

信诚幸福消费股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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

送出日期：2014 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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 2014 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
§ 5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	9
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	9
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	9
6.1 资产负债表	9
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	11

6.4 报表附注	12
§ 7 投资组合报告	25
7.1 期末基金资产组合情况	25
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	26
7.3 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	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	27
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	28
7.6 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	28
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	28
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	28
7.9 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	28
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	28
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	28
7.12 投资组合报告附注	28
§ 8 基金份额持有人信息	29
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	29
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	29
8.3 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	29
§ 9 开放式基金份额变动	29
§ 10 重大事件揭示	30
10.1 基金份额持有人大会决议	30
10.2 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	30
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	30
10.4 基金投资策略的改变	30
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	30
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	30
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	30
10.8 其他重大事件	32
§ 11 备查文件目录	33
11.1 备查文件名称	33
11.2 备查文件存放地点	33
11.3 备查文件查阅方式	33

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚幸福消费股票型证券投资基金
基金简称	信诚幸福消费股票
基金主代码	000551
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 29 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	361,697,425.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费服务行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金从各子行业国家政策、经济周期和行业估值等三个维度来对消费服务行业各个子类行业进行研究和分析,并在此基础之上实现基金权益资产在各个子行业之间的合理配置和灵活调整。本基金在进行个股筛选时,主要从定性和定量两个角度对行业内上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司。</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。</p> <p>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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险、高收益的品种。

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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张翔燕	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信诚基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日)
本期已实现收益	725,012.21
本期利润	1,952,701.63
加权平均基金份额本期利润	0.0054
本期加权平均净值利润率	0.54%
本期基金份额净值增长率	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	725,012.21
期末可供分配基金份额利润	0.0020
期末基金资产净值	363,650,126.78
期末基金份额净值	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.50%

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、期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

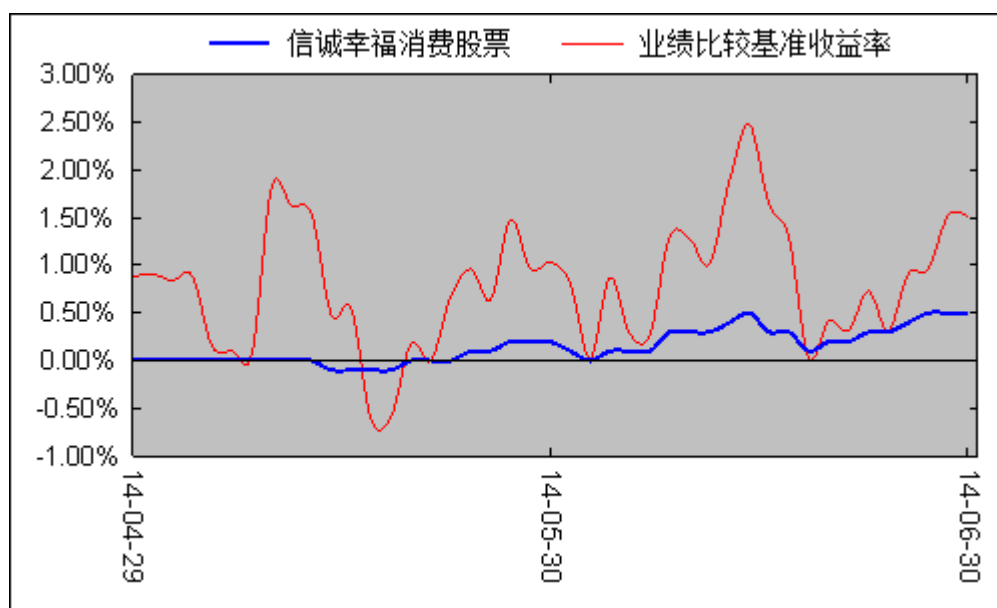
4、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效, 报告期为 2014 年 4 月 29 日至 2014 年 6 月 30 日。

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
过去一个月	0.30%	0.10%	0.49%	0.62%	-0.19%	-0.52%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.08%	1.52%	0.63%	-1.02%	-0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 2014 年 4 月 29 日)。

2、截止本报告期末, 本基金尚处于建仓期。

§ 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 2005 年 9 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、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司, 各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。截至 2014 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 30 只基金, 分别为信诚四季红混合型证券投资基金、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、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债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)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(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、信诚优质纯债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 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定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、信诚月月定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及信诚薪金宝货币市场基金。

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		
杨建标	本基金基金经理, 信诚优胜精选股票基金和信诚新机遇股票(LOF)基金的基金经理	2014 年 4 月 29 日	-	13	理学硕士。13 年证券金融从业经验。历任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部投资经理助理、平安证券有限责任公司综合研究所行业研究员、生命人寿股份有限公司投资管理中心研究总监、浙商基金管理有限公司(筹)投资管理部研究负责人。2010 年 3 月加入信诚基金管理有限公司, 担任投资经理, 现任信诚优胜精选股票基金、信诚新机遇股票(LOF)基金和信诚幸福消费股票基金的基金经理。

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《信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同》、《信诚幸福消费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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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》, 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

本报告期内,未发现本基金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 管理人对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 年上半年,欧美经济和股市整体表现较好,A 股市场更多表现为振荡。年初,国内经济数据表现不佳,蓝筹股缺乏投资机会,而以创业板为代表的成长股曾出现过一波明显上涨,以主题、概念炒作为主的小市值股票更是表现抢眼,但新股恢复发行、注册制改革、机构赎回等事件给予了小市值股票以沉重打击;历经近一个季度调整之后,经济数据和流动性都有所好转,市场开始有整体性的反弹。结构上,计算机、通信、电子涨幅居前;采掘、农林牧渔、建筑装饰表现落后。

本基金二季度成立,建仓期内采取了逢低逐步建仓同时参与新股申购的策略,取得了较好的投资绩效。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 0.50%,同期业绩比较基准增长率为 1.52%,基金落后业绩基准 1.02%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,政治、经济增长格局的稳定将为中国经济增长转型营造良好的环境,虽然反复在所难免,但我们整体上看好未来的股票市场,认为蓝筹股、成长股都有较好的投资机会。一方面,金融地产等传统蓝筹股的估值反映了非常悲观的预期,即便经济增速下一个台阶,其估值也难以大幅下滑;另一方面,转型是中国最根本的投资背景,代表未来转型方向的新兴产业必然充满投资机会,我们依然看好工业自动化和机器人产业、新能源汽车产业、健康消费和服务产业、军工新材料产业、移动互联网应用等产业的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

本基金管理人的估值人员平均拥有 6 年金融从业经验和 3 年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次每份基金份额可供分配利润的 25%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信诚幸福消费股票型证券投资基金

报告截止日:2014 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
----	-----	------------------------

资产：		
银行存款	6.4.7.1	24,251,969.82
结算备付金		13,237,111.80
存出保证金		6,156.06
交易性金融资产	6.4.7.2	26,686,924.74
其中：股票投资		26,686,924.74
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00
应收证券清算款		78,506.95
应收利息	6.4.7.5	29,080.97
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		364,289,750.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		447,064.64
应付托管费		74,510.78
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	33,878.88
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	84,169.26
负债合计		639,623.56
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	361,697,425.15
未分配利润	6.4.7.10	1,952,701.63
所有者权益合计		363,650,126.78
负债和所有者权益总计		364,289,750.34

注:1、截止本报告期末,基金份额净值 1.005 元,基金份额总额 361,697,425.15 份。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体: 信诚幸福消费股票型证券投资基金

本报告期: 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		3,159,054.28
1. 利息收入		1,559,318.65
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	258,237.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,301,081.22
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		364,812.26
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	310,983.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	53,828.88
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,227,689.42
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	7,233.95
二、费用		1,206,352.65
1. 管理人报酬		922,815.84
2. 托管费		153,802.64
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	44,822.43
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	84,911.74
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,952,701.63
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,952,701.63

注:本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 信诚幸福消费股票型证券投资基金

本报告期: 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	361,697,425.15	-	361,697,425.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,952,701.63	1,952,701.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	361,697,425.15	1,952,701.63	363,650,126.78

注:本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王俊锋 _____ 陈逸辛 _____ 时慧 _____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚幸福消费股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准信诚幸福消费股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]124 号文)和《关于信诚幸福消费股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2014]105 号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚幸福消费股票型证券投资基金合同》发售,基金合同于 2014 年 4 月 29 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金于 2014 年 3 月 31 日至 2014 年 4 月 24 日募集,首次向社会公开发售且扣除认购费用后的募集资金金额共计人民币 361,651,790.77, 认购资金在募集期间产生的利息为 45,634.38 元,利息转份额 45,634.38 元,募集规模为 361,697,425.15 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所验证,并出具了普华永道中天验字(2014)第 214 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚幸福消费股票型证券投资基金合同》和《信诚幸福消费股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的 60%-95%,其中,股票投资比例不低于基金资产的 60%;其中投资于消费服务行业上市公司发行的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;其中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%；权证资产不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为 $80\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+20\% \times$ 中信标普全债指数收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

其他金融资产划分为贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外,以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。(a)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 (i) 股票投资 买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。 卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。 出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。(ii) 债券投资 买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。 认购新发行的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资,于权证实际取得日按附注 6.4.4.4 (a) (iii) 所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。 卖出债券于卖出交易日确认债券投资收益/(损失)。 出售债券的成本按移动加权平均法结转。(iii) 权证投资 买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允

价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售证权的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b) 应收款项 应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额,相关交易费用计入初始成本。

(c) 其他金融负债 其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。其他金融负债按公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额,相关交易费用计入初始成本。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,应采用市价确定公允价值;估值日无市价,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,应采用最近交易市价确定公允价值。对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值,另外对金融资产的特殊情况处理如下:

(a) 股票投资 (i) 对因特殊事项长期停牌的股票,如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响,则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日,以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股等未上市的股票,按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值;该日无交易的,以最近一日的收盘价估值。(iii) 首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。(iv) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一种股票的收盘价估值。(v) 非公开发行有明确锁定期的股票,若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本,按估值日证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值;若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本,其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b) 债券投资 (i) 交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价估值,交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。(ii) 首次公开发行未上市的债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。(iii) 全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。(iv) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

(c) 权证投资 (i) 首次公开发行未上市的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。(ii) 配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前,采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量,则按成本计量。(iii) 因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。相关法

律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。实际成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价;

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值;

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

本报告期,本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期,本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵消债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵消后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量,并于期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。债券投资收益/(损失)于卖出债券交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除权除息日确认。债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬根据《信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同》的规定,按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费根据《信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同》的规定,按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。本基金的利息支出按

资金的本金和适用利率逐日计提。 卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。 本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则:

1. 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,每份基金份额每次基金收益分配比例不低于该次每份基金份额可供分配利润的 25%;若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;

2. 本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4. 每一基金份额享有同等分配权

5. 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

法律法规或监管机构另有规定的,基金管理人在履行适当程序后,将对上述基金收益分配政策进行调整,此项调整不需要召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在指定媒体公告。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 自 2005 年 1 月 24 日起,基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起,该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由 0.3%降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1%的税率征收。

(5) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

自 2013 年 1 月 1 日起,根据财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)

的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	24,251,969.82
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	24,251,969.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,459,235.32	26,686,924.74	1,227,689.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,459,235.32	26,686,924.74	1,227,689.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所质押式回购	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末,未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	23,717.40
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,361.05
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.52
合计	29,080.97

注:其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	33,878.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,878.88

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	15,303.33
预提信息披露费	68,865.93
合计	84,169.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	361,697,425.15	361,697,425.15

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	361,697,425.15	361,697,425.15

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	725,012.21	1,227,689.42	1,952,701.63
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	725,012.21	1,227,689.42	1,952,701.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日
活期存款利息收入	102,090.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	139,160.00
结算备付金利息收入	16,980.12
其他	7.23
合计	258,237.43

注：其他指结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日
卖出股票成交总额	6,539,875.54
减：卖出股票成本总额	6,228,892.16
买卖股票差价收入	310,983.38

6.4.7.13 债券投资收益

本基金在本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期未进行贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	53,828.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	53,828.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	1,227,689.42
——股票投资	1,227,689.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,227,689.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	7,233.95
合计	7,233.95

注：1. 本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

2. 其他指基金成立当日 1 天活期存款利息收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	44,822.43
银行间市场交易费用	-
合计	44,822.43

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	15,303.33
信息披露费	68,865.93
银行费用	742.48
合计	84,911.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末,本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

- 1、本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行过交易。
- 2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效,无上年度可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
----	---

当期发生的基金应支付的管理费	922,815.84
其中：支付销售机构的客户维护费	308,006.80

注：1、支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,802.64

注：1、支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

1、基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在本报告期内未投资过本基金。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

1、本基金其它关联方在本报告期末未持有本基金。本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比数。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	24,251,969.82	102,090.08

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2014 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 13,237,111.80 元。(本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

2、本基金合同自 2014 年 4 月 29 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2014 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	网下申购未上市	21.85	21.85	5,047	110,276.95	110,276.95	-

注：除上表所示外，于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风控与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责，其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可用于银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2014年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	24,251,969.82	-	-	-	-	-	24,251,969.82
结算备付金	13,237,111.80	-	-	-	-	-	13,237,111.80
存出保证金	6,156.06	-	-	-	-	-	6,156.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	26,686,924.74	26,686,924.74
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	78,506.95	78,506.95
应收利息	-	-	-	-	-	29,080.97	29,080.97
资产总计	337,495,237.68	-	-	-	-	26,794,512.66	364,289,750.34
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	447,064.64	447,064.64
应付托管费	-	-	-	-	-	74,510.78	74,510.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,878.88	33,878.88
其他负债	-	-	-	-	-	84,169.26	84,169.26
负债总计	-	-	-	-	-	639,623.56	639,623.56
利率敏感度缺口	337,495,237.68	-	-	-	-	26,154,889.10	363,650,126.78

注：1、上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同生效日为 2014 年 4 月 29 日，无上年可比数。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有对利率敏感的金融资产与金融负债，因此可认为市场利率的变动在本期末对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	26,686,924.74	7.34
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	26,686,924.74	7.34

注：本基金合同生效日为 2014 年 4 月 29 日，无上年可比数。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变	
	2、本基金持有的股票的涨跌幅与业绩比较基准中的股票指数的涨跌幅一致	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2014 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	1,334,346.24
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-1,334,346.24

注：本基金合同生效日为 2014 年 4 月 29 日，无上年可比数。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	26,686,924.74	7.33
	其中：股票	26,686,924.74	7.33
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	300,000,000.00	82.35
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,489,081.62	10.29
7	其他各项资产	113,743.98	0.03
8	合计	364,289,750.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	16,232,119.61	4.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,711.40	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	762,093.73	0.21
J	金融业	5,015,000.00	1.38
K	房地产业	4,135,000.00	1.14
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	-	-
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	26,686,924.74	7.34

7.3 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

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	600887	伊利股份	200,000	6,624,000.00	1.82
2	601166	兴业银行	500,000	5,015,000.00	1.38
3	000625	长安汽车	349,966	4,308,081.46	1.18
4	000002	万科A	500,000	4,135,000.00	1.14
5	600079	人福医药	99,992	2,984,761.20	0.82
6	600063	皖维高新	900,000	2,205,000.00	0.61
7	300386	飞天诚信	13,201	762,093.73	0.21
8	600886	国投电力	106,414	542,711.40	0.15
9	603168	莎普爱思	5,047	110,276.95	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	6,837,000.00	1.88
2	601166	兴业银行	5,034,000.00	1.38
3	000625	长安汽车	3,959,373.48	1.09
4	000002	万科A	3,846,000.00	1.06
5	600079	人福医药	2,613,716.78	0.72
6	300124	汇川技术	2,593,515.97	0.71
7	600063	皖维高新	2,082,000.00	0.57
8	600196	复星医药	1,910,232.54	0.53
9	000858	五粮液	1,725,143.65	0.47
10	600886	国投电力	539,518.98	0.15
11	300386	飞天诚信	437,349.13	0.12
12	603168	莎普爱思	110,276.95	0.03

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	2,809,875.54	0.77
2	600196	复星医药	1,980,000.00	0.54
3	000858	五粮液	1,750,000.00	0.48

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	31,688,127.48
卖出股票收入（成交）总额	6,539,875.54

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,156.06
2	应收证券清算款	78,506.95
3	应收股利	-
4	应收利息	29,080.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,743.98

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十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	603168	莎普爱思	110,276.95	0.03	新股未上市

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,033	119,254.01	110,274,265.68	30.49%	251,423,159.47	69.51%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末本公司基金从业人员未持有本基金的基金份额。

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年4月29日)基金份额总额	361,697,425.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	361,697,425.15

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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二届董事会第四十一次会议审议通过，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。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	18,476,949.32	49.04%	16,821.52	49.65%	本期新增
华泰证券	2	16,683,908.64	44.28%	14,763.65	43.58%	本期新增
海通证券	1	2,519,518.98	6.69%	2,293.71	6.77%	本期新增
安信证券	2	-	-	-	-	本期新增
渤海证券	1	-	-	-	-	本期新增
长城证券	1	-	-	-	-	本期新增
长江证券	1	-	-	-	-	本期新增
川财证券	2	-	-	-	-	本期新增
大通证券	1	-	-	-	-	本期新增
东方证券	1	-	-	-	-	本期新增
东兴证券	1	-	-	-	-	本期新增
高华证券	1	-	-	-	-	本期新增
广发证券	1	-	-	-	-	本期新增
国金证券	1	-	-	-	-	本期新增

国联证券	1	-	-	-	-	本期新增
国泰君安	1	-	-	-	-	本期新增
国信证券	1	-	-	-	-	本期新增
红塔证券	1	-	-	-	-	本期新增
宏源证券	2	-	-	-	-	本期新增
华创证券	1	-	-	-	-	本期新增
民生证券	1	-	-	-	-	本期新增
平安证券	1	-	-	-	-	本期新增
齐鲁证券	1	-	-	-	-	本期新增
瑞银证券	1	-	-	-	-	本期新增
山西证券	1	-	-	-	-	本期新增
申银万国	1	-	-	-	-	本期新增
西南证券	1	-	-	-	-	本期新增
信达证券	1	-	-	-	-	本期新增
兴业证券	1	-	-	-	-	本期新增
银河证券	2	-	-	-	-	本期新增
招商证券	2	-	-	-	-	本期新增
浙商证券	1	-	-	-	-	本期新增
中金公司	1	-	-	-	-	本期新增
中投证券	2	-	-	-	-	本期新增
中信金通	1	-	-	-	-	本期新增
中信山东	1	-	-	-	-	本期新增
中信浙江	1	-	-	-	-	本期新增
中银国际	1	-	-	-	-	本期新增

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	回购交易	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信建投	4,520,000,000.00	76.61%
华泰证券	-	-
海通证券	1,380,000,000.00	23.39%
安信证券	-	-
渤海证券	-	-
长城证券	-	-
长江证券	-	-
川财证券	-	-
大通证券	-	-
东方证券	-	-
东兴证券	-	-
高华证券	-	-

广发证券	-	-
国金证券	-	-
国联证券	-	-
国泰君安	-	-
国信证券	-	-
红塔证券	-	-
宏源证券	-	-
华创证券	-	-
民生证券	-	-
平安证券	-	-
齐鲁证券	-	-
瑞银证券	-	-
山西证券	-	-
申银万国	-	-
西南证券	-	-
信达证券	-	-
兴业证券	-	-
银河证券	-	-
招商证券	-	-
浙商证券	-	-
中金公司	-	-
中投证券	-	-
中信金通	-	-
中信山东	-	-
中信浙江	-	-
中银国际	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2014-03-27
2	信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同内容摘要	同上	2014-03-27
3	信诚幸福消费股票型证券投资基金托管协议	同上	2014-03-27
4	信诚幸福消费股票型证券投资基金招募说明书	同上	2014-03-27
5	信诚幸福消费股票型证券投资基金份额发售公告	同上	2014-03-27
6	信诚基金关于信诚幸福消费股票型证券投资基金增加西南证券为代销机构的公告	同上	2014-04-19
7	信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合	同上	2014-04-30

	同生效公告		
8	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140430	同上	2014-05-01
9	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140509	同上	2014-05-10
10	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140516	同上	2014-05-17
11	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140523	同上	2014-05-24
12	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140530	同上	2014-05-31
13	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140606	同上	2014-06-07
14	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140613	同上	2014-06-14
15	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140620	同上	2014-06-21
16	信诚幸福消费股票型证券投资基金净值 20140627	同上	2014-06-28

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件名称

- 1、信诚幸福消费股票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、信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同
- 4、信诚幸福消费股票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

11.2 备查文件存放地点

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。

11.3 备查文件查阅方式

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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日