信诚理财7日盈债券型证券投资基金

【2013】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:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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2013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	信诚理财7日盈债券	
基金主代码	550012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月27日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	348,546,081.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B
下属分级基金的交易代码	550012	550013
报告期末下属分级基金的份额总额	104,048,155.64份	244,497,925.42份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产稳定增值,力争成为投资者短期理财的理想工具。
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(若有)	活期存款利率(税后)
风险收益特征(若有)	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	唐州歆
	联系电话	021-68649788	95566
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	95566
传真		021-50120888	010-66594942

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、基金托管人的办公场所和营业场所

§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	2013年		2012年11月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B
本期已实现收益	2,991,101.91	9,125,755.01	1,958,552.54	1,362,974.39
本期利润	2,991,101.91	9,125,755.01	1,958,552.54	1,362,974.39
本期净值收益率	4.2843%	4.5358%	0.2753%	0.2988%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	104,048,155.64	244,497,925.42	261,498,070.06	21,060,311.45
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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。由于本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、本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2基金净值表现

3.2.1 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

信诚理财7日盈债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	1.2756%	0.0045%	0.0883%	0.0000%	1.1873%	0.0045%
过去六个月	2.4986%	0.0059%	0.1766%	0.0000%	2.3220%	0.0059%
过去一年	4.2843%	0.0061%	0.3506%	0.0000%	3.9337%	0.0061%
自基金合同生效起至今	4.5713%	0.0059%	0.3843%	0.0000%	4.1870%	0.0059%

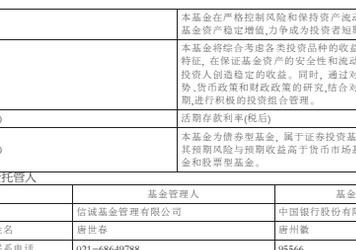
信诚理财7日盈债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	1.3363%	0.0045%	0.0883%	0.0000%	1.2480%	0.0045%
过去六个月	2.6221%	0.0059%	0.1766%	0.0000%	2.4455%	0.0059%
过去一年	4.5358%	0.0061%	0.3506%	0.0000%	4.1852%	0.0061%
自基金合同生效起至今	4.8482%	0.0059%	0.3843%	0.0000%	4.4639%	0.0059%

注:业绩比较标准为活期存款利率(税后)

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

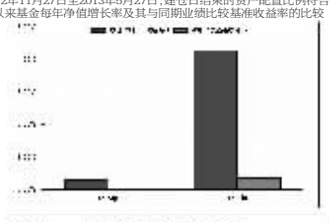
信诚理财7日盈债券A

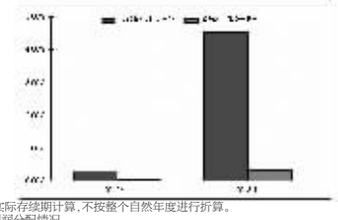


信诚理财7日盈债券B

注:本基金建仓日自2012年11月27日至2013年5月27日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





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

信诚理财7日盈债券A

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013	3,002,247.65	-	-11,145.74	2,991,101.91	-
2012	1,930,035.11	-	28,517.43	1,958,552.54	-
合计	4,932,282.76	-	17,371.69	4,949,654.45	-

信诚理财7日盈债券B

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013	9,085,771.72	-	39,983.29	9,125,755.01	-
2012	1,360,537.95	-	2,436.44	1,362,974.39	-
合计	10,446,309.67	-	42,419.73	10,488,729.40	-

本基金合同自2012年11月27日生效。

§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2013年底,本基金管理人共管理28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、信诚季宏期支付债券性证券投资基金、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及信诚月月宏期支付债券型证券投资基金。

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		
王强	本基金基金经理,信诚添金分级债券基金及信诚年年有余定期开放债券基金基金经理	2012年11月27日	-	14	管理学硕士,14年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚理财7日盈债券基金、信诚添金分级债券基金以及信诚年年有余定期开放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《信诚理财7日盈债券型证券投资基金基金合同》、《信诚理财7日盈债券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 公平交易制度和控制方法

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》,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》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,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。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度、设立防火墙,确保各执投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库、规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合 间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下 (日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差、对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅、签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 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》,以及公司制定的《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。

4.3.3 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

2013年央行执行稳健的货币政策,实质上偏紧,流动性前松后紧,推动货币市场利率步步攀升,下半年达到历史高位。利率市场化改革持续推进,互联网金融发展如火如荼,银行揽储压力增大等因素加剧了货币市场资金利率上行。SHIBOR利率作为同业存款的基准利率,逐季上升。四季度1月期SHIBOR利率季度平均5.616%,高于一、二、三季度的3.752%,4.703%和5.012%的均值水平。本基金的收益水平随着SHIBOR利率的上升而稳步提升。

2013年本基金重点配置高收益存款和高收益短期融资券。抓住6月末、9月末和12月末货币市场利率异常高企的投资机会,配置较高收益的存款,提高投资收益。加强对短期融资券的甄别,防范信用风险,配置信用风险低而收益率相对较高的品种。加强流动性管理,针对本基金的基金份额有固定运作期的特点,根据申购日分布情况,进行资金匹配。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内,本基金A份额净值收益率为4.2843%,B份额净值收益率为4.5358%,同期业绩比较基准收益率为0.3506%,基金表现领先基准。

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2014年,宏观经济增长将保持较低增速,通胀温和可控。部分上游行业以及处于下行周期的行业产能过剩,仍有去产能的要求。在此背景下,央行货币政策仍将保持稳健,市场流动性略紧,货币市场利率仍将维持较高水平。

4.6管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013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、协调监管部门现场检查工作,全面加强公司内控建设。

2013年7月底至8月初,上海证监局对我公司进行了专项现场检查。监察稽核部对本次现场检查进行了积极的配合工作。通过本次现场检查,能更客观地发现公司各项内控中的薄弱环节,有助于督促公司不断改进流程设计,加强内控建设,提高经营效率。

2、对公司管理制度体系不断修订和完善。

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、产品规划决策及开发业务管理、业务系统参数管理、专户产品预警流程、信息安全等方面。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

3、开展各类合规监控工作。

在投资合规监控方面,公司严格遵照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,发现问题及时与相关部门沟通。对销售的合规监控方面,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。

4、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时转新颁布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。在日常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。

5、开展各类内部审计工作,包括4次季度常规审计以及5项针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作。

6、完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的要求进行信息披露和公告,包括基金发行时的法律文件、基金季度报告、半年度报告、年度报告、分红公告以及在深圳证券交易所进行LOF基金生效、开放申赎、上市交易及定期报告等内容的公告,并报监管机关备案。

7、牵头开展反洗钱的各项工作,并按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心。根据人民银行下发的规定,研究落实客户风险等级划分措施。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7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。

4.8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、基金收益分配采用红利再投资方式;

2、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

3、本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位;

4、本基金根据每日收益情况,按当日收益全部分配,若当日净收益大于零时,为投资者记正收益;若当日净收益小于零时,为投资者记负收益;若当日净收益等于零时,当日投资者不记收益;

5、本基金每日进行收益计算并分配,累计收益支付方式只采用红利再投资(国红利转基金份额)方式。若投资者在运作期期末累计收益支付时,累计收益为正值,则为投资者增加相应的基金份额,其累计收益为负值,则缩减投资者基金份额。投资者可通过在基金份额运作期到期日赎回基金份额,可获得当期运作期的基金未支付收益。对于持有超过一个运作期、在当期运作期到期日提出赎回申请的基金份额而言,除获得当期运作期的基金未支付收益外,投资者还可以获得自申购确认日(认购份额自本基金合同生效日)起至上一运作期期末的基金收益;6、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起,不享有基金的分配权益;7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.5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。

7.4.5.6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。

7.4.5.7差错更正的说明

本基金在本报告期间无差错事项。

7.4.6 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]11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。

7.4.7 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	基金管理人的外方股东
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

7.4.8 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。

7.4.8.5通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.6关联方报酬

7.4.8.6.1 基金管理费

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年11月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	742,660.47	317,632.43
其中:支付销售机构的客户维护费	106,722.15	152,695.73

注: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0.27%的年费率计提,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×0.27%/当年天数。

7.4.8.6.2基金托管费

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年11月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	220,047.53	94,113.31

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,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×0.08%/当年天数。

7.4.8.6.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B	合计
中国银行	134,999.96	632.89	135,632.85
信诚基金管理有限公司	4,031.21	19,302.27	23,333.48
合计	139,031.17	19,935.16	158,966.33

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年11月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B	合计
中国银行	175,774.06	4,609.13	180,383.19
信诚基金管理有限公司	19.14	78.61	97.75
合计	175,793.20	4,687.74	180,480.94

注:本基金A类基金份额销售服务费按前一日A类基金份额资产净值的0.25%年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。B类基金份额销售服务费按前一日B类基金份额资产净值的0.01%年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式分别为:

A类基金日销售服务费=A类基金份额前一日资产净值×0.25%/当年天数

B类基金日销售服务费=B类基金份额前一日资产净值×0.01%/当年天数

7.4.8.7与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.8各关联方投资本基金的情况

7.4.8.8.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的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年度及上年度可比期间均未投资过本基金。

7.4.8.8.2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、本基金除基金管理人之外的其它关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

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。

7.4.8.9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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年11月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	222,243.69	34,594.70	3,585,904.93	8,374.99

注:本基金通过“中国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,于本报告期末的相关余额为人民币0.00元。(上年度末余额:人民币0.00元)。

7.4.8.10本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度可比期间在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.5因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限证券。

7.4.9.6期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.6.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额6,364,876.82元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041359009	13南高轮CP001	2014-01-02	100.00	67,000	6,700,000.00
合计				67,000	6,700,000.00

7.4.9.6.2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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§8投资组合报告

8.1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	固定收益投资	84,978,561.15	23.92
	其中:债券	84,978,561.15	23.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,450,291.68	9.70
	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	230,222,243.69	64.80
4	其他各项资产	5,649,433.09	1.59
5	合计	355,300,529.61	100.00

8.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	1.44
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	6,364,876.82	1.83
	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

在本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限本基金情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2013-01-30	133	2013年1月29日遇大额赎回	4
2	2013-01-31	133	2013年1月29日遇大额赎回	3
3	2013-02-01	132	2013年1月29日遇大额赎回	2
4	2013-02-04	129	2013年1月29日遇大额赎回	1
5	2013-03-27	128	2013年3月26日遇大额赎回	1

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127天以内,以规避较长期限债券的利率风险。

8.3.2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	11.38	1.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	68.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	2.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	14.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.32	1.83

8.4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	摊余成本	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	-	-
5	企业短期融资券	84,978,561.15	24.38
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	84,978,561.15	24.38
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041358070	13珠海联邦CP001	200,000	20,000,121.13	5.74
2	041352036	13恒力集CP002	200,000	19,986,102.63	5.73
3	041360032	13昆明制药CP001	100,000	10,000,417.31	2.87
4	041359009	13南高轮CP001	100,000	10,000,065.14	2.87
5	041371001	13华邦CP001	100,000	10,000,000.00	2.87
6	041365011	13海吉星CP002	100,000	9,991,828.34	2.87
7	041369001	13亚太机电CP001	50,000	5,000,026.60	1.43

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.6“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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2438%
报告期内偏离度的最低值	-0.1912%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1017%

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8投资组合报告附注

8.8.1 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