

信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2014 年第四季度报告

2014 年 12 月 31 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

报告送出日期：2015 年 1 月 20 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 2015 年 1 月 16 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 2014 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

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		
报告期末基金份额总额	1,113,469,123.96 份		
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	<p>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%。</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。</p>		
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。		
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
下属三级基金的场内简称	信诚 500A	信诚 500B	信诚 500
下属三级基金的交易代码	150028	150029	165511
报告期末下属三级基金的份额总额	375,623,453.00 份	563,435,181.00 份	174,410,489.96 份

下属三级基金的风险收益特征	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	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（2014 年 10 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	56,809,050.51
2. 本期利润	91,129,718.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0827
4. 期末基金资产净值	1,144,789,682.23
5. 期末基金份额净值	1.028

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。

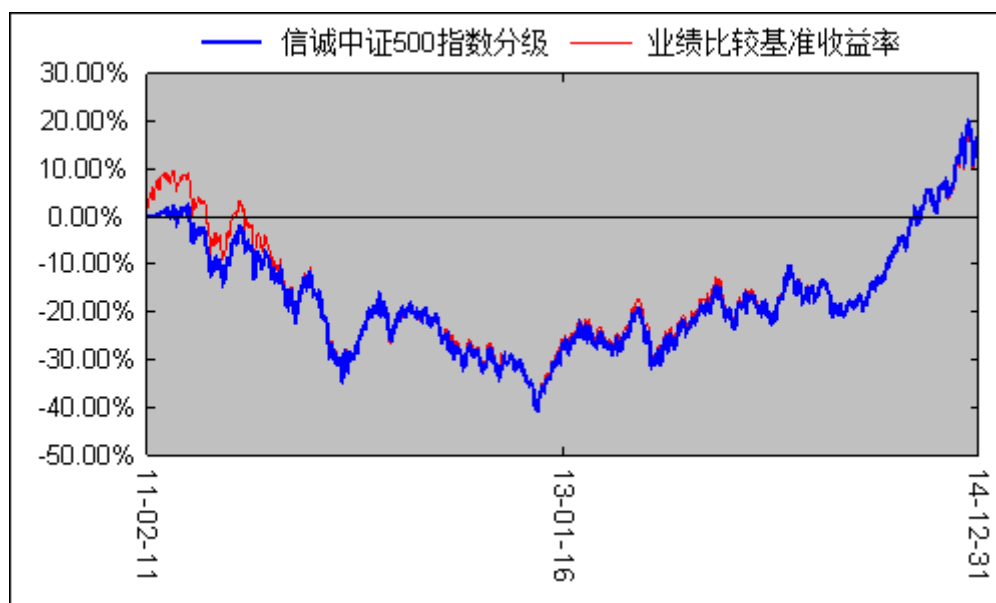
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 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
过去三个月	9.48%	1.35%	7.88%	1.37%	1.60%	-0.02%

##### 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：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。

## § 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, 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	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数量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、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。

	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 理部数量投 资总监				
--	---	--	--	--	--

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》, 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

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 (完全复制的指数基金除外)。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014 年第四季度, A 股在沪港通开闸、央行加大定向宽松力度和广度、降息节奏意外提前、改革信心重建和新增资金任性的联合推动下, 迎来蓝筹股的波澜壮阔的连续上扬和成交量持续放大并创新高的估值修复行情。宏观基本面持续疲软, 1-11 月全国规模以上工业企业利润同比增长 5.3%, 连续 4 月回落并创 2013 年 2 月以来新低。11 月当月利润同比下降 4.2%, 为 2012 年 9 月以来新低。需求不足导致企业销售下滑以及 CPI 和 PPI 剪刀差明显扩大, 对企业利润造成侵蚀。企业收入与盈利增速仍处于历史低位。三季度 GDP 同比增速回落至 7.3%, 投资增速对 GDP 的拉动由二季度的 3.6% 降至 3.1%, 地产仍是最大拖累, 基建投资的增速出现连续多月回落。最终消费对三季度 GDP 拉动为 3.6%, 较二季度减少 0.4%。“三驾马车”中仅进出口稍显亮眼, 超市场预期, 净出口对 GDP 拉动为 0.8%。央行则于 10 月公布新一轮千亿定向放水, 央行向股份制银行投放的不是传统意义的常备借贷便利 (SLF), 而是 MLF (中期借贷便利)。“四中全会”将治理体系现代化作为改革总目标, 其核心是治国思路从人治到法治的根本转变。人治社会下市场规则无力发挥决定性作用, 只有法治社会才能培育出健康的市场经济体系, 从而为市场注入更多改革红利和重建了改革信心。国务院于 11 月 19 日出台降低融资成本 10 条, 今年 5 月至 11 月, 高层连续 10 次提出要降低融资成本, 但政策效果却不尽如意。银行间资金成本出现较大幅度回落, 债券市场利率也大幅下行, 但一般贷款利率却一直高位徘徊, 在目前金融体系, 间接融资仍是主导力量。11 月 21 日傍晚 6 点 30 分, 央行在其网站

发布通知,宣布从 2014 年 11 月 22 日开始,将 1 年期基准贷款利率下调 0.4 个百分点至 5.6%。同时,1 年期基准存款利率下调 0.25 个百分点至 2.75%。央行还宣布,将存款利率浮动的上限从之前基准利率的 1.1 倍上调至 1.2 倍。这是自 2012 年 6 月和 7 月连续两次降息之后,央行两年多来首次调整基准利率。此次降息虽然在情理之中,但时点大幅早于市场预期。央行并且特别指出“在政策出台的同时,人民银行已要求金融机构从促进经济社会发展的大局出发,切实承担社会责任,牢固树立金融服务实体经济的理念,贯彻落实好宏观调控导向,根据基准利率的调整合理确定贷款利率水平”,政策引导降低融资成本意向明确。此次降息属于典型的非对称降息,贷款基准利率的下调幅度大于存款基准利率,并且打开了对进一步降息和全面降准的市场预期。在央行意外降息之后,融资融券的金融创新高,达近万亿规模,银行理财和伞形信托资金跑步入市等新增资金不断推动股市上行,并拉动低估值、以券商和银行为代表的蓝筹股。

本期市场的蓝筹股风格气势如虹、一枝独秀、王者回归。本期上证综指从期初的 2368 升至 3234,走出了近 900 点的大波段,上涨 36.84%,上证 50 指数上涨 59.39%,沪深 300 指数上涨 44.17%,中证 500 指数上涨 8.27%,创业板指数则下跌 4.49%。

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。在市场震荡期间,我们也利用股指期货对冲现金流带来的市场风险。在本报告期内,基金利用股指期货作为工具进行套保,以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差,及应付大额申购赎回,期末现货与股指期货合约总市值占基金净值比例符合法规与风控要求。

作为首只中证 500 指数分级基金,本基金为不同风险偏好的投资者提供了三款不同风险收益特征的投资工具,并且分级份额在场内交易。场内交易的活跃度也可以反映投资者的关注与对市场走势的交易特征。在本报告期内,蓝筹风格和细分行业或主题的分级基金整体呈现连续大幅溢价,资金不断追逐杠杆份额,出现普通投资者购买分级 B 的持续亢奋热潮,“全民买 B”成为时髦,分级基金第一次经历了牛市的洗礼和扩张,出现多只分级基金上折潮,甚至“折上折”的短期多次上折现象。宽基指数分级基金的相对吸引力较弱。信诚 500 则出现场内折价,场内份额在本期相比上期有所下滑。

展望 2015 年第一季度,市场将在新增资金和新的改革举措的引导下,延续估值修复的蓝筹行情。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为 9.48%,同期比较基准收益率为 7.88%。报告期内,本基金日均跟踪误差在 0.35%之内,年化跟踪误差不超过 4%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

## § 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	1,083,308,964.23	93.07
	其中:股票	1,083,308,964.23	93.07
2	固定收益投资	51,492,243.57	4.42
	其中:债券	51,492,243.57	4.42
	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	-	-
	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	16,349,215.57	1.40

7	其他资产	12,779,276.77	1.10
8	合计	1,163,929,700.14	100.00

## 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	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

### 5.2.2 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

### 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

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	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

#### 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

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	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

### 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	-	-
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
---	----	---------------	------

### 5.5 报告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

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	140204	14 国开 04	300,000	30,006,000.00	2.62
2	140212	14 国开 12	100,000	10,013,000.00	0.87
3	140213	14 国开 13	100,000	10,000,000.00	0.87
4	110015	石化转债	9,750	1,315,470.00	0.11
5	128005	齐翔转债	1,216	157,773.57	0.01

### 5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

### 5.7 报告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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

### 5.8 报告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

本基金本报告期内未进行权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	在本报告期内,基金利用股指期货作为工具进行套保,以配合现货投资复制标的指数减小跟踪误差,及应付大额申购赎回
公允价值变动总额合计(元)				-	
股指期货投资本期收益(元)				838,920.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-167,400.00	

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。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 中国石油化工股份有限公司分别于 2014 年 1 月 12 日和 2013 年 11 月 24 日对中石化青岛的重大事故进行了公告披露:2013 年 11 月 22 日凌晨,中国石油化工股份有限公司(以下简称“公司”)位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂,导致原油泄漏,部分原油漏入市政排水暗渠,流入海岔。事故发生后,公司立即关闭输油,并开始抢险处置。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币 75,172 万元,公司将承担其相应赔偿责任。相关资金主要来自中石化在以前年度积累的安全生产保险基金(指经国家有关部门批准由中国石油化工集团公司面向公司所属企事业单位设立的企业安全生产保险基金)和公司向商业保险公司投保的商业巨灾保险的保险理赔资金。目前公司的生产经营稳定,成品油市场供应稳定。

对石化转债的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该债券,其信用等级长期稳定为 AAA。该公司近年来生产、销售和利润保持稳定增长,此次事故并未对其长期企业经营和投资价值产生重大实质性影响。该债券投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	158,456.83
2	应收证券清算款	10,405,683.67
3	应收股利	-
4	应收利息	1,965,153.13
5	应收申购款	249,983.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,779,276.77

#### 5.11.4 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	1,315,470.00	0.11
2	128005	齐翔转债	157,773.57	0.01

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 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中不存在流通受限情况。

##### 5.11.5.2 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净值比例	流通受限情况说
----	------	------	----------	-----------	---------

			允价值(元)	(%)	明
1	002152	广电运通	4,568,548.25	0.40	重大事项

#### 5.11.6 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
报告期期初基金份额总额	394,820,801.00	592,231,203.00	116,960,389.84
报告期期间基金总申购份额	-	-	167,984,131.66
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	158,527,401.54
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-19,197,348.00	-28,796,022.00	47,993,370.00
报告期期末基金份额总额	375,623,453.00	563,435,181.00	174,410,489.96

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

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。

本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1、信诚中证 500 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、信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证 500 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

## 9.2 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。

## 9.3 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.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司  
2015 年 1 月 20 日