份额的基金份额净值,下同

NAV前 A:定期份额折算前信诚中证500 A份额的基金份额净值,下同

NUM前500:定期份额折算前信诚中证500份额的份额数,下同

持有信诚中证500份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚中证500份额的场外份额的分配;持有信诚中证500份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚中证500份额的场内份额的分配。

信诚中证500份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;信诚中证500份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

2)信诚中证500 A份额折算

定期份额折算后信诚中证500 A份额的基金份额净值=1.000元

定期份额折算后信诚中证500 A份额的份额数=定期份额折算前信诚中证500 A份额的份额数

信诚中证500 A份额持有人新增的信诚中证500份额数= [NUM前 A× (NAV前 A−1.000)]/NAV后500

其中:

NUM前 A:定期份额折算前信诚中证500 A份额的份额数,下同

信诚中证500 A份额折算成信诚中证500份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

3)信诚中证500 B份额折算

信诚中证500 B份额不进行份额折算,其基金份额净值和份额数保持不变。

4)折算后信诚中证500份额的总份额数

折算后信诚中证500份额的总份额数=定期份额折算前信诚中证500份额的份额数+信诚中证500份额持有人新增的信诚中证500份额数+信诚中证500 A份额持有人新增的信诚中证500份额数。

5.基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的上市交易和信诚中证500份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6.基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

7.特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时,将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

(二)不定期份额折算

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行份额折算,即:当信诚中证500份额的基金份额净值大于或等于2.000元;当信诚中证500 B份额的基金份额净值小于或等于0.250元。

(1)当信诚中证500份额的基金份额净值大于或等于2.000元时

1.不定期份额折算的折算日

信诚中证500份额的基金份额净值大于或等于2.000元,基金管理人即可确定基金份额折算日。

2.不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额。

3.不定期份额折算的折算频率

不定期。

4.不定期份额折算的折算方式

当信诚中证500份额的基金份额净值大于或等于2.000元时,本基金将在基金份额折算日分别对信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额进行份额折算,份额折算后信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的比例仍保持4:6不变。份额折算后信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的基金份额净值均调整为1.000元,基金份额折算日折算前信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的基金份额净值超出1.000元的部分均将折算为信诚中证500份额分别分配给信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的持有人。

1)信诚中证500份额折算

信诚中证500份额持有人新增的信诚中证500份额数= [NUM前 500× (NAV前 500−1.000)]/1.000

信诚中证500份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;信诚中证500份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

2)信诚中证500 A份额折算

折算后信诚中证500 A份额的份额数保持不变,即:NUM后 A=NUM前 A

信诚中证500 A份额持有人新增的信诚中证500份额数= [NUM前 A× (NAV前 A−1.000)]/1.000

其中,

NUM后 A:折算后信诚中证500 A份额的份额数,下同

信诚中证500 A份额折算成信诚中证500份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

3)信诚中证500 B份额折算

折算后信诚中证500 B份额的份额数保持不变,即:NUM后 B=NUM前 B

信诚中证500 B份额持有人新增的信诚中证500份额数= [NUM前 B× (NAV前 B−1.000)]/1.000

其中,

NUM前 B:折算前信诚中证500 B份额的份额数,下同

NUM后 B:折算后信诚中证500 B份额的份额数,下同

信诚中证500 B份额折算成信诚中证500份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

4)折算后信诚中证500份额的总份额数

折算后信诚中证500份额的总份额数=不定期份额折算前信诚中证500份额的份额数+信诚中证500份额持有人新增的信诚中证500份额数+信诚中证500 A份额持有人新增的信诚中证500份额数+信诚中证500 B份额持有人新增的信诚中证500份额数

5.基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的上市交易和信诚中证500份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6.基金份额折算结果的公告

基金份额实施折算前,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

(2)当信诚中证500 B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时

1.不定期份额折算的折算日

信诚中证500 B份额的基金份额净值小于或等于0.250元,基金管理人即可确定基金份额折算日。

2.不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额。

3.不定期份额折算的折算频率

不定期。

4.不定期份额折算的折算方式

当信诚中证500 B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,本基金将在基金份额折算日分别对信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额进行份额折算,份额折算后信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的比例仍保持4:6不变。份额折算后信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的基金份额净值均调整为1.000元,信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的份额数将得到相应的缩减。

1)信诚中证500份额折算

[illegible]

信诚中证500份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;信诚中证500份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

2)信诚中证500 A份额折算

[illegible]

4)折算后信诚中证500份额的总份额数

折算后信诚中证500份额的总份额数=不定期份额折算后信诚中证500份额的份额数+信诚中证500 A份额持有人新增的信诚中证500份额数

5.基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的上市交易和信诚中证500份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6.基金份额折算结果的公告

基金份额实施折算前,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

九、基金的投资目标

本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证500指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证500指数的有效工具。

十、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证500指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

十一、投资策略

本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证500 指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,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%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:

(1)基本面替代:按照与被替代股票所属行业,基本面及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库;

(2)相关性检验:计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中替代股票的权重,并构建替代股组合。

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,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

十二、标的指数与业绩比较基准

(一)标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证500指数。

(二)业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率。

十三、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,信诚中证500 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;信诚中证500 B份额具有高风险、高预期收益的特征。

十四、基金投资组合报告(未经审计)

本投资组合报告的财务数据截止至2012年6月30日。

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	805,224,942.14	91.59
	其中:股票	805,224,942.14	91.59
2	固定收益投资	45,285,693.70	5.15
	其中:债券	45,285,693.70	5.15
	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	10,142,297.95	1.15
6	其他资产	18,504,517.00	2.10
7	合计	879,157,450.79	100.00

注: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。

股指期货投资明细如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF1207	IF1207	1	740,280.00	-21,120.00
总额合计				-21,120.00
减:可抵销期货暂收款				-21,120.00
股指期货投资净额				0.00

买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,281,074.93	0.84
B	采掘业	9,219,438.58	1.06
C	制造业	433,732,854.92	49.96
C0	食品、饮料	46,088,091.80	5.31
C1	纺织、服装、皮毛	19,929,441.65	2.30
C2	木材、家具	1,066,572.36	0.12
C3	造纸、印刷	19,260,341.31	2.22
C4	石油、化学、塑胶、塑料	81,584,537.38	9.40
C5	电子	43,327,633.76	4.99
C6	金属、非金属	51,983,458.14	5.99
C7	机械、设备、仪表	112,385,278.24	12.95
C8	医药、生物制品	51,330,169.32	5.91
C99	其他制造业	6,777,330.96	0.78
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,741,533.84	3.43
E	建筑业	18,629,046.36	2.15
F	交通运输、仓储业	34,967,981.06	4.03
G	信息技术业	44,368,519.06	5.11
H	批发和零售贸易	41,391,428.53	4.77
I	金融、保险业	3,811,467.63	0.44
J	房地产业	59,315,326.03	6.83
K	社会服务业	20,346,337.64	2.34
L	传播与文化产业	25,124,986.27	2.89
M	综合类	26,226,244.95	3.02
	合计	754,156,239.80	86.87

2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	29,880,703.93	3.44
C0	食品、饮料	6,141,354.32	0.71
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,337,867.00	0.27
C5	电子	2,147,538.00	0.25
C6	金属、非金属	1,589,728.60	0.18
C7	机械、设备、仪表	9,703,191.96	1.12
C8	医药、生物制品	7,082,524.05	0.82
C99	其他制造业	878,500.00	0.10
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,974,709.36	0.46
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	476,230.70	0.05
G	信息技术业	1,324,037.00	0.15
H	批发和零售贸易	1,799,337.44	0.21
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	2,895,258.25	0.33
K	社会服务业	3,838,504.08	0.44
L	传播与文化产业	2,025,268.72	0.23
M	综合类	4,854,652.86	0.56
	合计	51,068,702.34	5.88

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

3.1报告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

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	600073	上海梅林	801,285	5,697,136.35	0.66
2	002461	珠江啤酒	502,522	5,678,498.60	0.65
3	600820	隧道股份	635,931	5,659,785.90	0.65
4	000799	酒 鬼 酒	107,100	5,612,040.00	0.65
5	600570	恒生电子	399,714	5,484,076.08	0.63
6	000767	*ST漳电	1,467,512	5,459,144.64	0.63
7	002393	力生制药	172,733	5,366,814.31	0.62
8	600747	大连控股	1,094,922	5,113,285.74	0.59
9	002223	鱼跃医疗	341,588	5,072,581.80	0.58
10	000759	中百集团	677,508	5,040,659.52	0.58

3.2 报告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

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	600635	大众公用	1,041,771	4,854,652.86	0.56
2	600200	江苏吴中	442,600	4,054,216.00	0.47
3	600008	首创股份	812,824	3,974,709.36	0.46
4	000415	渤海租赁	502,422	3,838,504.08	0.44
5	002311	海大集团	176,244	3,147,717.84	0.36

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,050,000.00	0.58
2	央行票据	38,764,000.00	4.47
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	1,471,693.70	0.17
8	其他	-	-
9	合计	45,285,693.70	5.22

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101088	11央行票据88	400,000	38,764,000.00	4.47
2	019202	12国债02	50,000	5,050,000.00	0.58
3	110015	石化转债	9,750	974,122.50	0.11
4	125887	中鼎转债	4,480	497,571.20	0.06
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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

8. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	751,942.21
2	应收证券清算款	7,751,421.47
3	应收股利	2,889.00
4	应收利息	907,333.09
5	应收申购款	9,090,931.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,504,517.00

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	974,122.50	0.11
2	125887	中鼎转债	497,571.20	0.06

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(5.1)报告期末指数投资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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000767	*ST漳电	5,459,144.64	0.63	重大资产重组

(5.2)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(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尾差。

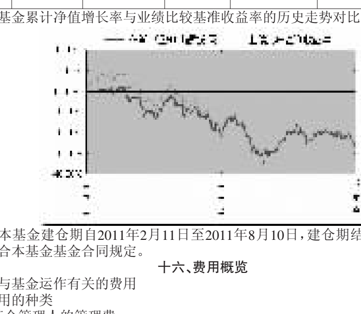
十五、基金的业绩

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招募说明书。基金业绩数据截至2012年6月30日。

(一)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2011年2月11日至2011年12月31日	-30.00%	1.29%	-29.59%	1.41%	-0.41%	-0.12%
2012年1月1日至2012年6月30日	6.54%	1.49%	6.03%	1.53%	0.51%	-0.04%
2011年2月11日至2012年6月30日	-25.42%	1.37%	-25.35%	1.46%	-0.07%	-0.09%

(二)基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金建仓期自2011年2月11日至2011年8月10日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十六、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金财产拨划支付的银行费用;

(4)基金合同生效后的基金信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(7)基金的证券交易费用;

(8)基金上市初费和上市月费;

(9)账户开户费和账户维护费;

(10)基金合同生效后的标的指数许可使用费;

(11)依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

(3)基金合同生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费,标的指数许可使用基点费的计费时间从基金合同生效日开始计算;标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年,标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元(即不足5万元部分按照5万元收取)。

在通常情况下,标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算,逐日累计。

计算方法如下:

收取下限的日均摊销数额=5万/季度＊4季度/年÷当年天数(365天或366天)≈550元/天

H=Max(E×0.02%/当年天数,550)

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费,E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次,自基金合同生效日起,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后,于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

(4)除管理费、托管费、标的指数许可使用费和前述所列之外的基金费用,由基金托管人与基金管理人协商后,根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、信诚中证500份额的场外申购费率如下:

单笔申购金额	场外申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<200万	0.8%
200万≤M<500万	0.4%
M≥500万	1000元/笔

(注:M:申购金额;单位:元)

信诚中证500份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

2.信诚中证500份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减,场外赎回的实际执行的费率如下:

持有时间	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

(注:Y:持有时间,其中1年为365日,2年为730日)

信诚中证500份额的场内赎回费率为固定值0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。

从场内转托管至场外的信诚中证500份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

3. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低信诚中证500份额的申购费率和赎回费率。

4.基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前2日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

十七、对招募说明书更新部分的说明

1、在"重要提示"部分更新了相应日期。

2、在"第三部分 基金管理人"中的"二、主要人员情况"部分,更新了董事会成员的相关内容。

3、在"第五部分 相关服务机构"部分,根据实际情况对代销机构及注册登记机构的相关信息进行了更新。

4、在"第十三部分 基金的投资"部分,更新了"基金投资组合报告",本基金投资组合报告的财务数据截止至2012年6月30日。

5、更新了"第十四部分 基金的业绩",数据截止至2012年6月30日。

6、在"第二十三部分 风险揭示"部分,新增了有关股指期货的风险揭示。

7、在"第二十八部分 其他应披露事项"部分,披露了自2012年2月12日以来涉及本基金的相关公告。

信诚基金管理有限公司