信诚货币市场证券投资基金

【2012】第三季度报告

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10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10月19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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚货币	
基金主代码	550010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年3月23日	
报告期末基金份额总额	2,058,224,165.71份	
投资目标	本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。	
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对货币市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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	信诚货币A	信诚货币B
下属两级基金的交易代码	550010	550011
报告期末下属两级基金的份额总额	386,386,983.78份	1,671,837,181.93份

§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	信诚货币A报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)	信诚货币B报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	5,389,252.67	22,058,711.78
2.本期利润	5,389,252.67	22,058,711.78
3.期末基金资产净值	386,386,983.78	1,671,837,181.93

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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3季度	0.8135%	0.0034%	0.0889%	0.0000%	0.7246%	0.0034%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

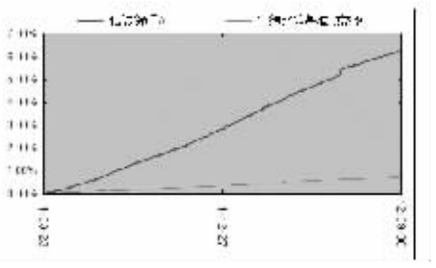
信诚货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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3季度	0.8742%	0.0034%	0.0889%	0.0000%	0.7853%	0.0034%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

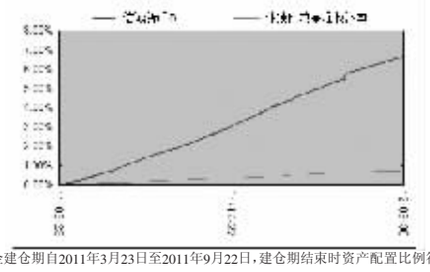
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信诚货币A



注:本基金建仓期自2011年3月23日至2011年9月22日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

信诚货币B



注:本基金建仓期自2011年3月23日至2011年9月22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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾丽琼	本基金基金经理,信诚双盈分级债券基金基金经理	2011年3月23日	-	11	金融学硕士,11年金融、基金从业经验;拥有丰富的债券投资和流动性管理经验;曾任职于杭州银行和华宝兴业基金管理有限公司,历任华宝兴业现金宝货币市场基金和华宝兴业增强收益债券基金的基金经理。2010年7月加入信诚基金管理有限公司,现任信诚货币市场基金及信诚双盈分级债券基金的基金经理。

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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《信诚货币市场证券投资基金基金合同》、《信诚货币市场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

2012年三季度,全球经济、金融市场呈"共振"态势,欧洲经济陷入衰退,欧央行推出OMT计划;美国经济复苏低于预期,QE3推出;新兴经济体增速明显放缓。我国经济整体延续回落,通胀下行。投资、出口、消费、用电量、工业增加值等各项经济指标显示国民经济仍处寻底阶段,实体经济"去库存"及"去产能"化趋势延续。

政策方面,继年中降准、降息等宽松政策密集出台后,三季度货币政策放松的幅度和节奏偏谨慎。从基本面看,虽然经济、通胀如期双降,但同期美欧推出量化宽松政策,大宗商品价格持续上涨,美国大旱推动国际粮食价格大幅飙升,通胀预期重新抬升;国内各地方政府推更多基建计划;发改委审批项目加快。这些均在一定程度上限制了央行在货币政策上进一步放松,市场普遍预期的降准动作不断落空,取而代之是公开市场的逆回购滚动操作。加上外汇占款七月以来持续负增长,市场流动性在三季度呈现"紧平衡"态势。

"防御"及"减杠杆"成为三季度债市主题,收益率重回年内高位。一方面源于通胀预期上升,另一方面则是来自供给层面冲击、市场资金价格居高不下;此外投资人的行为也对市场调整产生影响,这包括投资人的获利了解动作以及从过往经验判断,债券牛市跨越长度没有明显超过一年,时点看,三季度债券市场有调整需要。

信诚货币基金本季延续前期策略,组合平均剩余期限接近上限;债券仓位30%-40%左右,以中等资质AA-CP为主;存款比例 40%-60%区间波动,其余以流动性较好的逆回购品种为主。同时组合配置强调月末、季末现金流回归,保证组合具备良好流动性,应对季末等关键时点的集中赎回,也能获取良好收益。

展望后市,换届主题贯穿全年,下届政府对经济转型的态度、投资的力度令债券投资面临一定不确定性。但随着本季收益率进一步调整到位,四季度预计会有资金入场为明年全年布局,我们将密切跟踪市场动态,并积极参与可能的交易性机会。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金比较基准收益率为0.0889%,本基金A、B份额净值收益率分别为0.8135%和0.8742%,分别领先基准0.7246%和0.7853%。

§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	固定收益投资	1,005,077,354.63	44.85
	其中:债券	1,005,077,354.63	44.85
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	68,600,222.90	3.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,104,563,630.48	49.29
4	其他资产	62,674,991.06	2.80
5	合计	2,240,916,199.07	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.79
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	154,599,368.10	7.51
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

注:本基金合同约定,本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在120天以内,以规避较长期限债券的利率风险。本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	23.47	7.51
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	42.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.96	-
5	180天(含)—397天(含)	22.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.82	7.51

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,657,009.57	0.96
5	企业短期融资券	985,420,345.06	47.88
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,005,077,354.63	48.83
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,657,009.57	0.96

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041253007	12深茂业CP001	700,000	70,534,188.89	3.43
2	011219002	12国电SCP002	500,000	49,975,397.96	2.43
3	041158028	11人福CP002	400,000	40,466,516.39	1.97
4	041265005	12沁和集CP001	400,000	40,425,462.89	1.96
5	041252005	12西王CP001	400,000	40,411,788.41	1.96
6	041156010	11国开投CP001	400,000	40,139,159.23	1.95
7	041260031	12广田CP001	400,000	40,011,005.96	1.94
8	041254007	12中天CP001	300,000	30,429,087.17	1.48
9	041253011	12步步高CP001	300,000	30,427,380.71	1.48
10	041152009	11杭州湾CP001	300,000	30,172,945.94	1.47

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	1次
报告期内偏离度的最高值	0.3195%
报告期内偏离度的最低值	0.1282%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1571%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	33,420,668.63
4	应收申购款	29,254,322.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	62,674,991.06

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚货币A	信诚货币B
报告期期初基金份额总额	266,081,337.56	1,571,740,517.48
报告期期间基金总申购份额	1,569,918,041.18	3,331,321,268.63
报告期期间基金总赎回份额	1,449,612,394.96	3,231,224,604.18
报告期期末基金份额总额	386,386,983.78	1,671,837,181.93

注:总申购份额含红利再投、份额强增和转换入份额;总赎回份额含份额强减、转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、信诚货币市场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、信诚货币市场证券投资基金基金合同
4、信诚货币市场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

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。

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.citieprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚沪深300指数分级证券投资基金

【2012】第三季度报告

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10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10月19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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	225,871,012.41份
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。
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
下属三级基金的基金简称	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)
下属三级基金的交易代码	150051 / 150052 / 165515
报告期末下属三级基金的份额总额	62,652,605.00份 / 62,652,606.00份 / 100,565,801.41份
下属三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 / 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

§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	报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-14,200,290.29
2.本期利润	-12,621,388.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0614
4.期末基金资产净值	203,244,936.86
5.期末基金份额净值	0.900

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。

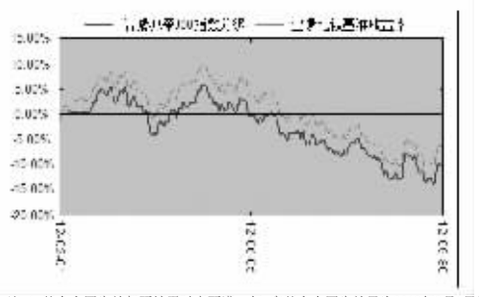
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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3季度	-6.54%	1.17%	-6.49%	1.13%	-0.05%	0.04%

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2月1日)。

2、本基金建仓日自2012年2月1日至2012年8月1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		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	-	16	统计物理学博士,CFA,16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

2012年第三季度,海外发达市场与国内A股市场走势分化。美国工业生产重拾动力,住房市场趋稳,失业率下滑,欧洲GDP则继续收缩。欧洲、美国、日本等央行联手推出货币宽松政策。欧洲央行祭出"直接货币政策"(OMT),美联储宣布开放式QE3,并将低利率环境推迟,日本央行也决定增加资产购买方案(APP),共同向全球资本市场注入流动性。海外发达国家市场风险偏好改善,纷纷创新高。

国内实体经济终端需求疲软,工业增加值进一步滑落,PPI延续下滑,PMI持续在荣枯线以下,经济仍呈下行态势。CPI见底回升,政策对通胀走势仍持谨慎。央行在本季度降息,以期降低企业融资成本,采取逆回购释放流动性,然而市场对实体经济何时筑底企稳仍趋担忧。发改委集中批复万亿基础建设后,市场虽受政策刺激回暖,但是相当短促,随后市场对国内政策相比海外政策出台滞后、"十八大"人事仍未明朗、周边政治军事冲突等不确定综合因素影响下表现失望,投资者信心大受打击,市场持续走低,上证综指在季末试探2000点低位。本期沪深300指数下跌6.85%,中证500指数下跌7.81%。

在本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,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。

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。

4.5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-6.54%,同期比较基准收益率为-6.49%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.15%之内,年化跟踪误差为1.9%。

§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	191,764,675.74	91.39
	其中:股票	191,764,675.74	91.39
2	固定收益投资	9,022,500.00	4.30
	其中:债券	9,022,500.00	4.30
	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	6,539,662.66	3.12
6	其他衍生工具	-	-
7	其他资产	2,503,287.74	1.19
8	合计	209,830,126.14	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
IF1210	IF1210	2	1,381,800.00	26,760.00
总额合计				26,760.00
减:可抵销期货暂收款				26,760.00
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。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,361,743.99	1.16
B	采掘业	21,099,051.29	10.38
C	制造业	66,846,545.23	32.89
C0	食品、饮料	14,740,284.26	7.25
C1	纺织、服装、皮毛	1,078,896.55	0.53
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,262,266.30	2.10
C5	电子	4,362,777.81	2.15
C6	金属、非金属	13,595,288.46	6.69
C7	机械、设备、仪表	18,187,713.92	8.95
C8	医药、生物制品	10,046,517.93	4.94
C99	其他制造业	572,800.00	0.28
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,970,557.08	2.45
E	建筑业	7,663,787.75	3.77
F	交通运输、仓储业	4,967,582.55	2.44
G	信息技术业	5,365,930.67	2.64
H	批发和零售贸易	5,283,048.37	2.60
I	金融、保险业	58,575,192.91	28.82
J	房地产业	8,146,471.21	4.01
K	社会服务业	1,684,241.48	0.83
L	传播与文化产业	686,525.28	0.34
M	综合类	4,113,997.93	2.02
	合计	191,764,675.74	94.35

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期未未持有积极投资的股票。

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股票投资明细

5.3.1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

代码	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	600016	民生银行	1,035,783	5,852,173.95	2.88
2	601318	中国平安	132,280	5,547,823.20	2.73
3	600036	招商银行	488,142	4,959,522.72	2.44
4	601328	交通银行	1,115,030	4,750,027.80	2.34
5	600000	浦发银行	506,184	3,735,637.92	1.84
6	601166	兴业银行	306,797	3,684,631.97	1.81
7	600519	贵州茅台	14,464	3,555,251.20	1.75
8	600030	中信证券	288,815	3,405,128.85	1.68
9	000002	万 科A	395,204	3,331,569.72	1.64
10	601288	农业银行	1,260,120	3,099,895.20	1.53

5.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 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	9,022,500.00	4.44
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,022,500.00	4.44

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

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	019202	12国债02	90,000	9,022,500.00	4.44

注:本基金本报告期末仅持有上述1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。

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	237,971.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	29,061.11
4	应收利息	167,154.59
5	应收申购款	2,044,586.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	24,513.58
8	其他	-
9	合计	2,503,287.74

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

5.8.5.1 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

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。

5.8.5.2 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。

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: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)
报告期期初基金份额总额	60,622,253.00	60,622,254.00	75,387,909.55
报告期期间基金总申购份额	-	-	71,843,259.45
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	42,604,663.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	2,030,352.00	2,030,352.00	-4,060,704.00
报告期期末基金份额总额	62,652,605.00	62,652,606.00	100,565,801.41

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、信诚沪深300指数分级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、信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同
4、信诚沪深300指数分级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

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。

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.citieprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

中海增强收益债券型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海增强收益债券
基金主代码	395011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23日
报告期末基金份额总额	344,412,360.88份
投资目标	在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定收益。
投资策略	1、一级资产配置 本基金采取自上而下的分析方法,比较不同市场和金融工具的收益及风险特征,动态确定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。 2、纯债投资策略 (1)久期配置:基于宏观经济周期的变化趋势,预测利率变动的方向。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,确定投资组合的久期配置。 (2)期限结构配置:采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。 (3)债券类别配置/个券选择:个券选择遵循的原则