信诚中证500指数分级证券投资基金

【2014】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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月27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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚中证500指数分级		
场内简称	信诚500		
基金主代码	165511		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年2月11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		
报告期末基金份额总额	1,113,469,123.96份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011年3月14日		
下属分级基金的基金简称	信诚中证500指数分级A	信诚中证500指数分级B	信诚中证500指数分级
下属分级基金的场内简称	中证500A	中证500B	信诚500
下属分级基金的交易代码	150028	150029	165511
报告期末下属分级基金的份额总额	375,623,453.00份	563,435,181.00份	174,410,489.96份

2.2 基金产品说明

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。		
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%。 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资产管理,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%×中证500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。		
下属分级基金的风险收益特征	信诚中证500指数分级A:低风险、收益相对稳定的特征。	信诚中证500指数分级B:高风险、高预期收益的特征。	信诚中证500指数分级: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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	田青
	联系电话	021-68649788	010-67595096
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	251,282,479.60	440,077,581.85	-116,652,535.11
本期利润	398,907,819.10	459,555,706.34	53,481,671.13
加权平均基金份额本期利润	0.2614	0.1351	0.0326
本期基金份额净值增长率	39.66%	17.17%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1261	-0.1713	-0.2931
期末基金资产净值	1,144,789,682.23	1,544,837,186.00	3,133,609,907.59
期末基金份额净值	1.028	0.760	0.673

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.本期已实现收益指期末本期利息收入、投资收益、其他收入不含公允价值变动收益逐日累计至期末可供分配的金额。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本分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

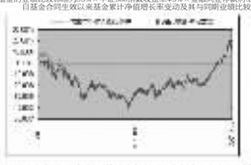
3.2 基金净值表现

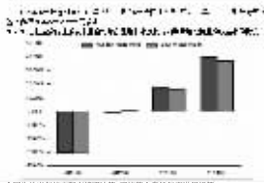
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	9.48%	1.35%	7.88%	1.37%	1.60%	-0.02%
过去六个月	35.98%	1.13%	33.65%	1.16%	2.33%	-0.03%
过去一年	39.66%	1.16%	36.91%	1.18%	2.75%	-0.02%
过去三年	62.73%	1.30%	59.73%	1.34%	3.00%	-0.04%
自基金合同生效起至今	13.91%	1.30%	12.46%	1.36%	1.45%	-0.06%

注:本基金的业绩比较标准为95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同的约定,本基金包括信诚中证500指数分级、信诚中证500指数分级A、信诚中证500指数分级B不进行收益分配。

§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2006年6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,英国保诚集团投份有限公司和中资方面上证国际投资控股有限公司,各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2014年12月31日,本基金管理人共管理32只基金。分别为信诚四季红基金型证券投资基金、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、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金A、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金A、信诚三得益债券型证券投资基金B、信诚典优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LOF、信诚合同四季稳配固定券投资基金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、信诚货币债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业股票型证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚中证500医药指数分级证券投资基金、信诚季季宝期支付债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚月月宝期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费股票型证券投资基金、信诚新金宝货币市场基金、信诚少升理财债券型证券投资基金和信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金。

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		
吴雅楠	本基金基金经理、兼任信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金的基金经理,信诚基金管理有限公司投资管理部量化投资监	2011年2月11日	-	18	统计物理学博士,CFA,18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量化投资总监兼信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金及信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金的基金经理。

注:1.上述任期日期,离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2.证券从业的年限计算口径按照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《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证500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 公平交易制度和执行情况

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据证券投资基金管理公司公平交易制度指引》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度(A "公平交易制度"的"为开展公平交易管理的规则制订,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金,特定客户资产管理组合)。对应的范围包括境内上市股票,债券的一级市场申购,二级市场交易等投资管理活动。

在实现的公平交易管理流程设计中,公司在公平交易制度的原则下,采用事前、事中、事后的三段式控制:事前管理主要包括:明确了合理的资产管理业务及投资决策流程,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,在事后实施了严格的行为监控,分析评价以及投资组合与业绩监测,一旦公司整体公平交易制度执行情况异常,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现单笔交易部分公开竞价同日反向交易或交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的交易(定量交易的除指数基金除外)。

4.4 管理人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

2014年,A股在全球资本潮高涨氛围下,国内经济转轨,IPO重启,"护盘通"、央行定向宽松、降息节奏超外期望,改革信心重建和新增资金任性的联合推动下,展现了大幅跑赢银行间,上下半年A股经历了"两重天",全年实现结构性牛市。

在政府刺激带牛市的背景下,国内经济数据显示,经济下行压力加大,工业增加值、发电量、房地产和固定投资双双失速,只有基建投资在政府刺激带牛市下一枝独秀,地方政府财政支持大幅加速,1-11月全国基建以上工业企业利润同比增长高达49.1%,是全国工业利润增长率的4倍,是全国利润增长率的9倍以及CPI和PPI剪刀差明显扩大,对企业利润改善贡献明显。企业收入与盈利增速分别呈现低位、PPI跌幅扩大、生产资料需求低迷等压力因素,产能过剩问题突出,一季度GDP同比增速创近期新低73%,政府将年中经济增速下调看待经济增长速度,同时强调发展的三个规律:经济规律的科学发展,目然规律的可持续发展和社会规律的包容性发展,给"新常态"的经济发展格局定下基调。上半年的中央政治局会议也为经济改革定下基调。

宏观政策紧松,微观政策坚持,社会政策托底,并且"根据形势变化,适时调整其内涵",提示"托"和"调"将交替进行,规经济形势变化,但是,从微观层面,政策的托底于经济下行的趋势与改革力度加大的力四之间的平衡,令年度市场最担忧的"全面"PPI通缩的政策主线,高于市场定价的降息政策,而深入地方政府扩扩展至股份制商业银行,而央行对银行区改造的再获新,显示货币政策想"定向降准"的"定向宽松"意图,随着外汇市场逐渐减弱,再贷款将在货币创造中发挥更大作用,央行通过PSL抵押补充基础货币发放资金的方式,并最后以定向降准的方式,大幅度定向放水,从宽松政策的角度,央行定向降准,央行再贷款等等,一个"定向"的宽松,实现了"定向"的"宽松"。

在政策的宽松下,市场对于经济下行的担忧逐渐减弱,"全面"PPI通缩的政策主线,高于市场定价的降息政策,而深入地方政府扩扩展至股份制商业银行,而央行对银行区改造的再获新,显示货币政策想"定向降准"的"定向宽松"意图,随着外汇市场逐渐减弱,再贷款将在货币创造中发挥更大作用,央行通过PSL抵押补充基础货币发放资金的方式,并最后以定向降准的方式,大幅度定向放水,从宽松政策的角度,央行定向降准,央行再贷款等等,一个"定向"的宽松,实现了"定向"的"宽松"。

在政策的宽松下,市场对于经济下行的担忧逐渐减弱,"全面"PPI通缩的政策主线,高于市场定价的降息政策,而深入地方政府扩扩展至股份制商业银行,而央行对银行区改造的再获新,显示货币政策想"定向降准"的"定向宽松"意图,随着外汇市场逐渐减弱,再贷款将在货币创造中发挥更大作用,央行通过PSL抵押补充基础货币发放资金的方式,并最后以定向降准的方式,大幅度定向放水,从宽松政策的角度,央行定向降准,央行再贷款等等,一个"定向"的宽松,实现了"定向"的"宽松"。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本年度,本基金份额净值增长率为39.66%,同期比较基准收益率为39.91%。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,各地的年市在2014年初圆满交之后,市场分析在"定向宽松和"微刺激"带来的"稳增长"与加大改革力度等改革红利预热中寻找边际和方向,市场将关注"四中全会"之后的改革政策,如何改变中国的经济周期和经济增长模式,在"新常态"的经济环境下,从微观层面来看,在各种改革政策配合下,从宏观层面来看改革的力度和经济的转型,市场将在政策催化预期中,继续顺势新增资金入市,并将在改革与经济的政策周期和估值修复中构建上升通道。市场将在混合所有制改革,国企改革,金融改革,医疗改革,环保和新经济取互联网等移动改革的"多元"改革"主题的带动下,"沪港通"及MSCI等国际资本流入和改变投资理念的趋势,"牛市的基础,股市的格局"将成为2015年市场的特征。本基金将继续秉承严谨和有纪律的信诚风格及投资策略和风险管理原则,管理信诚中证500指数分级基金,为投资者提供有效的指数回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2014年度内,公司依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,在督察长的指导和监察稽核部的努力下,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1.对公司管理制度体系的不断修订和完善

监察稽核部负责对公司制定的规章制度进行审核和修订,主要包括从业人员投资管理、营销活动管理、合规手册、IT采购管理、专户产品申批管理等方面。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了制约和促进作用。

2.开展各类专项检查工作。

公司内部合规监控方面,公司严格遵守法律法规和公司制度对公司和基金运作的合规情况进行监控,在基金日常投资运作过程中,监察稽核部和风险管理部对基金投资进行了事前、事中和事后的全方位监控,投资风险及时与投资部门沟通。对到期的合规监控方面,严格审核各类宣传推介材料和营销活动行为,确保各项行为的合法合规性。

3.强化合规培训管理,提高合规合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时组织新增的法律法规传递给各相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示,在项工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训,本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4.4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

报告期内,基金投资策略和业绩表现未发生变更。

4.5 管理人对报告期内基金投资收益来源的说明

本基金主要通过股票、债券、现金等资产的合理配置,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的稳定增长。报告期内,本基金日均跟踪误差在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%以内。

4.6 报告期内基金利润构成情况

项目	金额
1.权益投资	1,083,308,964.23
其中:股票投资	1,083,308,964.23
2.固定收益投资	51,492,243.57
其中:债券投资	51,492,243.57
3.资产支持证券投资	-
4.贵金属投资	-
5.金融衍生品投资	-
6.买入返售金融资产	-
7.银行存款和结算备付金合计	16,349,215.57
8.其他各项资产	12,779,276.77
9.合计	1,163,929,700.14

4.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

4.7.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	16,708,250.81	1.46
B	采矿业	26,749,587.41	2.34
C	制造业	614,210,432.76	53.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,102,141.31	2.98
E	建筑业	33,638,829.80	2.94
F	批发和零售业	74,889,026.67	6.54
G	交通运输、仓储和邮政业	38,676,290.67	3.38
H	住宿和餐饮业	3,923,236.62	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,438,680.74	3.45
J	金融业	26,407,083.14	2.31
K	房地产业	87,715,433.99	7.66
L	租赁和商务服务业	17,270,090.63	1.51
M	科学研究和技术服务业	3,361,843.88	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	7,634,260.36	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,621,522.80	0.93
S	综合	5,223,226.23	0.46
	合计	1,040,569,937.82	90.90

4.7.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,397,659.28	0.30
C	制造业	22,799,837.28	1.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,628,244.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,457,037.32	0.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,089,956.50	0.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	366,292.03	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,739,026.41	3.73

4.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

4.8.1 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所有股票投资明细

金额单位:人民币元

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601099	太平洋	1,093,700	15,552,414.00	1.36
2	002028	思源电气	1,098,008	13,670,199.60	1.19
3	000543	皖能电力	1,019,845	13,094,809.80	1.14
4	600755	厦门国贸	1,060,991	11,989,198.30	1.05
5	000726	鲁泰A	946,667	11,350,537.33	0.99
6	002064	华峰氨纶	943,010	10,090,207.00	0.88
7	600004	白云机场	918,643	10,040,767.99	0.88
8	600183	生益科技	1,201,525	9,588,169.50	0.84
9	002092	中泰化学	1,173,477	9,094,446.75	0.79
10	600720	祁连山	813,299	8,921,890.03	0.78

4.8.2 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所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000559	万向钱潮	452,621	5,372,611.27	0.47
2	600570	恒生电子	94,077	5,151,656.52	0.45
3	002152	广电运通	206,255	4,568,548.25	0.40
4	600398	海澜之家	423,865	4,281,036.50	0.37
5	000518	四环生物	707,574	3,884,581.26	0.34

4.9 报告期内投票投资组合的重大变动

4.9.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000652	泰达股份	11,827,475.73	0.77
2	600640	号百控股	11,425,322.81	0.74
3	600645	中源协和	10,480,178.46	0.68
4	002005	德豪润达	10,026,527.37	0.65
5	002093	国脉科技	9,942,448.33	0.64
6	600435	北方导航	9,730,879.32	0.63
7	600851	海欣股份	9,307,220.33	0.60
8	600787	中储股份	8,764,506.79	0.57
9	601929	吉视传媒	8,615,260.54	0.56
10	600770	综艺股份	8,532,748.23	0.55
11	002153	石基信息	8,419,527.67	0.55
12	601011	宝泰隆	8,118,235.44	0.53
13	002221	东华能源	7,946,141.40	0.51
14	000735	罗 牛 山	7,860,784.53	0.51
15	600587	新华医疗	7,709,006.44	0.50
16	002701	奥瑞金	7,702,174.42	0.50
17	000513	丽珠集团	7,462,211.95	0.48
18	600026	中海发展	7,326,098.69	0.47
19	600570	恒生电子	7,310,756.15	0.47
20	600499	科达洁能	7,215,440.32	0.47

注:买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

4.9.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002292	奥飞动漫	30,280,821.87	1.96
2	002044	美年健康	22,320,728.46	1.44
3	600570	恒生电子	18,784,927.88	1.22
4	600418	江淮汽车	18,735,614.48	1.21
5	000541	佛山照明	17,230,641.42	1.12
6	002022	科华生物	16,974,662.01	1.10
7	002410	广联达	16,300,312.71	1.06
8	002219	恒康医疗	16,065,878.40	1.04
9	000690	宝新能源	15,877,717.04	1.03
10	002048	宁波华翔	15,804,055.49	1.02
11	000612	焦作万方	15,692,978.97	1.02
12	000697	炼石有色	15,238,144.15	0.99
13	002408	齐翔腾达	15,185,027.87	0.98
14	002056	横店东磁	14,460,828.00	0.94
15	000559	万向钱潮	14,357,898.89	0.93
16	000926	福星股份	14,187,328.45	0.92
17	600312	平高电气	13,859,345.91	0.90
18	002480	新筑股份	12,823,134.46	0.83
19	000816	江淮动力	12,507,857.60	0.81
20	002465	海格通信	12,458,960.72	0.81

注:卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

4.9.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	1,423,689,493.57
卖出股票收入(成交)总额	2,173,229,594.41

注:买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

4.10 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,019,000.00	4.37
	其中:政策性金融债	50,019,000.00	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,473,243.57	0.13
8	其他	-	-
9	合计	51,492,243.57	4.50

4.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	1,315,470.00	0.11
2	128005	齐翔转债	157,773.57	0.01

4.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.12.5.1 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中不存在流通受限情况。

4.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002152	广电运通	4,568,548.25	0.40	筹划非公开发行股票

4.12.6 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。

§5 基金份额持有人信息

5.1 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
信诚中证500指数分级A	583	644,294.09	363,911,571.00	96.88%	11,711,882.00	3.12%
信诚中证500指数分级B	10,724	52,539.65	60,411,592.00	10.72%	503,023,589.00	89.28%
信诚中证500指数分级	3,928	44,401.86	105,896,365.16	60.72%	68,514,124.80	39.28%
合计	15,235	73,086.26	530,219,528.16	47.62%	583,249,595.80	52.38%

注:本表列示"占基金总份额比例"中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例,对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

5.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证500指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	瑞士信贷(香港)有限公司	212,404,871.00	56.55%
2	中意人寿保险有限公司	61,787,900.00	16.45%
3	中荷人寿保险有限公司	44,039,275.00	11.72%
4	中意人寿保险有限公司-分红-团体年金	25,284,689.00	6.73%
5	红塔证券-华夏-红塔登峰1号集合资产管理计划	10,720,000.00	2.85%
6	国寿永丰企业年金集合计划-农行	6,122,755.00	1.63%
7	蓝玉萍	4,152,863.00	1.11%
8	新疆电力公司企业年金计划-交通银行股份有限公司	897,200.00	0.24%
9	西南证券股份有限公司	890,090.00	0.24%
10	黄丹妮	830,032.00	0.22%

信诚中证500指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	广州市广百股份有限公司	14,553,564.00	2.58%
2	姜永海	11,853,712.00	2.10%
3	广发证券-招行-广发增强型基金优选集合资产管理计划	11,037,104.00	1.96%
4	蓝玉萍	6,202,500.00	1.10%
5	北京宇山鑫达商贸有限公司	5,300,000.00	0.94%
6	唐代国	4,000,000.00	0.71%
6	招商证券国际有限公司-客户资金	4,000,000.00	0.71%
7	杨传山	3,740,000.00	0.66%
8	刘宁	3,633,702.00	0.64%
9	天风证券-光大银行-天风证券天勤7号集合资产管理计划	3,538,100.00	0.63%
10	何道伟	3,406,325.00	0.60%

注:持有人为境内持有人,对于同一机构不同股东账号下的份额未做合并。

5.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

序号	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	信诚中证500指数分级A	-	-
	信诚中证500指数分级B	-	-
	信诚中证500指数分级	24,341.43	0.01%
	合计	24,341.43	-

注:本表列示"占基金总份额比例"中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例,对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

5.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信诚中证500指数分级A	-
	信诚中证500指数分级B	-
	信诚中证500指数分级	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚中证500指数分级A	-
	信诚中证500指数分级B	-
	信诚中证500指数分级	-
	合计	0

注:1.期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2.期末本基金的基金经理未持有本基金。

5.5 发起式基金发起资金持有份额情况

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚中证500指数分级A	信诚中证500指数分级B	信诚中证500指数分级
基金合同生效日(2011年2月11日)基金份额总额	10,134,545.00	15,201,819.00	348,917,936.10
本报告期期初基金份额总额	696,930,569.00	1,045,395,855.00	289,843,784.59
本报告期基金总申购份额	-	-	943,561,201.02
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,946,896,624.69
本报告期基金拆分变动份额	-321,307,116.00	-481,960,674.00	887,902,129.04
本报告期期末基金份额总额	375,623,453.00	563,435,181.00	174,410,489.96

注:1.拆分变动份额为本基金二级份额之间的配对转换变动份额以及因份额折算产生的份额。
2.根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》,《信诚基金关于信诚中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,基金管理人信诚基金管理有限公司于2014年2月7日折算基准日时本基金进行了基金份额折算。报告期期间基金拆分变动份额中包含经份额折算后产生新增的信诚500份额84,634,339.04份。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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的重大人事变动:

经信诚基金管理有限公司第一届董事会第41次会议审议通过,解聘黄小坚先生信诚基金副总经理职务。本基金管理人已于2014年3月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会及中国证券监督管理委员会上海监管局报备。

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第46次会议审议通过,解聘王俊先生信诚基金总经理职务。本基金管理人已于2014年11月01日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司高